



HF MEFFGate FIX M5.15

Especificaciones de la interfaz FIX de MEFF / 23/11/2022

Cambios realizados en la última revisión

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas en la versión M5.15 (respecto de la información pública de la versión M5.13 del 27 de septiembre de 2022):

- Market Data Snapshot Full Refresh: se añade nuevo campo de usuario RetailCIFlag [21507] para precios que contienen ordenes de retail

Tabla de contenido

| | |
|---|-----------|
| CAMBIOS REALIZADOS EN LA ÚLTIMA REVISIÓN..... | 1 |
| 1 INTRODUCCIÓN | 7 |
| 1.1 Ambito de este manual | 7 |
| 1.2 Información pública | 7 |
| 1.3 Organización del manual | 8 |
| 1.4 Formato de las tablas de definición de mensajes | 8 |
| 1.5 Documentos relacionados | 9 |
| 2 DECISIONES DE IMPLEMENTACIÓN..... | 10 |
| 2.1 Descripción | 10 |
| 2.2 Campos ignorados | 10 |
| 2.3 Campos no soportados | 10 |
| 2.4 Longitud del tipo String | 10 |
| 2.5 Máxima longitud de mensaje | 10 |
| 2.6 Encriptación | 10 |
| 2.7 Identificación del protocolo HF MEFFGate FIX | 10 |
| 3 SESIÓN FIX..... | 11 |
| 3.1 Introducción | 11 |
| 3.2 Sesión FIX y sesión de comunicación | 11 |
| 3.3 Identificación de la sesión FIX | 11 |
| 3.4 Software cliente y sesiones FIX | 12 |
| 3.5 Inicio de la sesión FIX | 12 |
| 3.6 Sincronización a nivel de aplicación | 12 |
| 3.7 Alta disponibilidad | 14 |
| 3.8 Lista de mensajes | 14 |
| 3.9 Flujo de mensajes | 14 |
| 3.10 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0 | 16 |
| 3.11 Definición de mensajes | 17 |
| 3.11.1 Standard Message Header | 17 |

| | | |
|----------|---|-----------|
| 3.11.2 | Standard Message Trailer | 19 |
| 3.11.3 | Logon (Msg Type = A) | 20 |
| 3.11.4 | Logout (Msg Type = 5) | 22 |
| 3.11.5 | Heartbeat (Msg Type = 0) | 23 |
| 3.11.6 | Test Request (Msg Type = 1) | 24 |
| 3.11.7 | Reject (Msg Type = 3) | 25 |
| 4 | CONVENCIONES GENERALES EN LOS MENSAJES DE APLICACIÓN | 27 |
| 4.1 | Bloque Instrument27 | |
| 4.1.1 | SecurityType [167] | 27 |
| 4.1.2 | Activo subyacente (campo SecurityID [48]) | 27 |
| 4.1.3 | Vencimiento (campo MaturityMonthYear [200]) | 27 |
| 4.1.4 | Combinación de criterios de selección | 27 |
| 4.2 | Limitación en el máximo número de suscripciones vivas permitidas | 28 |
| 4.3 | Recepción de la información pública a partir de un determinado punto de la sesión | 28 |
| 4.4 | Campos no informados en recepción de información | 28 |
| 4.5 | Formato en que se desea recibir las horas | 30 |
| 4.6 | Tipo de dato SeqNum | 30 |
| 4.7 | Correspondencia MMT-FIX | 30 |
| 5 | MENSAJES GENÉRICOS DEL NIVEL DE APLICACIÓN | 34 |
| 5.1 | Introducción | 34 |
| 5.2 | Estado de la comunicación | 34 |
| 5.3 | Cambio de password de conexión al HF MEFFGate | 34 |
| 5.4 | Rechazo de mensajes de aplicación | 34 |
| 5.5 | Lista de mensajes | 34 |
| 5.6 | Flujo de mensajes | 35 |
| 5.7 | Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0 | 35 |
| 5.8 | Definición de mensajes | 36 |
| 5.8.1 | Network Counterparty System Status Request (Msg Type = BC) | 36 |
| 5.8.2 | Network Counterparty System Status Response (Msg Type = BD) | 37 |
| 5.8.3 | Business Message Reject (MsgType = j) | 38 |
| 5.8.4 | User Request (Msg Type = BE) | 39 |
| 5.8.5 | User Response (Msg Type = BF) | 40 |
| 6 | INFORMACIÓN DE MERCADO | 41 |
| 6.1 | Introducción | 41 |
| 6.2 | Información de mercado: Estado de la sesión | 42 |

| | | |
|--------|---|-----|
| 6.2.1 | Descripción..... | 42 |
| 6.2.2 | Lista de mensajes..... | 42 |
| 6.2.3 | Flujo de mensajes..... | 42 |
| 6.2.4 | Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0..... | 43 |
| 6.3 | Información de mercado: Contratos | 44 |
| 6.3.1 | Descripción..... | 44 |
| 6.3.2 | Solicitud de información de contratos..... | 44 |
| 6.3.3 | Recepción de la definición de contratos..... | 44 |
| 6.3.4 | Recepción del estado de contratos..... | 44 |
| 6.3.5 | Lista de mensajes..... | 45 |
| 6.3.6 | Flujo de mensajes..... | 46 |
| 6.3.7 | Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0..... | 49 |
| 6.4 | Información de mercado: Precios | 50 |
| 6.4.1 | Descripción..... | 50 |
| 6.4.2 | Solicitud de información..... | 50 |
| 6.4.3 | Recepción de información..... | 50 |
| 6.4.4 | Lista de mensajes..... | 51 |
| 6.4.5 | Flujo de mensajes..... | 51 |
| 6.4.6 | Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0..... | 52 |
| 6.5 | Definición de mensajes | 53 |
| 6.5.1 | Trading Session Status Request (Msg Type = g)..... | 53 |
| 6.5.2 | Trading Session Status (Msg Type = h)..... | 54 |
| 6.5.3 | Security List Request (Msg Type = x)..... | 57 |
| 6.5.4 | Security List (Msg Type = y)..... | 58 |
| 6.5.5 | Security List Update Report (Msg Type = BK)..... | 70 |
| 6.5.6 | Security Status Request (MsgType = e)..... | 82 |
| 6.5.7 | Security Status (MsgType = f)..... | 83 |
| 6.5.8 | Market Data Request (Msg Type = V)..... | 86 |
| 6.5.9 | Market Data Request Reject (Msg Type = Y)..... | 88 |
| 6.5.10 | Market Data Snapshot Full Refresh (Msg Type = W)..... | 89 |
| 7 | RFQ Y INDICACIÓN DE INTERÉS..... | 99 |
| 7.1 | Introducción | 99 |
| 7.2 | Lista de mensajes | 99 |
| 7.3 | Flujo de mensajes | 100 |
| 7.4 | Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0 | 100 |
| 7.5 | Definición de mensajes | 101 |
| 7.5.1 | Indication of Interest (Msg Type = 6)..... | 101 |
| 8 | COMUNICACIÓN DE EVENTOS..... | 103 |
| 8.1 | Introducción | 103 |
| 8.2 | Lista de mensajes | 103 |

| | | |
|-------------------------------------|---------------------------------------|------------|
| 8.3 | Flujo de mensajes | 103 |
| 8.4 | Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0 | 103 |
| 8.5 | Definición de mensajes | 104 |
| 8.5.1 | News (Msg Type = B) | 104 |
| APÉNDICE A CAMPOS DE USUARIO | | 105 |

1 Introducción

1.1 Ambito de este manual

Este documento contiene la definición de la interfaz ofrecida por MEFF para el desarrollo de aplicaciones externas sobre el sistema de contratación MEFF. Dicha interfaz está basada en el estándar FIX Protocol (Financial Information eXchange), en su versión 5.0. Para una información detallada del estándar, consúltese el documento de referencia 1 (ver 1.5) o la página www.fixprotocol.org.

La interfaz sigue, tanto como es posible, las especificaciones de FIX 5.0. En la mayoría de los casos la estructura y semántica de los mensajes es idéntica al estándar.

En algunos casos se han realizado extensiones del protocolo, por ejemplo para cubrir funcionalidades que no han sido consideradas por el estándar. Dichas extensiones están claramente detalladas en el documento.

En otros casos el estándar es ambiguo, o indica que los detalles deben ser acordados mutuamente entre las partes. En estos casos el manual contiene una descripción detallada que elimina las posibles ambigüedades.

Todas las acotaciones y adaptaciones del estándar se han llevado a cabo siguiendo las recomendaciones especificadas por el propio estándar.

Para evitar posibles duplicidades como fuente de información, este documento no incluye explicaciones de aquellos aspectos que cumplen exactamente con el estándar. Para cualquier tema que no esté explícitamente detallado en este manual, debe considerarse la documentación del estándar como fuente de información.

El propósito de este documento es servir de base para los Miembros e ISVs que deseen desarrollar software para procesar los datos públicos mediante la interfaz FIX del servidor HF MEFFGate.

1.2 Información pública

En la siguiente tabla se presentan las funciones públicas y los mensajes relacionados.

| Función Pública | Mensajes relacionados |
|--|--|
| Obtención del estado de sesión | Trading Session Status Trading Session Status Request Security List Request Security List |
| Obtención de información de contratos | Security List Update Report Security Status Request Security Status |
| Obtención de información de precios | Market Data Request Market Data Request Reject Market Data – Snapshot / Full Refresh |
| Obtención de información acerca de los RFQ | Indication of Interest |
| Recepción de información del Supervisor de Mercado | News |

1.3 Organización del manual

El presente manual está organizado en dos partes diferenciadas. En la primera parte, formada por los primeros cuatro capítulos, se describen aspectos genéricos de esta interfaz.

Éste, el primer capítulo, describe el ámbito del documento, presenta la estructura del mismo e introduce los documentos relacionados.

En el capítulo 2 “Decisiones de Implementación”, se presentan aquellas acotaciones o restricciones derivadas de la implementación del protocolo que define este manual.

El capítulo 3 “Sesión FIX” describe aquellos aspectos relacionados con el nivel de sesión, incluyendo la descripción detallada de los mensajes correspondientes.

El capítulo 4 “Convenciones generales en los mensajes de aplicación” describe con detalle aspectos concretos que afectan a la mayoría de mensajes descritos en este manual.

Dado su contenido genérico, que afecta a todos los mensajes, se recomienda una lectura previa de los capítulos 2 , 3 y 4 antes de pasar al resto de capítulos.

La segunda parte del manual, formada por el resto de capítulos, describe las diferentes funcionalidades soportadas por HF MEFFGate. En cada uno de estos capítulos se trata una funcionalidad concreta, describiendo aquellos aspectos particulares que son de interés.

En cada uno de estos capítulos están presentes, entre otros, los siguientes apartados:

- **Introducción.** Presenta una breve descripción de la funcionalidad abordada en el capítulo
- **Lista de mensajes.** Relaciona los diferentes mensajes que implementan la funcionalidad tratada en el capítulo
- **Flujo de mensajes.** Describe los diferentes escenarios de intercambio de mensajes que se pueden dar. Incluye los correspondientes diagramas de flujo de mensajes
- **Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0.** Detalla las acotaciones y adaptaciones del protocolo estándar realizadas por MEFF para adaptarlo a sus requerimientos
- **Definición de mensajes.** Contiene una tabla para cada mensaje del capítulo, que describe de forma detallada los campos que lo conforman

1.4 Formato de las tablas de definición de mensajes

Tal y como se explica en el apartado anterior, en los capítulos en que sea necesario se incluye una tabla por cada mensaje, que describe de forma detallada los campos que lo conforman.

Estas tablas contienen un campo por fila y presentan las siguientes columnas:

| Columna | Significado |
|---------|---|
| Tag | Número de campo. Los campos añadidos al mensaje en esta implementación presentan un asterisco (“*”) a continuación de este número |
| Nombre | Nombre del campo según el estándar FIX |

| | |
|-----------------|---|
| Req | "S" indica que el campo es requerido, "N" significa que el campo es opcional. "S*" significa que el campo es requerido en esta implementación, pero opcional en el estándar FIX 5.0 |
| Valores válidos | Valores válidos del campo en el contexto del mensaje. Puede ser una lista de valores, o un rango de valores numéricos, p.ej. ">=3, <= 10". En esta columna también se indica el valor por defecto del campo. Para evitar confusiones con los términos, en los valores asociados a códigos se ha respetado la descripción del valor original de FIX, y por tanto no se ha traducido |
| Formato | Tipo de dato del campo. Es uno de los tipos definidos por FIX, o uno de estos tipos con alguna restricción adicional. String(n) es un tipo String con un máximo de n caracteres, o en algunos casos con exactamente n caracteres. Para más información sobre el tipo String consúltese 2.4 |
| Descripción | Descripción del campo en el contexto del mensaje |

1.5 Documentos relacionados

| # | Título | Autor |
|---|---|---------------|
| 1 | Financial Information Exchange Protocol (FIX) 5.0 Service Pack 2 (9 December 2013) EP98-222 enhancing FIX 5.0 SP2 | FIX Committee |
| 2 | HF MEFFGate – Especificaciones de la interfaz FIX T5.0 | MEFF |

2 Decisiones de Implementación

2.1 Descripción

En este capítulo se presentan las decisiones de implementación tomadas por MEFF. Aquí se detallan aquellos aspectos que el estándar deja abiertos y que han sido definidos en esta implementación.

2.2 Campos ignorados

En algunos casos, el contenido de ciertos campos de los mensajes de entrada puede ser ignorado por HF MEFFGate. Cuando éste es el caso, está claramente explicitado en la descripción del campo.

2.3 Campos no soportados

Los campos que no están soportados en un mensaje no se han incluido en la descripción del mismo.

Los mensajes enviados a HF MEFFGate no deben contener campos no soportados. Los mensajes enviados por HF MEFFGate nunca contienen campos no soportados.

Ningún campo requerido ha sido declarado no soportado.

2.4 Longitud del tipo String

El estándar FIX no impone ninguna restricción de longitud máxima sobre el tipo String. En esta implementación la longitud máxima es de 255 caracteres.

En algunos campos se ha fijado una longitud máxima inferior a este valor. En estos casos el tipo se presenta como String(n), donde “n” es el número máximo de caracteres del campo. En ciertos casos “n” indica la longitud exacta del campo, en dicho caso será explícitamente mencionado en la columna de valores válidos.

2.5 Máxima longitud de mensaje

La longitud máxima de los mensajes enviados o recibidos por HF MEFFGate es de 4096 bytes.

2.6 Encriptación

HF MEFFGate no usa la encriptación que define el estándar FIX (mediante los campos SecureData and SecureDataLen de la cabecera del mensaje). La encriptación está implementada mediante el uso de SSL (*Secure Socket Layer*).

2.7 Identificación del protocolo HF MEFFGate FIX

HF MEFFGate implementa una funcionalidad adicional que permite que ambas partes se pongan de acuerdo en la versión de HF MEFFGate FIX que van a usar.

No debe confundirse la versión del protocolo FIX (en este caso “5.0”), con la versión del protocolo HF MEFFGate FIX (“M5.15” en esta edición).

Podrá existir más de una versión del protocolo HF MEFFGate FIX dentro de una misma versión de FIX.

Si la versión solicitada por el cliente no está disponible en el servidor HF MEFFGate en uso, éste responde con un mensaje Logout con el correspondiente mensaje explicativo.

3 Sesión FIX

3.1 Introducción

El nivel de sesión FIX garantiza la entrega de mensajes, entre ambas partes, de forma completa y sin errores. HF MEFFGate implementa la mayoría de las funcionalidades del nivel de sesión definidas en el estándar FIX 5.0.

3.2 Sesión FIX y sesión de comunicación

Existen dos tipos de sesión:

- **Sesión de comunicación.** Se inicia cuando se abre el socket mediante la dirección ip y número de puerto asignados a este servicio. Finaliza al cerrar dicho socket.
- **Sesión FIX.** Se inicia cuando una petición de inicio de sesión (mensaje Logon) es aceptada. Termina cuando finaliza la comunicación, preferiblemente con el intercambio de mensajes Logout. Está compuesta por un conjunto de mensajes bidireccionales identificados por una secuencia de números consecutivos. Una sesión FIX se inicia cuando la secuencia de números de ambas partes se reinicia con el valor 1. No existe una forma explícita de finalizar una sesión FIX; una sesión se acaba cuando se inicia una nueva.

Además de los dos tipos de sesión enumerados, debe considerarse el concepto de sesión de negociación. Una sesión de negociación en un entorno empieza cada día en el momento en que el servidor HF MEFFGate carga los datos del sistema y acepta conexiones para dicha sesión de negociación.

El cliente debe iniciar una nueva sesión FIX cada vez que se establece una nueva sesión de comunicaciones.

Dado que HF MEFFGate no soporta el servicio 24 horas, el campo ResetSeqNumFlag no es necesario en el mensaje Logon.

3.3 Identificación de la sesión FIX

Una vez se ha establecido una sesión de comunicación, HF MEFFGate identifica la sesión FIX asociada a partir de cuatro campos del mensaje de Logon enviado por el iniciador:

- SenderCompID
- SenderSubID
- TargetCompID
- TargetSubID

SenderCompID identifica al miembro y SenderSubID identifica al operador. TargetCompID junto con TargetSubID identifican al entorno.

No puede existir más de una sesión FIX concurrente con los mismos valores en estos cuatro campos.

Los campos SenderCompID, SenderSubID, TargetCompID y TargetSubID están presentes en todos los mensajes FIX. Todos los mensajes pertenecientes a una misma sesión FIX deben mantener los mismos valores en estos campos. Si se recibe un mensaje cuyos valores no se corresponden con los de la sesión, será rechazado con un mensaje Reject.

Hay que tener en cuenta que los valores de estos campos se invierten, respecto a los enviados por el cliente, cuando el mensaje es enviado por HF MEFFGate. Supongamos que el operador "001" perteneciente al miembro "A001" tiene establecida una sesión con el grupo de contratos de Derivados Financieros de MEFF. Los valores serán los que se muestran a continuación:

Mensaje del cliente a HF MEFFGate:

- SenderCompID = "A001"
- SenderSubID = "001"
- TargetCompID = Operating MIC
- TargetSubID = "M3"

Mensaje de HF MEFFGate al cliente:

- SenderCompID = Operating MIC
- SenderSubID = "M3"
- TargetCompID = "A001"
- TargetSubID = "001"

La lista de valores de los tags TargetCompID/SenderCompID está disponible en la tabla 2 del documento "Codification tables".

La lista de valores de los tags TargetSubID/SenderSubID está disponible en la tabla 1 del documento "Codification tables".

3.4 Software cliente y sesiones FIX

Un cliente de HF MEFFGate es un desarrollo software que se conecta a MEFF mediante el servidor HF MEFFGate.

Tal y como se vio en 3.3 , una sesión FIX queda limitada a un usuario y un grupo de contratos. Un cliente podrá establecer varias sesiones FIX simultáneas, para operar en un grupo de contratos con varios códigos de usuario.

Un servidor HF MEFFGate puede dar servicio a varias sesiones simultáneamente, ya sean de un mismo cliente o de varios.

Cuando un cliente FIX intenta conectar con un grupo de contratos que no está disponible, su mensaje de Logon es contestado con un mensaje Logout con la explicación pertinente.

3.5 Inicio de la sesión FIX

Al iniciar una sesión de comunicación (envío de mensaje Logon), el cliente debe iniciar una nueva sesión FIX. A continuación se describe el procedimiento a seguir:

- Inicio de nueva sesión FIX: Se deberá usar el número 1 en el campo MsgSeqNum del mensaje Logon
- Debe tenerse en cuenta que cualquier suscripción a información es cancelada al finalizarse la sesión de comunicación. Si al reconectar una sesión FIX se desea este servicio, debe volver a solicitarse

3.6 Sincronización a nivel de aplicación

Cuando un cliente inicia una sesión FIX (mensaje Logon aceptado), recibe un conjunto de información relacionada con la sesión de negociación actual.

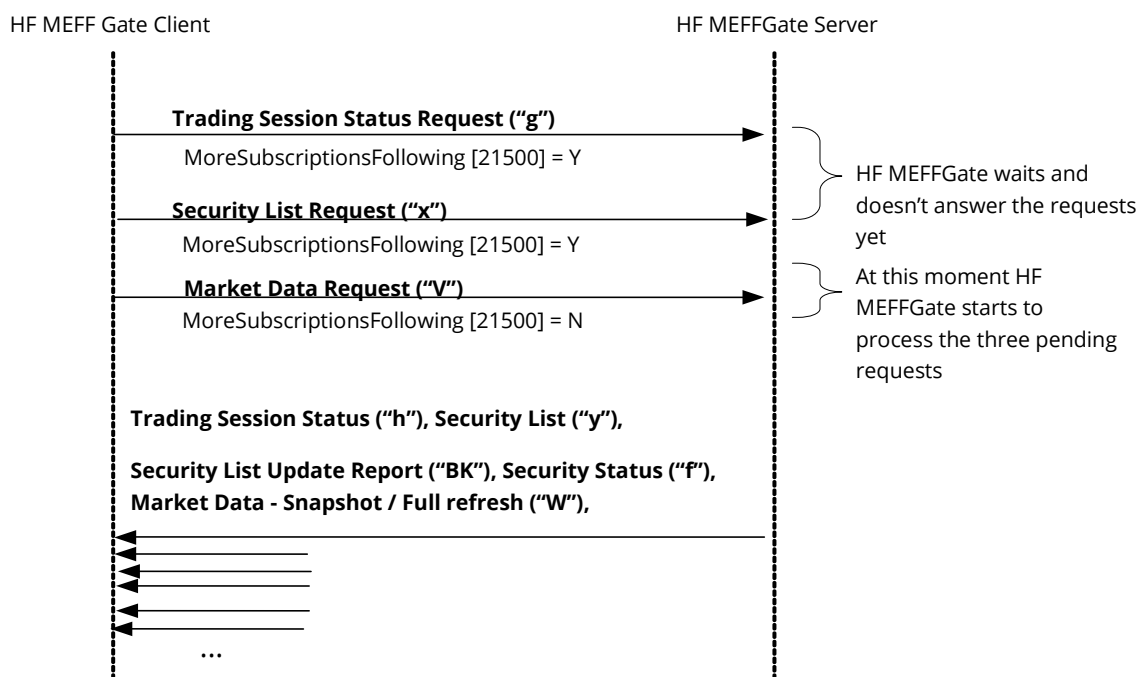
Para establecer el sincronismo a nivel de aplicación, el cliente puede utilizar los campos ApplID [1180] + ApplSeqNum [1181]. El valor 0 en ApplID [1180] y ApplSeqNum [1181] significa que se desea la actualización desde el primer mensaje de la sesión. Si no se indica este campo se presupone el comportamiento clásico (snapshot de la situación actual y updates a partir de este momento)

Se recomienda el uso del campo de usuario `MoreSubscriptionsFollowing` [21500], (**`MoreSubscriptionsFollowing` [21500] = "Y"**), en cada una de las peticiones de suscripción. De esta manera se pueden agrupar las peticiones de suscripción relativas a información de mercado (`Trading Session Status Request`, `Security List Request`, `Security Status Request` y `Market Data Request`) y establecer el momento en que HF MEFFGate va a empezar a atenderlas, enviando los distintos tipos de mensaje en el mismo orden en que han sido generados durante la sesión; ello implica que se podrían recibir, por ejemplo, mensajes `Market Data Snapshot Full Refresh` mientras se están recibiendo mensajes `Security List Update Report`. Se puede utilizar para la recepción de información pública desde un determinado punto de la sesión para la gestión de conexiones después de una desconexión.

Cuando se utilice este campo (`MoreSubscriptionsFollowing` [21500] = "Y"), HF MEFFGate va a dejar las distintas suscripciones en estado de pendiente y va a esperar a procesarlas hasta que se envíe una suscripción con `MoreSubscriptionsFollowing` [21500] = "N". A partir de este momento HF MEFFGate presupone que la aplicación cliente no va a enviar más suscripciones por lo que cualquier nueva petición sería rechazada.

Si no se utiliza este campo (o `MoreSubscriptionsFollowing` [21500] = "N" para todas las suscripciones), se supone el comportamiento actual, o sea, una respuesta inmediata después de cada petición de suscripción.

A continuación se muestra un ejemplo de uso del campo `MoreSubscriptionsFollowing` [21500]:



Debe tenerse en cuenta que cualquier suscripción a información es cancelada al finalizarse la sesión FIX. Si al reconectar una nueva sesión se desea este servicio, debe volver a solicitarse.

El conjunto de mensajes no asociados a suscripciones que se menciona en este apartado se corresponde con los siguientes mensajes:

- News

3.7 Alta disponibilidad

Para mejorar la disponibilidad de acceso a MEFF se dispondrá de varias instancias del servidor HF MEFFGate ejecutándose en equipos diferentes.

Todas las instancias de HF MEFFGate estarán conectadas con los sistemas centrales de MEFF. Por tanto, dispondrán de toda la información necesaria.

Cuando falla el servidor HF MEFFGate, el cliente puede continuar trabajando con otro HF MEFFGate. El cliente debe realizar los procesos necesarios para sincronizarse a nivel de aplicación usando los campos ApplID [1180] + ApplSeqNum [1181].

Cuando falla una aplicación cliente que tenía establecida una sesión FIX, la aplicación cliente puede sincronizarse a nivel de aplicación desde otro equipo mediante el mismo procedimiento descrito en el párrafo anterior.

3.8 Lista de mensajes

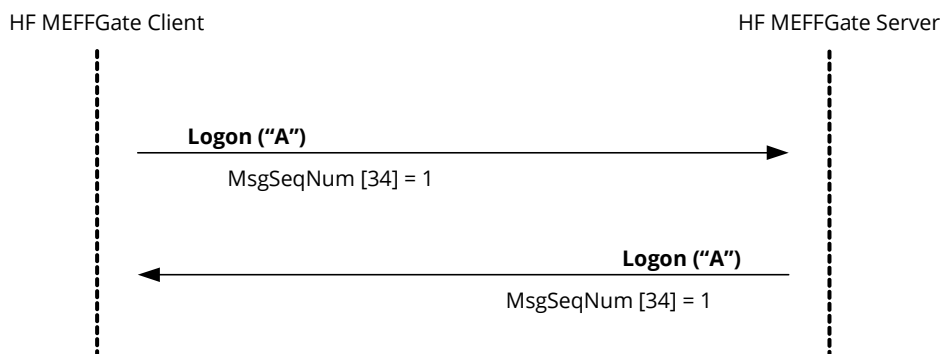
La funcionalidad de nivel de sesión se implementa en FIX 5.0 mediante cinco mensajes administrativos. Todos ellos están completamente soportados por el protocolo FIX de HF MEFFGate.

| Mensaje | Descripción |
|-------------------------------------|--|
| Logon (Msg Type = A) | Solicitud o confirmación del inicio de una sesión FIX |
| Logout (Msg Type = 5) | Solicitud o confirmación de la finalización de una sesión FIX |
| Heartbeat (Msg Type = 0) | Notificación periódica de que la conexión permanece viva |
| Test Request (Msg Type = 1) | Solicitud de envío de un mensaje Heartbeat para confirmar que la conexión permanece viva |
| Reject (Msg Type = 3) | Rechazo de mensaje a nivel de sesión |

3.9 Flujo de mensajes

Inicio de sesión FIX

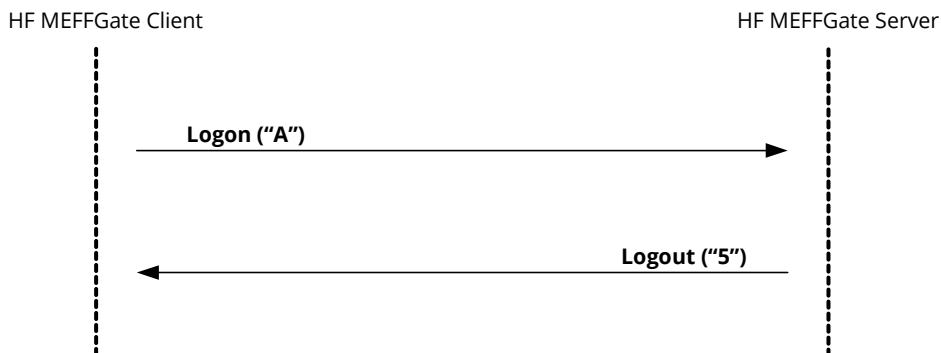
Una petición de inicio de sesión FIX (mensaje Logon) aceptada, es contestada por el receptor con otro mensaje Logon. El iniciador no debe enviar ningún otro mensaje hasta que haya recibido esta confirmación de aceptación.



Inicio de sesión FIX rechazado

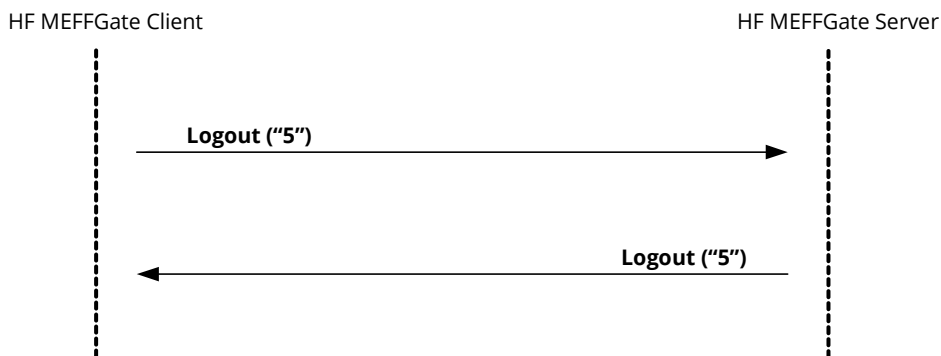
Cuando un inicio de sesión FIX (mensaje Logon) no es aceptado, HF MEFFGate contestará con un mensaje Logout.

Para más detalle sobre el comportamiento de los números de secuencia de ambas partes consultar el apartado 3.5 .



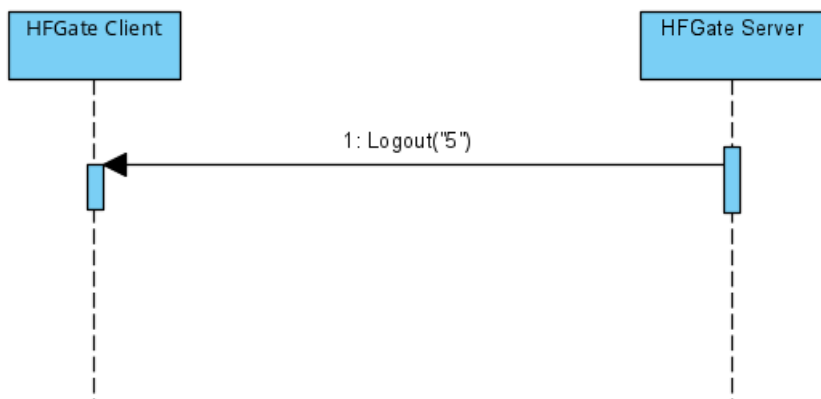
Finalización de la sesión FIX iniciada por el emisor

El cliente puede, en cualquier momento, finalizar la sesión FIX mediante el envío de un mensaje Logout.



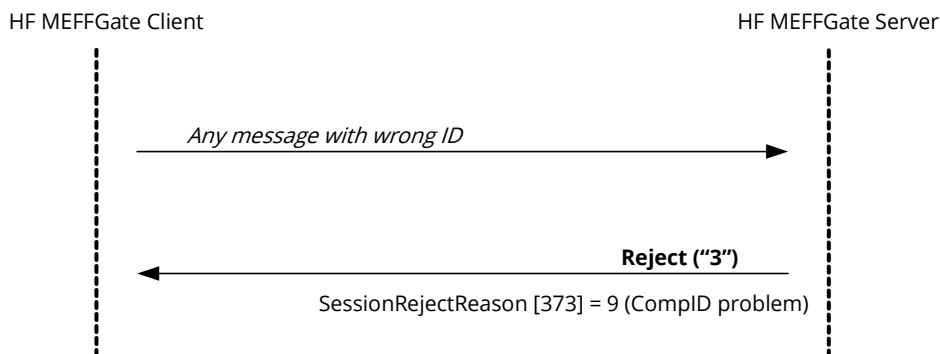
Finalización de la sesión FIX iniciada por el receptor

En situaciones excepcionales el servidor puede terminar la sesión FIX mediante un mensaje Logout.



Envío de mensaje con los campos de identificación de sesión (SenderCompID, SenderSubID, TargetCompID y TargetSubID) con valores diferentes a los asociados a la sesión FIX actual

Todos los mensajes asociados a una sesión FIX deben incluir los mismos valores identificadores de sesión (SenderCompID, SenderSubID, TargetCompID y TargetSubID). Si un mensaje difiere de los valores indicados en el Logon de la sesión, es rechazado mediante un Reject.



3.10 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- Se ha añadido el campo de usuario opcional LocalMktTimestamp [21501] al mensaje Logon para indicar en qué formato se desean recibir las horas (formato UTC u hora oficial del mercado)
- Se han añadido los campos opcionales ApplID [1180] y ApplSeqNum [1181] al mensaje Logon para indicar que sólo se desean recibir las actualizaciones a partir del momento indicado
- Los campos Text [58] y DefaultCstmAppVerID [1408] del mensaje Logon han pasado a ser requeridos
- Cuando una petición de inicio de sesión (mensaje Logon) es rechazada, el receptor (MEFF) siempre enviará un mensaje Logout como contestación
- Los campos SenderSubID [50] y TargetSubID [57] en la cabecera de los mensajes (Standard Message Header) dejan de ser opcionales y pasan a ser requeridos
- No se soporta el método de encriptación de FIX
- Los mensajes ResendRequest y Sequence Reset no está soportados (y serán rechazados por HF MEFFGate en el caso de que los envíe la aplicación cliente)
- Los valores válidos del campo ResetSeqNumFlag del mensaje Logon quedan limitados al valor "N"
- Se ha añadido el campo de usuario BusinessSessionDate [21505] al mensaje Logon de respuesta enviado por HF MEFFGate para informar de la fecha de la sesión de Negocio actual.

3.11 Definición de mensajes

3.11.1 Standard Message Header

Cabecera que contienen todos los mensajes FIX.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------------|-----|---|---------|---|
| 8 | BeginString | S | FIXT.1.1 | String | Indica el inicio de un nuevo mensaje. Siempre es el primer campo del mensaje |
| 9 | BodyLength | S | | Int | Longitud del mensaje en bytes, desde la finalización de este campo hasta, e incluyendo, el delimitador previo al campo CheckSum. Siempre es el segundo campo del mensaje |
| 35 | MsgType | S | Todos los tipos de mensajes soportados por MEFF | String | Identifica el tipo de mensaje. Siempre es el tercer campo del mensaje |
| | | | | | Identificador de la entidad que envía el mensaje. |
| 49 | SenderCompID | S | Ver apartado Identificación de la sesión FIX | String | Contiene el operating MIC del entorno (ver tabla 2 documento "Codification tables") cuando el mensaje es enviado por HF MEFFGate. |
| | | | | | Debe contener el código del miembro en los mensajes enviados por la aplicación cliente |
| | | | | | Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje. |
| 56 | TargetCompID | S | Ver apartado Identificación de la sesión FIX | String | Debería contener el operating MIC del entorno (ver tabla 2 documento "Codification tables") cuando el mensaje es enviado a HF MEFFGate, aunque HF MEFFGate ignora el contenido de este campo. |
| | | | | | Contiene el código del miembro en los mensajes enviados por HF MEFFGate. |
| 34 | MsgSeqNum | S | | SeqNum | Número de secuencia del mensaje dentro de la sesión FIX actual |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|-------------|-----|--|---------------|--|
| 50 | SenderSubID | S* | Ver apartado Identificación de la sesión FIX | String | <p>En los mensajes enviados por HF MEFFGate contiene el código asignado al Grupo de contratos con el que se estableció la conexión (ver tabla 1 documento "Codification tables").</p> <p>En mensajes enviados a HF MEFFGate debe contener el código de operador con el que se inició la sesión FIX</p> |
| 57 | TargetSubID | S* | Ver apartado Identificación de la sesión FIX | String | <p>En los mensajes enviados por HF MEFFGate contiene el código de operador al que va destinado.</p> <p>En mensajes enviados a HF MEFFGate debe contener el código de Grupo de contratos con el que se estableció la conexión (ver tabla 1 documento "Codification tables")</p> |
| 52 | SendingTime | S | | UTC Timestamp | Hora de envío del mensaje |

3.11.2 Standard Message Trailer

Parte final de todos los mensajes FIX.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|----------|-----|-----------------|-----------|--|
| 10 | Checksum | S | | String(3) | Checksum del mensaje, calculado según lo descrito en el estándar. Siempre es el último campo del mensaje y su longitud es exactamente de 3 bytes |

3.11.3 Logon (Msg Type = A)

El mensaje Logon es usado para iniciar una sesión por el cliente y para aceptarla por el servidor.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-------|-----------------------|-----|----------------------------|---------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = A | | |
| 98 | EncryptMethod | S | 0 = None | Int | Ignorado por HF MEFFGate |
| 108 | HeartBtInt | S | >=1 | Int | Intervalo de envío de mensajes de verificación de conexión (mensaje Heartbeat) expresado en segundos. |
| 141 | ResetSeqNumFlag | N | N | Boolean | Sólo permite el valor "N", ya que en la implementación del protocolo no es necesario |
| 789 | NextExpectedMsgSeqNum | N | | SeqNum | Si se informa sólo se admite el valor 1 |
| 464 | TestMessageIndicator | N | Y = Test N = Producción | Boolean | Indica cuando se trata de una sesión de pruebas o de producción. El cliente puede usarlo opcionalmente para indicar si desea conectarse a producción o a pruebas. El inicio de sesión se acepta si HF MEFFGate atiende ese entorno. Si el cliente no indica nada, no se tiene en cuenta este parámetro y HF MEFFGate siempre informa este campo |
| 553 | Username | N | | String | Identificador de usuario asignado por MEFF. Requerido cuando el mensaje es enviado por la aplicación cliente. Está formado por la combinación de código de miembro y de operador asignados por MEFF |
| 554 | Password | N | 9 | String | Password asignado por el usuario. Requerido cuando el mensaje es enviado por la aplicación cliente |
| 1137 | DefaultApplVerID | S | | String | El valor 9 corresponde a FIX50SP2 |
| 1408 | DefaultCstmApplVerID | S* | M5.15 | String | Identificación exacta de la versión del protocolo usado y esperado por el cliente |
| 58 | Text | S* | | String | El cliente debe incluir la denominación del software usado para la conexión FIX, que corresponderá a una que haya pasado el correspondiente conformance test |
| 1180* | ApplID | N | | String | Si se informa significa que sólo se desean recibir las actualizaciones a partir del momento indicado. |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--------|---------------------|-----|-------------------|--------------|---|
| | | | | | Este valor, usado conjuntamente con ApplSeqNum [1181], debe corresponderse en el mismo campo con alguno de los mensajes suministrados por HF MEFFGate tales como: Market Data Snapshot Full Refresh, Security List, Security List Update Report, Security Status, ... |
| | | | | | Requerido si se especifica ApplID [1180] |
| 1181* | ApplSeqNum | N | | SeqNum | Este valor, usado conjuntamente con ApplID [1180], debe corresponderse en el mismo campo con alguno de los mensajes suministrados por HF MEFFGate tales como: Market Data Snapshot Full Refresh, Security List, Security List Update Report, Security Status, ... |
| 21501* | LocalMktTimestamp | N | Y, N (default) | String | Indica en qué formato se desea recibir las horas: Y - Se divulga la hora oficial del mercado (con una resolución máxima de microsegundos) N - Se divulga la hora en formato UTC, de acuerdo con el estándar FIX (con una resolución máxima de microsegundos) |
| | | | | | Para más información ver 4.5 Fecha de la sesión de Negocio actual. |
| 21505* | BusinessSessionDate | N | | LocalMktDate | Este campo sólo se informa en la respuesta enviada por HF MEFFGate. La aplicación cliente no debe enviar este tag en el mensaje Logon que envía a HF MEFFGate. |
| | Standard Trailer | S | | | |

3.11.4 Logout (Msg Type = 5)

El mensaje Logout es usado por ambas partes tanto para solicitar o notificar la finalización de la sesión de comunicación como para aceptar dicha solicitud.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|------------------|-----|-----------------|---------|-------------------|
| | Standard Header | S | MsgType = 5 | | |
| 58 | Text | N | | String | Texto explicativo |
| | Standard Trailer | S | | | |

3.11.5 Heartbeat (Msg Type = 0)

El mensaje Heartbeat es usado por ambas partes para indicar que la conexión se mantiene activa.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|------------------|-----|-----------------|---------|--|
| | Standard Header | S | MsgType = 0 | | |
| 112 | TestReqID | N | | String | Si el mensaje es la respuesta a un mensaje Test Request, debe contener el mismo valor que contenía el campo TestReqID original. En cualquier otro caso, este campo debe omitirse. |
| | Standard Trailer | S | | | |

3.11.6 Test Request (Msg Type = 1)

El mensaje Test Request es usado por ambas partes para solicitar el envío de un mensaje Heartbeat.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|------------------|-----|-----------------|---------|--|
| | Standard Header | S | MsgType = 1 | | |
| 112 | TestReqID | S | | String | Identificador de la petición. Debe ser incluido en el mensaje Heartbeat de respuesta |
| | Standard Trailer | S | | | |

3.11.7 Reject (Msg Type = 3)

El mensaje Reject es usado por HF MEFFGate para rechazar un mensaje que no cumpla el protocolo FIX especificado por MEFF.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|---------------------|-----|---|---------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = 3 | | |
| 45 | RefSeqNum | S | | SeqNum | Número de secuencia del mensaje rechazado |
| | | | 0 = Invalid tag number 1 = Required tag missing 2 = Tag not defined for this message type 3= Undefined Tag 4 = Tag specified without a value 5 = Value is incorrect (out of range) for this tag 6 = Incorrect data format for value 9 = CompID problem 11 = Invalid MsgType 13 = Tag appears more than once 14 = Tag specified out of required order 15 = Repeating group fields out of order 16 = Incorrect NumInGroup count for repeating group 17 = Non "data" value includes field delimiter | | |
| 373 | SessionRejectReason | N | | Int | Código que indica el motivo de rechazo |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|------------------|-----|-------------------------------|---------|--|
| | | | (SOH character) 99 = Other | | |
| 58 | Text | N | | String | Contiene una descripción más específica de la razón de rechazo |
| | Standard Trailer | S | | | |

4 Convenciones generales en los mensajes de aplicación

4.1 Bloque Instrument

En algunas peticiones, el cliente FIX puede especificar criterios de selección de contratos. En estos casos, sólo se devuelve la información relacionada con los contratos que cumplen estos criterios. Los posibles criterios de selección se corresponden con campos del bloque Instrument.

En la siguiente tabla se indican cuáles son los campos aceptados por MEFF y el tipo de petición en que pueden intervenir.

| Campo | Significado |
|-------------------------|-------------------------------------|
| SecurityType [167] | Tipo de producto |
| SecurityID [48] | Activo Subyacente del contrato MEFF |
| MaturityMonthYear [200] | Vencimiento del contrato |

En los siguientes subapartados se explica detalladamente el uso de estos campos.

4.1.1 SecurityType [167]

Este código identifica el tipo de producto (véase tabla 6 en documento "Codification tables"). Sólo en mensajes enviados por HF MEFFGate. No se permite en mensajes enviados por el cliente FIX.

4.1.2 Activo subyacente (campo SecurityID [48])

Este código identifica el activo subyacente de un contrato (véase Tabla 7 en documento "Codification tables").

4.1.3 Vencimiento (campo MaturityMonthYear [200])

Para los contratos con vencimientos estándar, indica el mes y año de vencimiento de un contrato. En este caso, el formato para este campo es YYYYMM (p.ej. 201312).

Para los contratos con vencimientos no estándar, indica la fecha de vencimiento de un contrato. En este caso, el formato para este campo es YYYYMMDD (p.ej. 20131219).

Para contratos con vencimiento semanal estándar, el formato posible de este campo es YYYYMMwW (p.ej. 201312w2)

4.1.4 Combinación de criterios de selección

Cuando se combinan varios criterios de selección, sólo se consideran seleccionados los contratos que cumplen todos los requerimientos. Cuando no se especifica un campo de selección se entiende que no se desea usar este criterio y ningún contrato es descartado por el mismo.

En la siguiente tabla se presentan algunos ejemplos de selección:

| SecurityType [167] | SecurityID [48] | MaturityMonthYear [200] | Significado |
|--------------------|-----------------|-------------------------|---|
| F | FIE | (omitido) | Todos los futuros sobre el índice IBEX |
| F | BBVA | (omitido) | Todos los futuros sobre BBVA con entrega física |
| (omitido) | FIE | 201203 | Todos los contratos con el índice IBEX como subyacente, con vencimiento marzo de 2012 |

| | | | |
|-----------|--------------|--------------|---|
| O | (omitido) | 201206 | Todas las opciones con vencimiento junio de 2012 |
| R | TEF | (omitido) | Todos los contratos time-spread que tienen a Telefónica como subyacente |
| (omitido) | (omitido) | (omitido) | Todos los contratos |
| X | (cualquiera) | (cualquiera) | <u>Selección errónea</u> |

4.2 Limitación en el máximo número de suscripciones vivas permitidas

Sólo se permite una suscripción viva por cada tipo de suscripción durante la sesión, excepto para Market Data. En el caso de Market Data el número máximo de suscripciones permitidas es 5.

Si, una vez alcanzado este límite, la aplicación cliente intenta establecer nuevas suscripciones será rechazada con un mensaje de error indicando que se han alcanzado el máximo número de suscripciones permitidas.

4.3 Recepción de la información pública a partir de un determinado punto de la sesión

Mediante esta funcionalidad se permite indicar que se quieren recibir las actualizaciones a partir de un punto determinado de la sesión que la aplicación cliente indique. Para ello se utilizan los campos ApplID [1180] y ApplSeqNum [1181] en el mensaje Logon. Si no se indican estos campos se presupone el comportamiento clásico (snapshot de la situación actual y updates a partir de este momento para el Market Data Snapshot Full Refresh, actualización desde el primer mensaje para Trading Session Status, Security List y Security Status).

Si se indica el valor 0 en ApplSeqNum [1181] significa que se desea la actualización desde el primer mensaje de la sesión.

4.4 Campos no informados en recepción de información

Cuando HF MEFFGate no informe del valor de un campo no obligatorio, la aplicación cliente deberá considerar que esta información no ha variado desde la última actualización recibida durante la sesión.

Ello se aplica, por ejemplo, a los mensajes Market Data Snapshot Full Refresh y Security Status.

Para ver mejor el funcionamiento vamos a considerar dos ejemplos:

Ejemplo 1: Suscripción al Market Data.

- **Un contrato presenta la siguiente situación inicial en bid y offer:**

| Bid | Offer |
|----------|-----------|
| | 10 @ 9015 |
| 2 @ 9014 | |
| 6 @ 9012 | |

Se divulga el siguiente mensaje Market Data Snapshot Full Refresh:

...

NoMDEntries [268] = 3

MDEntryType [269] = 0 (Bid)

MDEntryPx [270] = 9014

MDEntrySize [271] = 2, ...
 MDEntryType [269] = 0 (Bid)
 MDEntryPx [270] = 9012
 MDEntrySize [271] = 6, ...
 MDEntryType [269] = 1 (Offer)
 MDEntryPx [270] = 9015
 MDEntrySize [271] = 10, ...
 ...

- **Se produce un cambio en el lado del bid (desaparece el precio 9012):**

| Bid | Offer |
|----------|-----------|
| | 10 @ 9015 |
| 2 @ 9014 | |

HF MEFFGate comunica este update **sin informar necesariamente** del lado offer:

...
 NoMDEntries [268] = **1**
 MDEntryType [269] = 0 (Bid)
 MDEntryPx [270] = 9014
 MDEntrySize [271] = 2, ...
 ...

- **Se produce otro cambio en el lado del bid (desaparece el último precio 9014):**

| Bid | Offer |
|-----|-----------|
| - | 10 @ 9015 |

HF MEFFGate comunica este update **sin informar necesariamente** del lado offer:

...
 NoMDEntries [268] = **1**
 MDEntryType [269] = 0 (Bid)
 MDEntryPx [270] = ...
 MDEntrySize [271] = 0, ...
 ...

Ejemplo 2: Suscripción al Security Status.

- **Un contrato, negociable, con un determinado rango de precios, se divulga con el siguiente mensaje Security Status:**

...

SecurityTradingStatus [326] = 17 (Ready to trade)

HighPx [332] = 9075

LowPx [333] = 8975

...

- **Este contrato pasa a subasta:**

HF MEFFGate comunica este update **sin informar necesariamente** del rango de precios (HighPx, LowPx):

...

SecurityTradingStatus [326] = 21 (Pre-Open)

...

4.5 Formato en que se desea recibir las horas

El Sistema permite que, para todos los campos donde figure la hora, el usuario decida si la desea en formato UTC (de acuerdo con el estándar FIX), o la hora oficial del mercado.

Para ello se utiliza el campo de usuario LocalMktTimestamp [21501] en el mensaje Logon.

Cuando se utilice este campo, con valor LocalMktTimestamp [21501] = "Y", HF MEFFGate divulgará la hora oficial del mercado (con una resolución máxima de microsegundos).

Si no se utiliza este campo (o LocalMktTimestamp [21501] = "N"), HF MEFFGate divulgará la hora en formato UTC (con una resolución máxima de microsegundos).

4.6 Tipo de dato SeqNum

Tal como especifica el estándar FIX, el tipo de dato SeqNum representa un campo int con valores positivos. La aplicación cliente debe estar preparada para recibir valores superiores a 2³¹.

4.7 Correspondencia MMT-FIX

Level 1 - Market Mechanism

| MARKET MODEL TIPOLOGY | | FIX (mensaje Market Data Snapshot Full Refresh) |
|---|-----------------------|---|
| Full Name | Code (Efficient Mode) | MdOriginType [1024] |
| Central Limit Order Book | 1 | 0 |
| Quote Driven Market | 2 | 3 |
| Dark Order Book | 3 | 4 |
| Off Book (including Voice or Messaging Trading) | 4 | 1 |
| Periodic Auction | 5 | 5 |
| Request for quotes | 6 | 6 |

Level 2 - Trading Mode

MARKET MODEL TIPOLOGY

FIX (mensaje Trading Session Status)

| Full Name | Code (Efficient Mode) | TradingSessionSubId [625] |
|-------------------------------|-----------------------|---------------------------|
| Undefined Auction | 1 | 8 |
| Scheduled Opening Auction | O | 2 |
| Scheduled Closing Auction | K | 4 |
| Scheduled Intraday Auction | I | 6 |
| Unscheduled Auction | U | 9 |
| Continuous Trading | 2 | 3 |
| At Market Close Trading | 3 | 5 |
| Out of Main Session Trading | 4 | 10 |
| Trade Reporting (On Exchange) | 5 | 201 |
| Trade Reporting (On Exchange) | 5 | 203 |
| Trade Reporting (On Exchange) | 5 | 204 |

Level 3.1 - Transaction category

MARKET MODEL TIPOLOGY

FIX (mensaje Market Data Snapshot Full Refresh)

| Full Name | Code (Efficient Mode) | EventText [868] con EventType [865] = 211 |
|---|-----------------------|---|
| Package Trade (excluding Exchange for Physicals) "TPAC" | Z | Z |
| Exchange for Physicals Trade "XFPH" | Y | Y |

Level 3.5 - Benchmark or Reference Price Indicator

MARKET MODEL TIPOLOGY

FIX (mensaje Market Data Snapshot Full Refresh)

| Full Name | Code (Efficient Mode) | TradeCondition [277] | TrdRegPublicationType [2669] | TrdRegPublicationReason [2670] |
|------------------------|-----------------------|----------------------|------------------------------|--------------------------------|
| Benchmark Trade "BENC" | B | 6 | - | - |

Level 3.8 - Ordinary/Standard Trades or Trades Outside Price Formation / Discovery Process

MARKET MODEL TIPOLOGY

FIX (mensaje Market Data Snapshot Full Refresh)

| Full Name | Code (Efficient Mode) | TradePriceCondition [1839] |
|--|-----------------------|----------------------------|
| Plain-Vanilla Trade | P | - |
| Non-Price Forming Trade (formerly defined as a Technical Trade) "NPFT" | T | 15 |

Level 3.9 - Algorithmic Indicator

MARKET MODEL TIPOLOGY

FIX (mensaje Market Data Snapshot Full Refresh)

| Full Name | Code (Efficient Mode) | AlgorithmicTradeIndicator [2667] |
|--------------------------|-----------------------|----------------------------------|
| Algorithmic trade "ALGO" | H | 1 |
| No Algorithmic trade | - | 0 |

Level 4.1 - Publication Mode / Post-Trade Deferral Reason

MARKET MODEL TIPOLOGY

FIX (mensaje Market Data Snapshot Full Refresh)

| Full Name | Code (Efficient Mode) | TradePublishIndicator [1390] | TrdRegPublicationType [2669] | TrdRegPublicationReason [2670] |
|---|-----------------------|------------------------------|------------------------------|--------------------------------|
| Immediate Publication | - | 1 | - | - |
| Non-Immediate Publication | 1 | 2 | - | - |
| Non-Immediate Publication: Deferral for "Large in Scale" "LRGS" | 2 | 2 | 1 | 6 |
| Non-Immediate Publication: Deferral for "Illiquid Instrument" (RTS 2 only) "ILQD" | 3 | 2 | 1 | 7 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| Non-Immediate Publication: Deferral for "Size Specific" (RTS 2 only) "SIZE" | 4 | 2 | 1 | 8 |
|---|---|---|---|---|

Level 4.2 - Post-Trade deferral or Enrichment

MARKET MODEL TIPOLOGY

FIX (mensaje Market Data Snapshot Full Refresh)

| Full Name | Code (Efficient Mode) | RegulatoryReportType [1934] |
|---|-----------------------|-----------------------------|
| Limited details trade "LMTF" | 1 | 11 |
| Daily aggregated trade "DATF" | 2 | 12 |
| Volume omission trade "VOLO" | 3 | 13 |
| Four weeks aggregation trade "FWAF" | 4 | 14 |
| Indefinite aggregation trade "IDAF" | 5 | 15 |
| Volume omission trade. Eligible for subsequent enrichment in aggregated form "VOLW" | 6 | 16 |
| Full details of previous LMTF "FULF" | 7 | 17 |
| Full details of previous DATF "FULA" | 8 | 18 |
| Full details of previous VOLO "FULV" | 9 | 19 |
| Full details of previous FWAF "FULJ" | V | 20 |
| Full details of previous VOLW "COAJ" | W | 21 |

5 Mensajes Genéricos del Nivel de Aplicación

5.1 Introducción

En este capítulo se presentan algunos mensajes del nivel de aplicación destinados a cubrir tres funcionalidades: el control del estado de la comunicación, el cambio de password de conexión al HF MEFFGate y el rechazo de mensajes por parte de HF MEFFGate.

5.2 Estado de la comunicación

HF MEFFGate incluye un mecanismo para informar a la aplicación cliente sobre el estado de la comunicación entre el propio HF MEFFGate y los sistemas centrales. Esta funcionalidad se implementa mediante los mensajes Network Status de FIX.

HF MEFFGate siempre enviará mensajes Network Counterparty System Response informando de los cambios de estado entre HF MEFFGate y los sistemas centrales (se haya o no suscrito el cliente a los mismos).

La información suministrada con estos mensajes sólo refiere a la conexión entre los equipos y no debe confundirse con el estado de la sesión de negociación, que es tratado en 6.2 .

5.3 Cambio de password de conexión al HF MEFFGate

Mediante esta funcionalidad se permite que la aplicación cliente cambie su password de conexión al HF MEFFGate.

La nueva password es válida para todas las futuras sesiones que se establezcan.

5.4 Rechazo de mensajes de aplicación

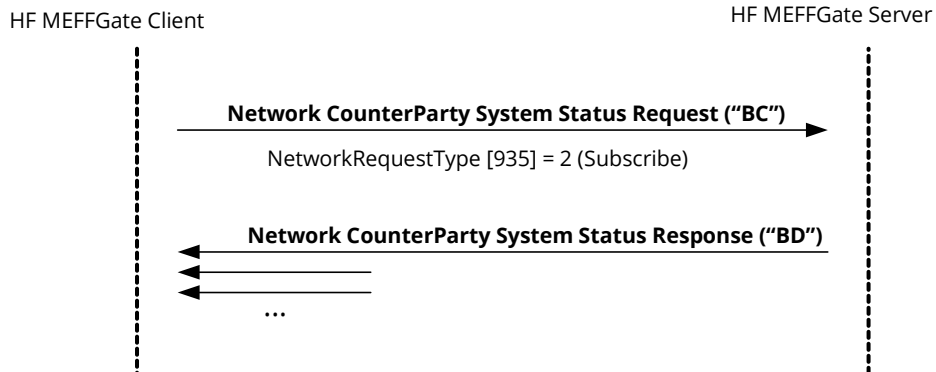
Cuando HF MEFFGate recibe un mensaje soportado y sintácticamente correcto, en una situación no soportada, y no existe un mensaje específico de rechazo, se usa el mensaje genérico Business Message Reject. En particular es usado para el rechazo del mensaje Network Counterparty System Status Request.

5.5 Lista de mensajes

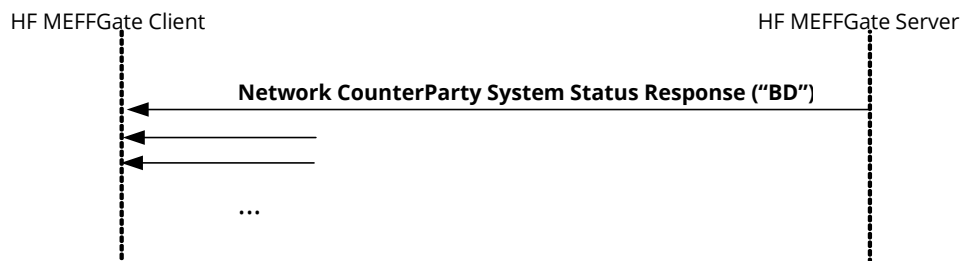
| Mensaje | Descripción |
|---|---|
| Network Counterparty System Status Request (Msg Type = BC) | Solicitud del estado de conexión entre HF MEFFGate y los sistemas centrales |
| Network Counterparty System Status Response (Msg Type = BD) | Informe del estado de conexión entre HF MEFFGate y los sistemas centrales |
| User Request (Msg Type = BE) | Solicitud de cambio de la password de conexión entre la aplicación cliente y HF MEFFGate |
| User Response (Msg Type = BF) | Informe del estado de la solicitud de cambio de password |
| Business Message Reject (MsgType = j) | Rechazo de mensaje a nivel de aplicación (usado en caso de que no exista un mensaje específico) |

5.6 Flujo de mensajes

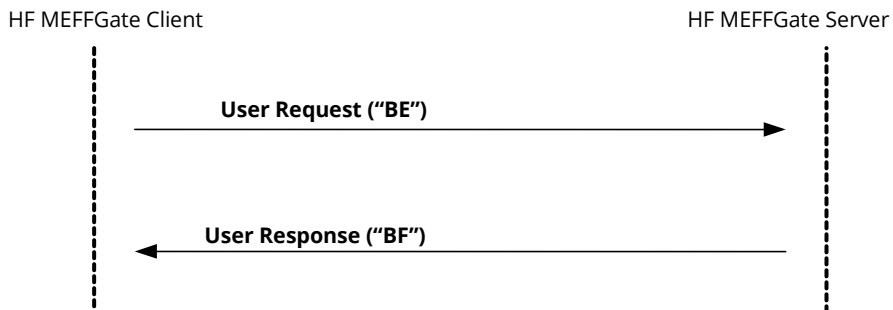
Suscripción al estado de la conexión



Envío de mensajes Network Counterparty System Response informando de los cambios de estado sin que el cliente se haya suscrito a los mismos



Cambio de password de conexión al HF MEFFGate



5.7 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

En el mensaje User Request, los campos Password [554] y NewPassword [925] fields han pasado a ser requeridos

5.8 Definición de mensajes

5.8.1 Network Counterparty System Status Request (Msg Type = BC)

Mensaje enviado por la aplicación cliente para solicitar información sobre el estado de conexión entre HF MEFFGate y los sistemas centrales de MEFF.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------------------|-----|-----------------|------------|---------------------------|
| | Standard Header | S | MsgType = BC | | |
| 935 | NetworkRequestType | S | 2 = Subscribe | Int | |
| 933 | NetworkRequestID | S | | String(10) | Identificador del mensaje |
| | Standard Trailer | S | | | |

5.8.2 Network Counterparty System Status Response (Msg Type = BD)

Mensaje enviado por HF MEFFGate como respuesta a un mensaje Network Counterparty System Status Request Message.

Contiene información acerca del estado de la conexión de HF MEFFGate con los sistemas centrales de MEFF.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------|-----------------------|-----|---|------------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = BD | | |
| 937 | NetworkStatusResponse | S | 1 = Full | Int | |
| 933 | NetworkRequestID | N | | String | Identificador del mensaje Network Counterparty System Status Request al que se está respondiendo |
| 932 | NetworkResponseID | S | | String | Identificador único del mensaje |
| 936 | NoCompIDs | S | 1 | NumInGroup | |
| → 930 | RefCompID | N | | String | Contiene el mismo valor que el campo SenderCompID de la cabecera (véase 3.3) Este campo siempre está presente en el mensaje |
| → 931 | RefSubID | N | Ver apartado Identificación de la sesión FIX | String | Contiene el mismo valor que el campo SenderSubID de la cabecera (véase 3.3) Este campo siempre está presente en el mensaje |
| → 928 | StatusValue | N | 1 = Connected 2 = Not connected - down expected up 3 = Not connected - down expected down 4 = In Process | Int | Estado de la conexión Este campo siempre está presente en el mensaje |
| → 929 | StatusText | N | | String | Información adicional |
| | Standard Trailer | S | | | |

5.8.3 Business Message Reject (MsgType = j)

Mensaje enviado por HF MEFFGate cuando recibe un mensaje soportado y sintácticamente correcto en una situación no soportada, para la que no existe un mensaje de rechazo específico. En particular es usado para el rechazo del mensaje Network Counterparty System Status Request

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|----------------------|-----|---|---------|--|
| | Standard Header | S | MsgType = j | | |
| 45 | RefSeqNum | N | | SeqNum | Cuando esté presente, indica MsgSeqNum del mensaje rechazado. Si valor cero, no tener en cuenta este campo. |
| 372 | RefMsgType | S | | String | MsgType del mensaje rechazado |
| 379 | BusinessRejectRefID | N | | String | Identificador opcional del mensaje rechazado |
| 380 | BusinessRejectReason | S | 0 = Other 3 = Unsupported Message Type | Int | Motivo de rechazo. |
| 58 | Text | N | | String | Texto explicativo |
| | Standard Trailer | S | | | |

5.8.4 User Request (Msg Type = BE)

Mensaje enviado por el cliente para modificar su password de conexión al HF MEFFGate

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|------------------|-----|------------------------------|-------------|--|
| | Standard Header | S | MsgType = BE | | |
| 923 | UserRequestID | S | | String (10) | Identificador único para cada mensaje User Request |
| 924 | UserRequestType | S | 3 = Change Password For User | Int | |
| 553 | Username | S | | String | Identificador de usuario asignado por MEFF. Actualmente está formado por la combinación de código de miembro y de operador |
| 554 | Password | S* | | String (10) | Password anterior |
| 925 | NewPassword | S* | | String (10) | Nueva Password |
| | Standard Trailer | S | | | |

5.8.5 User Response (Msg Type = BF)

Mensaje usado por HF MEFFGate para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje User Request.

Este mensaje sólo es enviado al operador que realizó la solicitud relacionada.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|------------------|-----|--|---------|--|
| | Standard Header | S | MsgType = BF | | |
| 923 | UserRequestID | S | | String | Identificador asignado por el cliente en el mensaje User Request |
| 553 | Username | S | | String | Identificador de usuario |
| 926 | UserStatus | N | 5 – Password Changed 6 – Other | Int | Estado de la petición del mensaje User Request. En caso de rechazo (valor 6), el campo UserStatusText contiene un texto explicativo |
| 927 | UserStatusText | N | | String | Cuando UserStatus = 6, contiene una descripción específica del motivo de rechazo |
| | Standard Trailer | S | | | |

6 Información de Mercado

6.1 Introducción

Bajo el concepto de información de mercado se agrupan varias funcionalidades relacionadas con la información pública de mercado. Esta información se clasifica en tres grupos:

- **Estado de la sesión.** Estado de la sesión de negociación
- **Información de contratos.** Definición y estado de los contratos seleccionados
- **Precios.** Precios de los contratos seleccionados

Cada uno de estos grupos es tratado en un apartado independiente de este capítulo. En el apartado 6.5 se detalla el formato de los mensajes correspondientes.

6.2 Información de mercado: Estado de la sesión

6.2.1 Descripción

Esta funcionalidad permite al cliente obtener el estado del grupo de contratos asociado a la sesión FIX actual, así como ser notificado de los cambios de estado que se produzcan.

6.2.2 Lista de mensajes

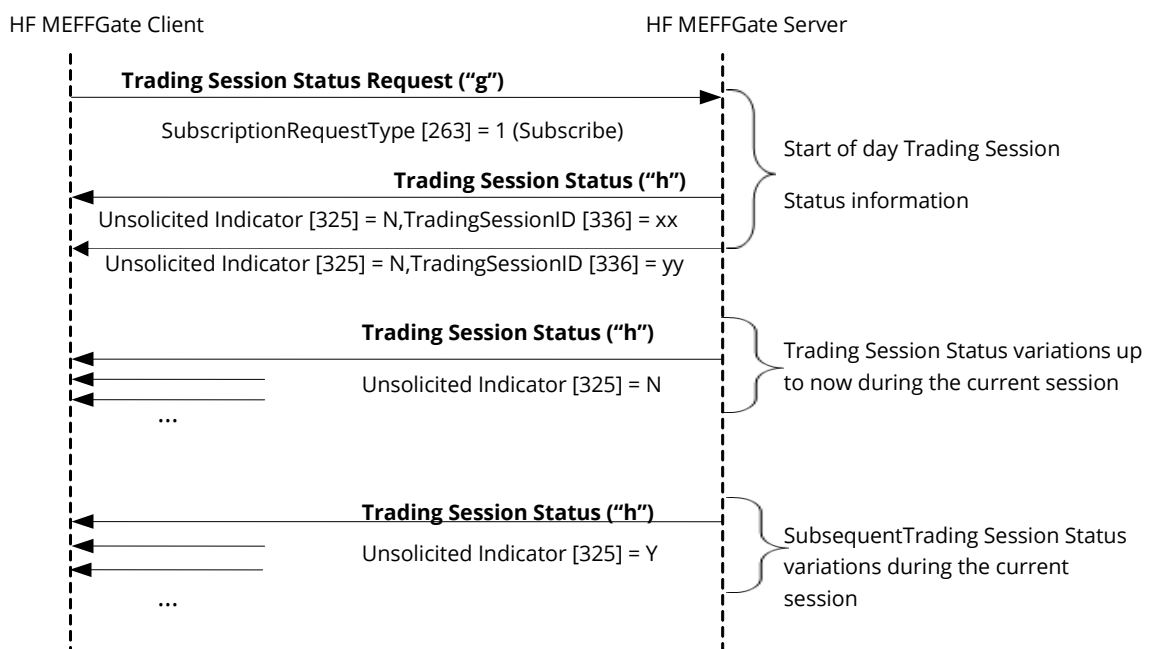
| Mensaje | Descripción |
|---|---|
| Trading Session Status Request (Msg Type = g) | Enviado por el cliente para solicitar el estado del grupo de contratos |
| Trading Session Status (Msg Type = h) | Enviado por el servidor para devolver información del estado del grupo de contratos o para notificar que la solicitud ha sido rechazada |

6.2.3 Flujo de mensajes

Solicitud del estado de la sesión de negociación

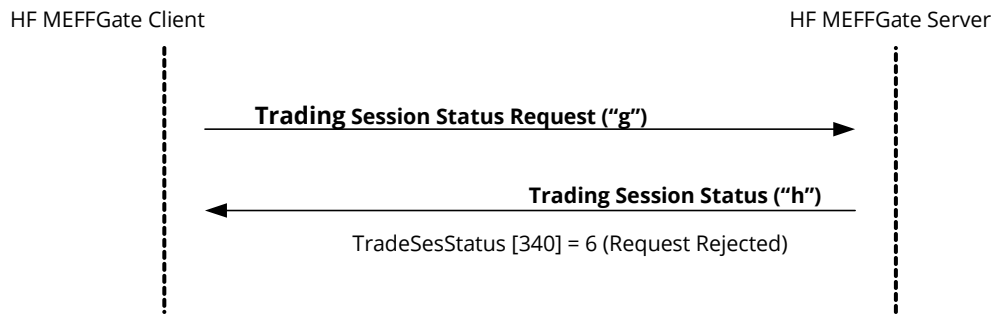
Esta solicitud es contestada inicialmente, para cada modalidad de contratación en el correspondiente grupo de contratos que cumple los criterios de selección, con uno o varios mensajes Trading Session Status que indican las distintas situaciones que ha ido pasando hasta este momento.

A partir de este punto, cuando se produce un cambio de estado, se recibe un nuevo mensaje Trading Session Status con la información correspondiente. Estos últimos mensajes contienen el valor "Y" en el campo UnsolicitedIndicator.



Solicitud del estado de la sesión de negociación fallida

Una solicitud del estado de la sesión de negociación fallida es contestada con un mensaje Trading Session Status con el campo TradeSesStatus = 6.



6.2.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- Se ha añadido el campo TransactTime [60] al mensaje Trading Session Status
- Se ha añadido el campo opcional MoreSubscriptionsFollowing [21500] al mensaje Trading Session Status Request para agrupar las peticiones de suscripción relativas a información de mercado

6.3 Información de mercado: Contratos

6.3.1 Descripción

Esta funcionalidad permite obtener la información de los contratos del grupo de contratos. Los datos se agrupan en dos conjuntos:

- **Definición de contratos.** Información estática de definición de los contratos como snapshot en el momento que se solicita (Security List) y de los cambios que se producen en los mismos durante la sesión (Security List Update Report).
- **Estado de contratos.** Información dinámica que refleja el estado de los contratos (Security Status)

6.3.2 Solicitud de información de contratos

Para la selección de los contratos sobre los que se quiere solicitar la información, se seguirán los criterios especificados en el apartado [Bloque Instrument](#) de este documento.

6.3.3 Recepción de la definición de contratos

La información de definición de contratos se recibe mediante los mensajes Security List y Security List Update Report. Téngase en cuenta que, de acuerdo con el estándar FIX, el mensaje Security List Update Report se envía de forma automática (como resultado de una suscripción, mediante un mensaje Security List Request o un Security Status Request), si se produce un cambio, durante la sesión, en la definición de un contrato, por lo que la aplicación cliente deberá estar adecuadamente preparada para la recepción del mismo.

Por ejemplo, es posible recibir un mensaje Security List Update Report informando de nuevas series de strikes sobre un contrato de opción.

Estos mensajes informan de un contrato cada vez. El campo TotNoRelatedSym informa del total de contratos que cumplen los criterios de selección y el campo NoRelatedSym (siempre 1) informa del número de contratos contenidos en el mensaje en cuestión.

6.3.4 Recepción del estado de contratos

La información del estado de contratos se recibe mediante el mensaje Security Status. Cada mensaje Security Status contendrá información de un contrato. La respuesta a un mensaje Security Status Request a su vez puede estar formada por varios mensajes Security Status. En este caso, no existe ningún mecanismo para saber cuándo se ha recibido toda la información. Si es necesario, el cliente FIX debe solicitar primero la lista de contratos mediante un mensaje Security List Request, para determinar el número de contratos que cumplen un cierto criterio.

Si no se recibe información para un determinado campo, se deberá considerar que éste no ha variado desde la última actualización (ver capítulo 4.4 para más detalle).

En el momento en que se produce un cambio en el estado de un contrato se recibe un nuevo mensaje Security Status con la nueva información.

En el momento en que se produce un cambio en la definición de un contrato se recibe un nuevo mensaje Security List Update Report con la nueva información.

6.3.5 Lista de mensajes

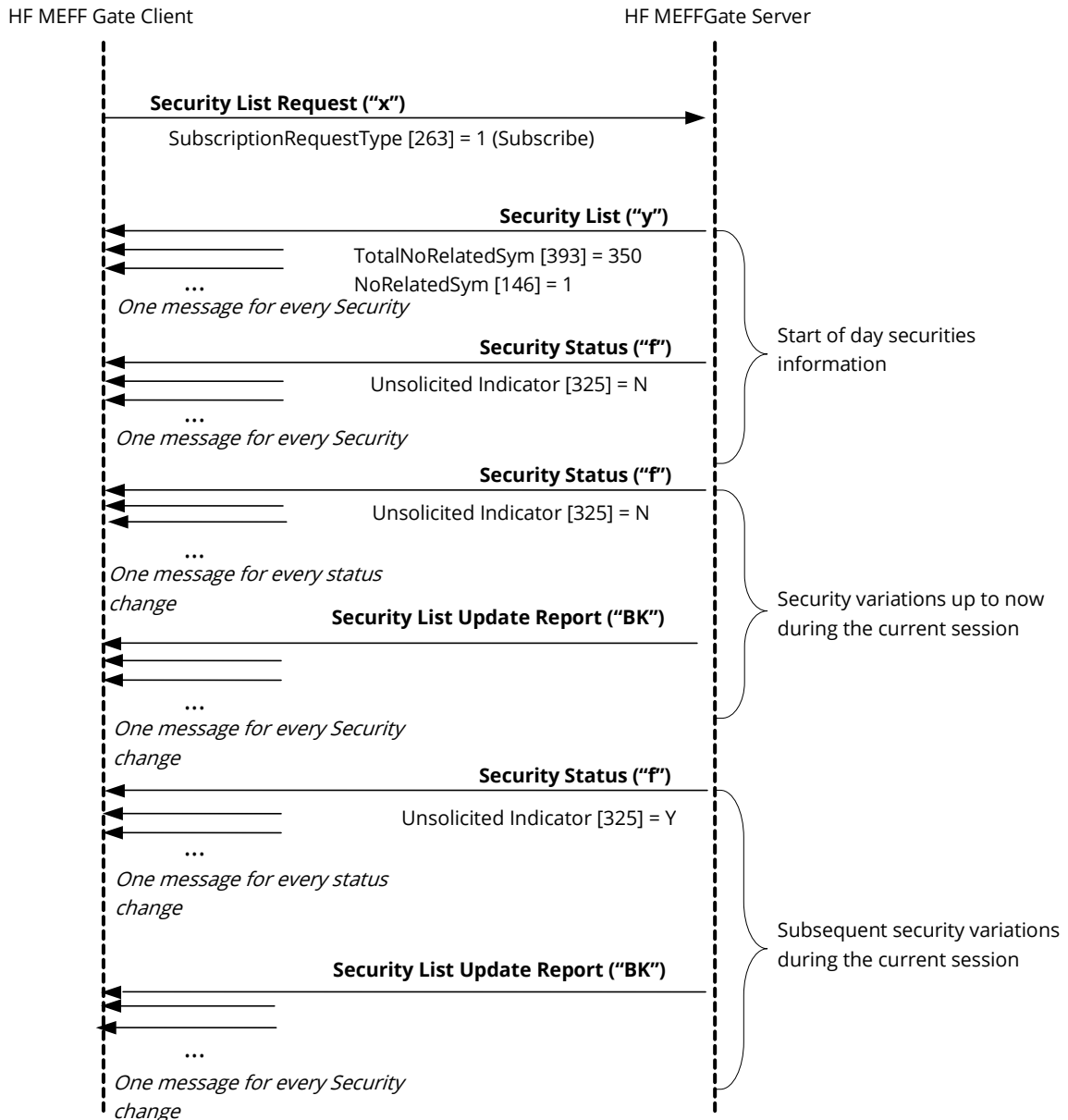
| Mensaje | Descripción |
|---|---|
| Security List Request (Msg Type = x) | Enviado por el cliente para solicitar la definición de contratos. También permite solicitar la información del estado de los mismos |
| Security List (Msg Type = y) | Enviado por el servidor para informar de la definición de contratos como snapshot. También es usado para informar el rechazo de la solicitud de dicha información |
| Security List Update Report (Msg Type = BK) | Enviado por el servidor para informar de los cambios producidos durante la sesión en la definición de contratos |
| Security Status Request (MsgType = e) | Enviado por el cliente para solicitar el estado de contratos |
| Security Status (MsgType = f) | Enviado por el servidor para informar del estado de contratos. También es usado para informar del rechazo de la solicitud de dicha información, o que no existe ningún contrato que cumpla los criterios de selección |

6.3.6 Flujo de mensajes

Suscripción a definición de contratos y estado de los contratos

Esta solicitud es contestada inicialmente, para cada contrato que cumple los criterios de selección, con mensajes Security List, Security Status y Security List Update Report que indican las distintas situaciones que ha ido pasando el contrato hasta este momento.

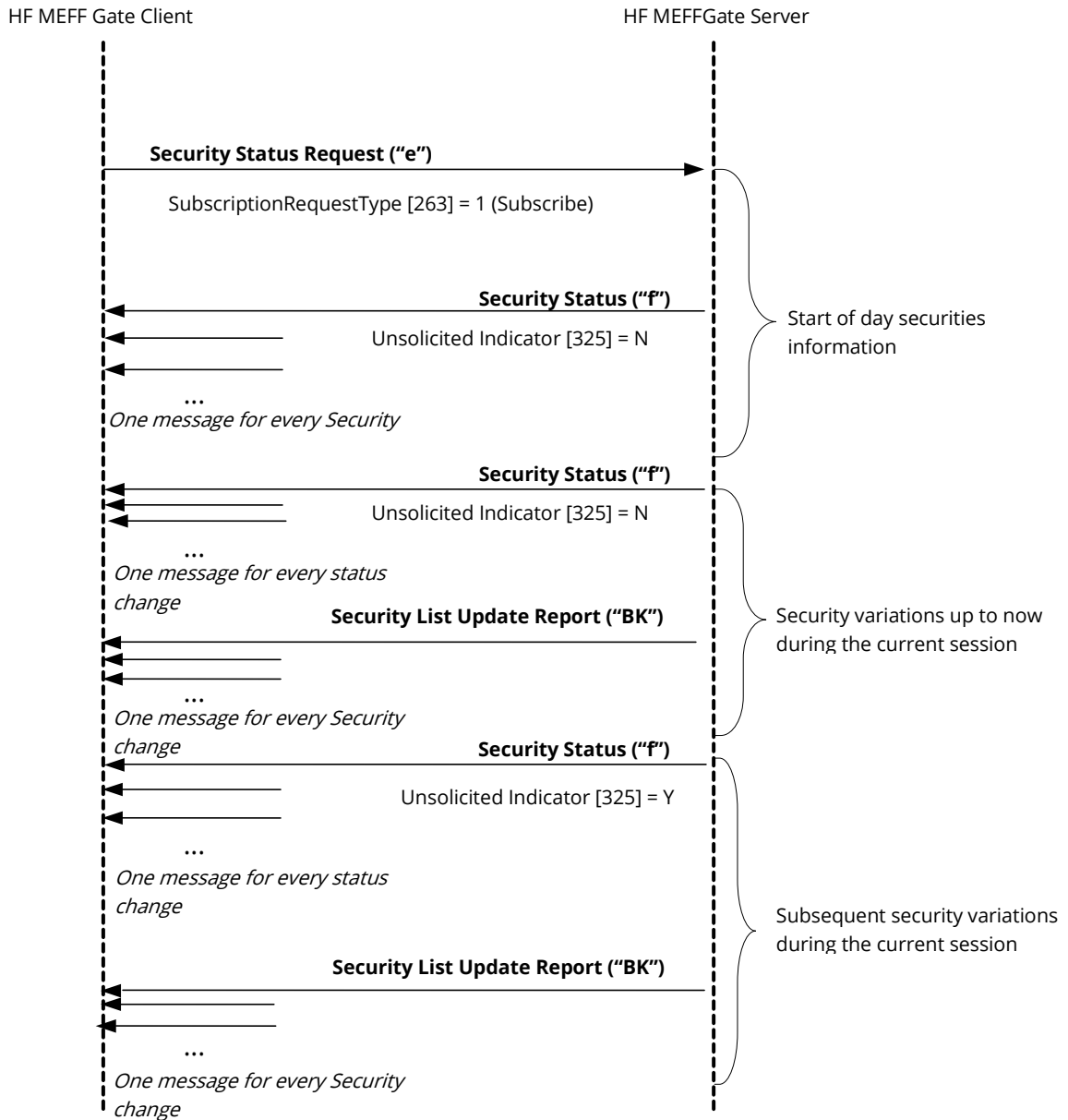
A partir de este momento se recibe, además, un nuevo mensaje Security List Update Report o Security Status cada vez que se produce un cambio en la definición de los contratos o del estado de los mismos.



Solicitud de estado de contratos

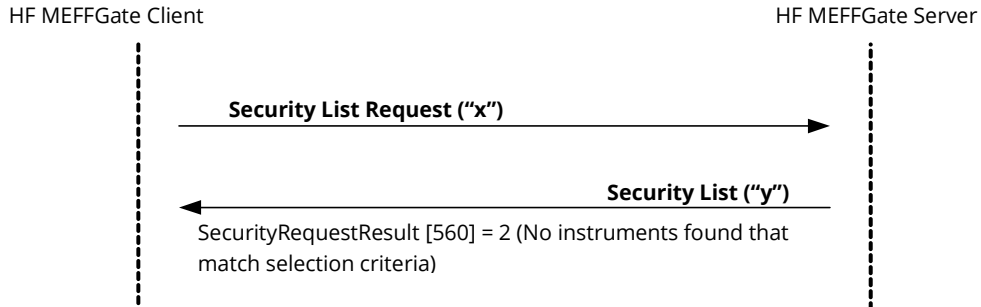
Esta solicitud es contestada inicialmente, para cada contrato que cumple los criterios de selección, con mensajes Security Status y Security List Update Report que indican las distintas situaciones que ha ido pasando el contrato hasta este momento.

A partir de este momento se recibe, además, un nuevo mensaje Security List Update Report o Security Status cada vez que se produce un cambio en la definición de los contratos o del estado de los mismos.



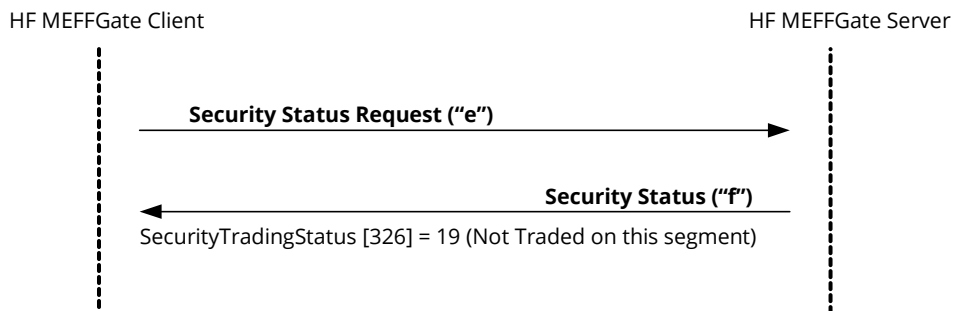
Solicitud de definición de contratos, sin contratos que cumplan los criterios de selección

Cuando no existen contratos que cumplan los criterios de selección indicados en una solicitud de definición de contratos, HF MEFFGate contesta con un mensaje Security List con el campo SecurityRequestResult = 2.



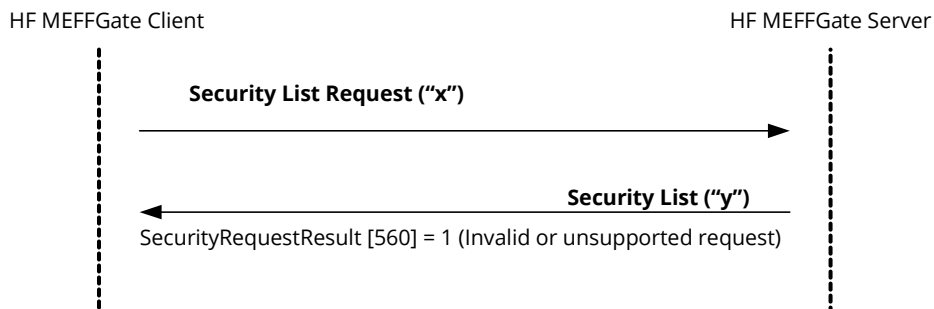
Solicitud de estado de contratos, sin contratos que cumplan los criterios de selección

Cuando no existen contratos que cumplan los criterios de selección indicados en una solicitud de estado de contratos, HF MEFFGate responde con un mensaje SecurityStatus con el campo SecurityTradingStatus = 19.



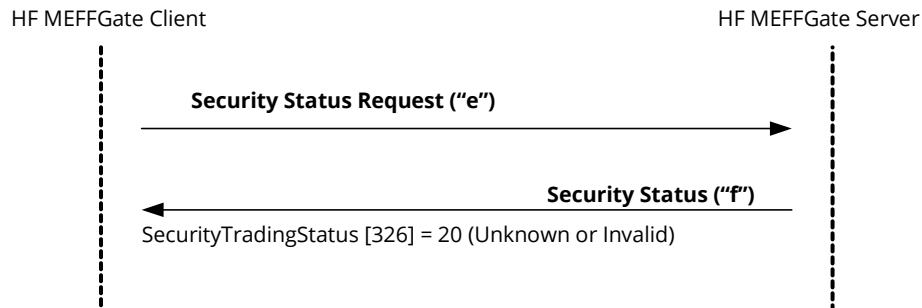
Solicitud de definición de contratos fallida

Cuando una solicitud de definición de contratos es errónea, es contestada con un mensaje Security List con el campo SecurityRequestResult = 1.



Solicitud de estado de contratos fallida

Cuando una solicitud de estado de contratos es errónea, es contestada con un mensaje Security Status con el campo SecurityTradingStatus = 20.



6.3.7 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- En el campo EventType [865] de los mensajes Security List y Security List Update Report se han utilizado códigos de evento superiores a 100 que deberán interpretarse correctamente por las aplicaciones cliente
- El máximo número de suscripciones vivas permitidas está limitado (ver capítulo 4.2 para más información)
- Se ha añadido el campo opcional MoreSubscriptionsFollowing [21500] a los mensajes Security List Request y Security Status Request para agrupar las peticiones de suscripción relativas a información de mercado

6.4 Información de mercado: Precios

6.4.1 Descripción

Esta funcionalidad permite solicitar la información relacionada con los precios de un conjunto de contratos.

6.4.2 Solicitud de información

La solicitud de información relacionada con precios se realiza mediante el mensaje Market Data Request.

Se puede seleccionar un conjunto de contratos mediante la combinación de campos del bloque Instrument, tal y como se explica en 4.1 .

A continuación se relacionan los tipos de información que MEFF ofrece. Un cliente puede solicitar una combinación de estos tipos en una misma solicitud.

- Bid
- Offer
- Precio de la última operación
- Precio de apertura (incluye los precios de subasta)
- Precio de cierre
- Precio alto de la sesión
- Precio bajo de la sesión
- Precio medio ponderado (VWAP) de la sesión
- Posición abierta al final de la sesión anterior
- Precio de cierre de la sesión anterior

Cuando una solicitud incluye Bid o Offer, es posible especificar la profundidad en tres modos: máxima, mejores precios o una profundidad exacta.

Además de la información aquí relacionada, la solicitud de Bid o Offer implica la recepción de los RFQ sobre los contratos seleccionados (Consúltense el capítulo "7 - RFQ" para una explicación detallada al respecto).

6.4.3 Recepción de información

HF MEFFGate devuelve la información solicitada mediante mensajes Market Data Snapshot Full Refresh.

Siguiendo el estándar FIX, en los mensajes de respuesta de una misma solicitud no se mezclará la información Bid y Offer con el resto de información.

Cada vez que se produce un cambio se recibe, por cada contrato, un nuevo mensaje Market Data Snapshot Full Refresh. Para todos los campos, incluidos los de Bid y Offer, si no se recibe información para un determinado campo, se deberá considerar que éste no ha variado desde la última actualización (ver capítulo 4.4 para más detalle). En cualquier caso se mantiene la restricción de no mezclar información Bid o Offer con otros campos.

Téngase en cuenta que cuando no existen precios de Bid o Offer para un contrato, se notifica con un valor cero en el campo MDEntrySize [271].

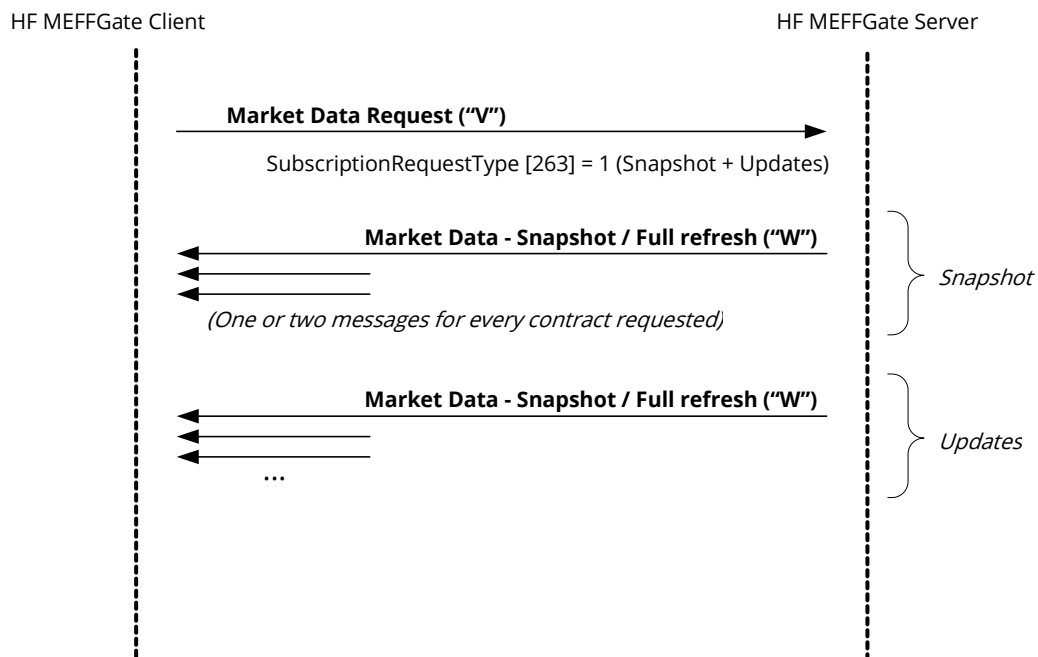
6.4.4 Lista de mensajes

| Mensaje | Descripción |
|--|--|
| Market Data Request (Msg Type = V) | Enviado por el cliente para solicitar información de precios |
| Market Data Snapshot Full Refresh (Msg Type = W) | Enviado por el servidor para devolver información de precios |
| Market Data Request Reject (Msg Type = Y) | Enviado por el servidor para notificar que una solicitud Market Data Request ha sido rechazada |

6.4.5 Flujo de mensajes

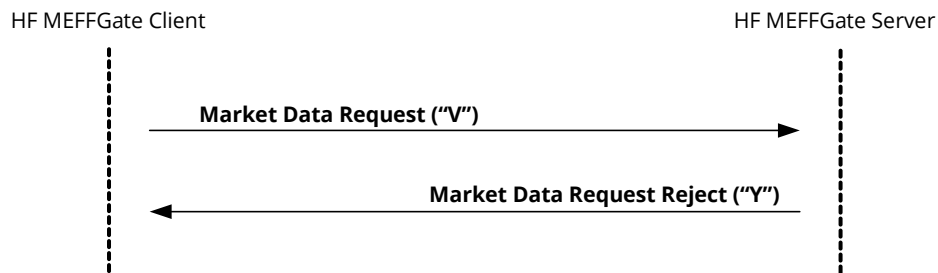
Solicitud de información de precios

Inicialmente se recibe un conjunto de mensajes para los contratos seleccionados en el momento de la solicitud. A partir de este punto se reciben mensajes notificando los cambios que se producen en la sesión.



Solicitud de información de precios y órdenes errónea

Cuando una solicitud de información de precios es errónea es contestada con un mensaje Market Data Request Reject.



6.4.6 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- El máximo número de suscripciones vivas permitidas está limitado (ver apartado 4.2 para más información)
- Se han añadido los campos Volatility [1188], GrossTradeAmt [381] y TrdMatchID [880] al mensaje Market Data Snapshot Full Refresh
- En el campo EventType [865] del mensaje Market Data Snapshot Full Refresh se han utilizado códigos de evento superiores a 100 que deberán interpretarse correctamente por las aplicaciones cliente
- Se han añadido el campo opcional MoreSubscriptionsFollowing [21500] al mensaje Market Data Request para agrupar las peticiones de suscripción relativas a información de mercado
- Se ha añadido el component block TrdRegTimestamps al mensaje Market Data Snapshot Full Refresh

6.5 Definición de mensajes

6.5.1 Trading Session Status Request (Msg Type = g)

Usado por el cliente para solicitar el estado de la sesión de negociación.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|------------|----------------------------|-----|------------------------------------|-------------|--|
| | Standard Header | S | MsgType = g | | |
| 335 | TradSesReqID | S | | String (10) | Identificador único para cada mensaje Trading Session Status Request |
| 263 | SubscriptionRequestType | S | 1 = Subscribe | Char | Si se ha informado ApplID [1180] + ApplSeqNum [1181] en el mensaje Logon, significa que sólo se desean recibir las actualizaciones a partir del momento indicado |
| 2150 0* | MoreSubscriptionsFollowing | N | Y (recomendado), N (default) | Boolean | Permite agrupar las peticiones de suscripción relativas a información de mercado. Para más información ver "3.6 - Sincronización a nivel de aplicación" |
| | Standard Trailer | S | | | |

6.5.2 Trading Session Status (Msg Type = h)

Enviado por el servidor para informar del estado del grupo de contratos en todas las modalidades de contratación o para rechazar un mensaje Trading Session Status Request.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|------|------------------|-----|---|---------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = h | | |
| 1180 | ApplID | N | | String | Conjuntamente con ApplSeqNum [1181] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 1181 | ApplSeqNum | N | | SeqNum | Conjuntamente con ApplID [1180] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 335 | TradSesReqID | N | | String | Identificador del mensaje Trading Session Status Request de referencia. Este campo siempre está presente en el mensaje |
| 336 | TradingSessionID | S | 100 = Horario futuros IBEX / FX 102 = Aplicaciones (horario futuros IBEX) 105 = Horario normal 106 = Operaciones Bolsa por Delta y Bases 107 = Horario Bono 108 = Aplicaciones (horario normal) 109 = Aplicaciones (horario Bono) | String | Modalidad de contratación |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|-------------------------|-----|---|---------|---|
| | | | 115 = RFQ (horario futuros IBEX) | | |
| | | | 116 = RFQ (horario normal) | | |
| | | | 117 = RFQ (horario Bono) | | |
| | | | 118 = RFQ de xRolling | | |
| 625 | TradingSessionSubl D | N | 1 = Pre-Trading (Not Started) 2 = Scheduled opening auction 3 = (Continuous) Trading 4 = Scheduled closing auction 5 = Post-Trading 6 = Scheduled intraday auction 9 = Unscheduled intraday auction 10 = Out of Main Session Trading 202 = No iniciado 203 = Abierto 204 = Cerrado | String | Subidentificador para identificar una fase de la sesión de negociación. Los valores posibles dentro de cada modalidad de contratación son: <u>TradingSessionID [336] = 100 (Horario futuros IBEX / FX), 105 (Horario Normal) y 107 (Horario Bono):</u> 1= Pre-Trading (Not Started) 2 = Scheduled opening auction 3 = (Continuous) Trading 5 = Post-Trading 9 = Unscheduled intraday auction <u>TradingSessionID [336] = 102 (Aplicaciones - horario futuros IBEX), 106 (Operaciones Bolsa por Delta y Bases), 108 (Aplicaciones - horario normal), 109 (Aplicaciones - horario Bono), 115 (RFQ - horario futuros IBEX), 116 (RFQ - horario normal), 117 (RFQ - horario Bono) y 118 (RFQ de xRolling):</u> 202 = No iniciado 203 = Abierto 204 = Cerrado |
| 325 | UnsolicitedIndicator | N | N = El mensaje es parte de un snapshot | Boolean | Contiene "Y" cuando el mensaje es enviado como resultado de una suscripción |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|------------------|-----|---|--------------|---|
| | | | Y = El mensaje es enviado como resultado de una suscripción | | |
| 340 | TradSesStatus | S | 1 = Halted 2 = Open 3 = Closed 4 = Pre-Open (Not started) 5 = Pre-Close 6 = Request Rejected | Int | Estado. Contiene el valor 6 (Request Rejected) cuando el mensaje es usado para rechazar una solicitud. El valor 4 (Pre-Open) indica que la modalidad de contratación aún no está abierta para negociación. El valor 3 (Closed) se da a final de cada modalidad de contratación y este estado es definitivo |
| 58 | Text | N | | String | Explicación del error. Presente si TradSesStatus = 6 |
| 60* | TransactTime | N | | UTCTimeStamp | Hora del suceso |
| | Standard Trailer | S | | | |

6.5.3 Security List Request (Msg Type = x)

Usado por el cliente para solicitar la definición de los contratos y el estado de los mismos.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--------|----------------------------|-----|--|-------------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = x | | |
| 320 | SecurityReqID | S | | String (10) | Identificador único para cada mensaje Security List Request |
| 559 | SecurityListRequest Type | S | 1 | Int | Criterio de selección usado |
| | Start <Instrument> | | | | |
| 55 | Symbol | S | [N/A] | | Siempre [N/A] |
| 48 | SecurityID | N | Para más detalle sobre los activos subyacentes, véase Tabla 7 en documento "Codification tables" | String | Activo subyacente del contrato |
| 22 | SecurityIDSource | N | 8 = Exchange Symbol | String | Requerido si SecurityID está presente. |
| 167 | SecurityType | N | Consultar tabla 6 en documento "Codification tables" | String | Tipo de producto |
| 200 | MaturityMonthYear | N | YYYYMM o YYYYMMDD o YYYYMMwW | Month-Year | Vencimiento del contrato |
| | End <Instrument> | | | | |
| 263 | SubscriptionRequestType | S | 1 = Subscribe | Char | Indica el tipo de solicitud respecto al estado de los contratos. Si se ha informado ApplID [1180] + ApplSeqNum [1181] en el mensaje Logon, significa que sólo se desean recibir las actualizaciones a partir del momento indicado. |
| 21500* | MoreSubscriptionsFollowing | N | Y (recomendado), N (default) | Boolean | Permite agrupar las peticiones de suscripción relativas a información de mercado. Para más información ver "3.6 - Sincronización a nivel de aplicación" |
| | Standard Trailer | S | | | |

6.5.4 Security List (Msg Type = y)

Mensaje enviado por el servidor para informar de la definición de uno o más contratos.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|------|-----------------------|-----|--|---------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = y | | |
| 1180 | ApplID | N | | String | Conjuntamente con ApplSeqNum [1181] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 1181 | ApplSeqNum | N | | SeqNum | Conjuntamente con ApplID [1180] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 320 | SecurityReqID | N | | String | Identificador del mensaje Security List Request al que se está respondiendo |
| 322 | SecurityResponseID | N | | String | Identificador único para cada mensaje Security List |
| | | | 0 = Valid request | | |
| | | | 1 = Invalid or unsupported request | | |
| | | | 2 = No instruments found that match selection criteria | | |
| 560 | SecurityRequestResult | N | 4 = Instrument data temporarily unavailable | Int | Resultado de la solicitud identificada por SecurityReqID. En caso de rechazo (>0) el campo 58 Text contiene un texto explicativo |
| | | | 5 = Request was rejected because the SecurityType specified is not supported | | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-------|---------------------|-----|--|------------|---|
| 393 | TotNoRelatedSym | N | | Int | Número total de contratos que cumplen los criterios de selección de la solicitud. El número de contratos que contiene el mensaje se indica en el campo NoRelatedSym. Este campo puede estar presente cuando SecurityRequestResult = 0 |
| 1301 | MarketID | N | | Exchange | Operating MIC |
| 1300 | MarketSegmentID | N | | String | Segment MIC |
| 893 | LastFragment | N | | Boolean | Indica cuando el mensaje es el último en una secuencia de respuesta a una única solicitud. Este campo puede estar presente cuando SecurityRequestResult = 0 |
| 146 | NoRelatedSym | N | 1 | NumInGroup | Indica el número de contratos contenidos en este mensaje. |
| | Start <Instrument> | | | | |
| →55 | Symbol | N | [N/A] o Código de contrato | String(22) | |
| →48 | SecurityID | N | Para más detalle sobre los activos subyacentes, véase Tabla 7 en documento "Codification tables" | String | Activo subyacente del contrato |
| →22 | SecurityIDSource | N | 8 = Exchange Symbol | String | |
| | Start <SecAltIDGrp> | | | | |
| →454 | NoSecurityAltID | N | | NumInGroup | |
| →→455 | SecurityAltID | N | | String | <ul style="list-style-type: none"> • Si SecurityAltIDSource [456] = 4, contiene el código de contrato ISIN • Si SecurityAltIDSource [456] = J, contiene el código de contrato FISN (Financial Instrument short name in compliance with ISO 18774) • Si SecurityAltIDSource [456] = T, contiene el LEI del emisor |
| | | | 4 = ISIN number | | |
| →→456 | SecurityAltIDSource | N | J = FISN T = LEI del emisor | String | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-------------------|--------------------|-----|---|--------------|---|
| End <SecAltIDGrp> | | | | | |
| → 1151 | SecurityGroup | N | Consúltese la Tabla 8 en documento "Codification tables" para una lista de los valores posibles | String | Familia de productos |
| → 461 | CFIcode | N | | String(6) | Tipo de contrato según el estándar ISO 10962 |
| → 167 | SecurityType | N | Consultar tabla 6 en documento "Codification tables" | String | Tipo de producto |
| → 762 | SecuritySubType | N | Consúltese la Tabla 9 en documento "Codification tables" para una lista de los valores posibles | String | Tipo de estrategia |
| → 200 | MaturityMonthYear | N | YYYYMM o YYYYMMDD o YYYYMMwW | Month-Year | Vencimiento del contrato |
| → 541 | MaturityDate | N | | LocalMktDate | Fecha de vencimiento |
| → 225 | IssueDate | N | | LocalMktDate | Fecha de emisión del contrato |
| → 202 | StrikePrice | N | | Price | Precio de ejercicio. Sólo presente en opciones |
| → 968 | StrikeValue | N | | Float | Para derivados sobre acciones, número de acciones equivalentes por cada contrato |
| → 206 | OptAttribute | N | | Char | Número de versión del contrato, como resultado de hechos corporativos u otros eventos |
| → 231 | ContractMultiplier | N | | Float | Indica el factor multiplicativo para convertir unidades de precio a unidades monetarias |
| → 969 | MinPriceIncrement | N | | Float | Cantidad mínima permitida en el cambio de precio en la entrada de la orden |
| → 996 | UnitOfMeasure | N | Mwh = Megavatio-hora | String | Unidad de medida del multiplicador del contrato |
| → 1193 | SettlMethod | N | C = Cash settlement required (liquidación por diferencias) | Char | Método de liquidación para este contrato |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------|-------------------|-----|--|------------|---|
| | | | P = Physical settlement required (liquidación por entregas) | | |
| → 1194 | ExerciseStyle | N | 0 = European 1 = American | Int | Tipo de ejercicio para este contrato |
| → 201 | PutOrCall | N | 0 = Put 1 = Call | Int | Indica si la opción es put o call |
| → 1244 | FlexibleIndicator | N | Y = Flexible N = Standard (defecto) | Boolean | Indica si este contrato es flexible o estándar Si no se informa este campo significa "N = Standard " |
| → 107 | SecurityDesc | N | Consúltese la Tabla 5 en documento "Codification tables" para una lista de los subgrupos | String | Descripción del subgrupo de contrato |
| | Start<EvntGrp> | | | | |
| → 864 | NoEvents | N | | NumInGroup | |
| | | | 101 = Último día de negociación | | |
| | | | 114 = Número de decimales en el precio del contrato | | |
| | | | 132 = Número máximo de decimales en órdenes | | |
| →→ 865 | EventType | N | 146 = Límite LIS-pre (Large in Scale) 147 = Límite SSTI-pre (Size Specific to Instrument) 148 = Límite LIS-post (Large in Scale) | Int | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------|-----|--|---------|-------------|
| | | | 149 = Límite SSTI-post (Size Specific to Instrument) | | |
| | | | 150 = Instrumento Líquido | | |
| | | | 151 = Regla de ajustes | | |
| | | | 152 = Importe nominal a partir del cuál no se admiten órdenes | | |
| | | | 153 = Contrato admite self- match prevention | | |
| | | | 154 = Contrato listado a petición del emisor | | |
| | | | 155 = Commodity derivative Indicator para indicar si el contrato pertenece o no a la definición de "commodity derivative" según el Artículo 2(1)(30) de la norma (EU) núm 600/2014 | | |
| | | | 156 = Trading obligation. Indica si el contrato tiene obligación de ser negociado en un mercado regulado | | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------|-----------|-----|--|--------------|---|
| | | | 159 = Contiene la acción cuyo dividendo es el subyacente del contrato | | |
| | | | 160 = Base product | | |
| | | | 161 = Sub product | | |
| | | | 162 = Further sub product | | |
| | | | 167 = xRolling closing type | | |
| | | | 168 = xRolling Buyer financing rate | | |
| | | | 169 = xRolling buyer rate markup | | |
| | | | 170 = xRolling seller financing rate | | |
| | | | 171 = xRolling seller rate markup | | |
| | | | 172 = xRolling Dividend settlement percentage | | |
| | | | 173 = xRolling differential between payment date and receipt of ordinary dividend flow | | |
| →→ 866 | EventDate | N | | LocalMktDate | Último día de negociación, cuando EventType = 101 |
| →→ 868 | EventText | N | | String | Si EventType = 114, contiene el número de decimales en el precio del contrato |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------|-----|-----------------|---------|---|
| | | | | | Si EventType = 132, contiene el número máximo de decimales en órdenes |
| | | | | | Si EventType = 146, contiene el Límite LIS-pre (Large in Scale) |
| | | | | | Si EventType = 147, contiene el Límite SSTI-pre (Size Specific to Instrument) |
| | | | | | Si EventType = 148, contiene el Límite LIS-post (Large in Scale) |
| | | | | | Si EventType = 149, contiene el Límite SSTI-post (Size Specific to Instrument) |
| | | | | | Si EventType = 150, indica si el instrumento es Líquido: Y – Líquido N – Ilíquido |
| | | | | | Si EventType = 151, contiene la regla de ajustes: E – Sólo se ajustan los dividendos extraordinarios T - Total |
| | | | | | Si EventType = 152, contiene el Importe nominal a partir del cuál no se admiten órdenes |
| | | | | | Si EventType = 153, indica si el contrato admite o no self-match prevention: Y – Admite self-match prevention N – No admite self-match prevention |
| | | | | | Si EventType = 154, indica si el contrato es listado a petición del emisor: Y – Listado a petición del emisor N – Listado por propia iniciativa |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------|-----|-----------------|---------|---|
| | | | | | <p>Si EventType = 155, indica si el contrato si el contrato pertenece o no a la definición de "commodity derivative" según el Artículo 2(1)(30) de la norma (EU) núm 600/2014:</p> <p>Y – Es un Commodity derivative N – No es un Commodity derivative</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 156, es el Trading obligation. Indica si el contrato tiene obligación de ser negociado en un mercado regulado:</p> <p>Y – Si N – No</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 159, contiene la acción cuyo dividendo es el subyacente del contrato</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 160, 161 ó 162, contiene la clasificación de commodity derivatives (ver tabla 11 en documento "Codification tables")</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 167, indica si el xRolling puede ser cerrado por alguna de las contrapartes antes de la fecha de vencimiento.</p> <p>M: Market (Default value). Valor a utilizar en xRolling FLEX con fecha de vencimiento cerrada y sin posibilidad de modificación.</p> <p>1: By buyer 2: By seller A: By both</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 168, contiene el tipo de referencia financiación en compras</p> <p>S: €STR (Default value for non-FLEX xRolling) F: FISAnalytics M: MEFF rate 0: Zero ‘: N/A (used in FLEX, in the financing leg)</p> |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|------------|------------------------------|-----|--------------------------------------|------------|--|
| | | | | | Si EventType = 169, contiene el markup sobre tipo de referencia en compras De -100.0000 a 100.0000 |
| | | | | | Si EventType = 170, contiene el tipo de referencia financiación en ventas S: €STR (Default value for non-FLEX xRolling) F: FISAnalytics M: MEFF rate 0: Zero '': N/A (used in FLEX, in the financing leg) |
| | | | | | Si EventType = 171, contiene el markup sobre tipo de referencia en ventas De -100.0000 a 100.0000 |
| | | | | | Si EventType = 172, contiene el porcentaje de liquidación de dividendos De 0.00 a 100.00 |
| | | | | | Si EventType = 173, contiene el diferencial de fecha de pago/ cobro del flujo de dividendo ordinario 0-999 |
| | End <EvtGrp> | | | | |
| | Start <ComplexEvents > | | | | |
| → 1483 | NoComplexEvents | N | 1 | NumInGroup | |
| →→ 1484 | ComplexEventType | N | 16 = Foreign exchange cross currency | Int | |
| →→ 2124 | ComplexEventCurrencyOne | N | | Currency | Código de la divisa base. Expresada según estándar ISO 4217 |
| →→ 2125 | ComplexEventCurrencyTwo | N | | Currency | Código de la divisa cotizada. Expresada según estándar ISO 4217 |
| | End <ComplexEvents > | | | | |
| | End <Instrument > | | | | |
| | Start <SecurityTradingRules> | | | | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------------|---------------------------------|-----|------------------------------------|------------|--|
| | Start <BaseTradingRules> | | | | |
| → 562 | MinTradeVol | N | | Qty | Mínimo tamaño de la orden |
| → 561 | RoundLot | N | | Qty | Tamaño de lote. Las órdenes sobre este contrato deben ser múltiplos de esta cantidad |
| | End <BaseTradingRules> | | | | |
| | End <SecurityTradingRules> | | | | |
| | Start <StrikeRules> | | | | |
| → 1201 | NoStrikeRules | N | 1 | NumInGroup | |
| →→ 1223 | StrikeRuleID | N | [N/A] | String | |
| | Start <MaturityRules> | | | | |
| →→ 1236 | NoMaturityRules | N | 1 | NumInGroup | |
| →→ → 1222 | MaturityRuleID | N | [N/A] | String | |
| | | | 0 = Months | | |
| →→ → 1302 | MaturityMonthYearIncrementUnits | N | 1 = Days 2 = Weeks 3 = Years | Int | Periodicidad |
| →→ → 1241 | StartMaturityMonthYear | N | YYYYMMDD | Month-Year | Fecha de inicio de entrega para los contratos de energía |
| →→ → 1226 | EndMaturityMonthYear | N | YYYYMMDD | Month-Year | Fecha de fin de entrega para los contratos de energía |
| →→ → 1229 | MaturityMonthYearIncrement | N | | Int | |
| | End < MaturityRules > | | | | |
| | End <StrikeRules> | | | | |
| → 711 | NoUnderlyings | N | 1 | NumInGroup | Presente si el contrato tiene como subyacente a otro contrato |
| | Start <UnderlyingInstrument> | | | | |
| →→ 311 | UnderlyingSymbol | N | | String(22) | Símbolo del contrato que actúa como subyacente |
| →→ 457 | NoUnderlyingSecurityAltID | N | | NumInGroup | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------------|-------------------------------|-----|---|------------|---|
| →→ → 458 | UnderlyingSecurityAltID | N | | String | Si UnderlyingSecurityAltIDSource [459] = T, contiene el LEI del emisor del subyacente |
| →→ → 459 | UnderlyingSecurityAltIDSource | N | T = LEI del emisor del subyacente | String | |
| →→ 318 | UnderlyingCurrency | N | | Currency | Código de divisa en que se expresa el subyacente. Expresada según estándar ISO 4217 |
| | End <UnderlyingInstrument> | | | | |
| →15 | Currency | N | | Currency | Código de divisa en la que se negocia el contrato. Expresada según estándar ISO 4217 |
| | Start <Stipulations> | | | | |
| → 232 | NoStipulations | N | | NumInGroup | |
| | | | 100 = Horario futuros IBEX / FX | | |
| | | | 102 = Aplicaciones (horario futuros IBEX) | | |
| | | | 105 = Horario normal | | |
| | | | 106 = Operaciones Bolsa por Delta y Bases | | |
| →→ 233 | StipulationType | N | 107 = Horario Bono | String | Modalidad de contratación |
| | | | 108 = Aplicaciones (horario normal) | | |
| | | | 109 = Aplicaciones (horario Bono) | | |
| | | | 115 = RFQ (horario futuros IBEX) | | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------|--------------------------|-----|-------------------------------|------------|--|
| | | | 116 = RFQ (horario normal) | | |
| | | | 117 = RFQ (horario Bono) | | |
| | | | 118 = RFQ de xRolling | | |
| →→ 234 | StipulationValue | N | | String | Indica las modalidades válidas de contratación para este contrato. Los valores posibles son Y/N. Si no se envía, significa 'N' |
| | End <Stipulations> | | | | |
| → 555 | NoLegs | N | | NumInGroup | Sólo presente en contratos time-spread y estrategias |
| →→ | Start <InstrumentLeg> | | | | |
| →→ 600 | LegSymbol | N | | String(22) | Código de contrato. Presente si se ha especificado NoLegs |
| →→ 623 | LegRatioQty | N | | Float | Contiene la ratio del número de contratos de este LegSymbol relativos al conjunto de la estrategia |
| →→ 624 | LegSide | N | 1 = Buy 2 = Sell | Char | Indica si el contrato LegSymbol interviene como compra o venta. Presente si se ha especificado NoLegs |
| →→ 566 | LegPrice | N | | Price | Precio de la leg |
| | End <InstrumentLeg> | | | | |
| →58 | Text | N | | String | Descripción del contrato Si SecurityRequestResult [560] > 0 contiene una explicación del error |
| | Standard Trailer | S | | | |

6.5.5 Security List Update Report (Msg Type = BK)

Mensaje enviado por el servidor para informar de los cambios producidos durante la sesión en la definición de contratos.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-------|---------------------|-----|--|--------------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = BK | | |
| 1180 | ApplID | N | | String | Conjuntamente con ApplSeqNum [1181] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 1181 | ApplSeqNum | N | | SeqNum | Conjuntamente con ApplID [1180] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 964 | SecurityReportID | N | | String | Identificador único para cada mensaje Security List Update Report |
| 320 | SecurityReqID | N | | String | Identificador del mensaje Security List Request al que se está respondiendo |
| 980 | SecurityUpateAction | N | A – Alta D – Baja M - Modificación | Char | |
| 1301 | MarketID | N | | Exchange | Operating MIC |
| 1300 | MarketSegmentID | N | | String | Segment MIC |
| 60 | TransactTime | N | | UTCTimeStamp | Hora del suceso |
| 146 | NoRelatedSym | N | 1 | NumInGroup | Indica el número de contratos contenidos en este mensaje. |
| | Start <Instrument> | | | | |
| →55 | Symbol | N | | String(22) | Código de contrato |
| →48 | SecurityID | N | Para más detalle sobre los activos subyacentes, véase Tabla 7 en documento “Codification tables” | String | Activo subyacente del contrato |
| →22 | SecurityIDSource | N | 8 = Exchange Symbol | String | |
| | Start <SecAltIDGrp> | | | | |
| →454 | NoSecurityAltID | N | | NumInGroup | |
| →→455 | SecurityAltID | N | | String | <ul style="list-style-type: none"> Si SecurityAltIDSource [456] = 4, contiene el código de contrato ISIN |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------|---------------------|-----|---|--------------|--|
| | | | | | <ul style="list-style-type: none"> Si SecurityAltIDSource [456] = J, contiene el código de contrato FISN (Financial Instrument short name in compliance with ISO 18774) Si SecurityAltIDSource [456] = T, contiene el LEI del emisor |
| | | | 4 = ISIN number | | |
| →→ 456 | SecurityAltIDSource | N | J = FISN T = LEI del emisor | String | |
| | End <SecAltIDGrp> | | | | |
| → 1151 | SecurityGroup | N | Consúltese la Tabla 8 en documento "Codification tables" para una lista de los valores posibles | String | Familia de productos |
| → 461 | CFIcode | N | | String(6) | Tipo de contrato según el estándar ISO 10962 |
| → 167 | SecurityType | N | Consultar tabla 6 en documento "Codification tables" | String | Tipo de producto |
| → 762 | SecuritySubType | N | Consúltese la Tabla 9 en documento "Codification tables" para una lista de los valores posibles | String | Tipo de estrategia |
| → 200 | MaturityMonthYear | N | YYYYMM o YYYYMMDD o YYYYMMwW | Month-Year | Vencimiento del contrato |
| → 541 | MaturityDate | N | | LocalMktDate | Fecha de vencimiento |
| → 225 | IssueDate | N | | LocalMktDate | Fecha de emisión del contrato |
| → 202 | StrikePrice | N | | Price | Precio de ejercicio. Sólo presente en opciones |
| → 968 | StrikeValue | N | | Float | Para derivados sobre acciones, número de acciones equivalentes por cada contrato |
| → 206 | OptAttribute | N | | Char | Número de versión del contrato, como resultado de hechos corporativos u otros eventos |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-------------------|--------------------|-----|---|------------|--|
| → 231 | ContractMultiplier | N | | Float | Indica el factor multiplicativo para convertir unidades de precio a unidades monetarias |
| → 969 | MinPriceIncrement | N | | Float | Cantidad mínima permitida en el cambio de precio en la entrada de la orden |
| → 996 | UnitOfMeasure | N | Mwh = Megavatio-hora | String | Unidad de medida del multiplicador del contrato |
| → 1193 | SettlMethod | N | C = Cash settlement required (liquidación por diferencias) P = Physical settlement required (liquidación por entregas) | Char | Método de liquidación para este contrato |
| → 1194 | ExerciseStyle | N | 0 = European 1 = American | Int | Tipo de ejercicio para este contrato |
| → 201 | PutOrCall | N | 0 = Put 1 = Call | Int | Indica si la opción es put o call |
| → 1244 | FlexibleIndicator | N | Y = Flexible N = Standard (defecto) | Boolean | Indica si este contrato es flexible o estándar. Si no se informa este campo significa "N = Standard " |
| → 107 | SecurityDesc | N | Consúltese la Tabla 5 en documento "Codification tables" para una lista de los subgrupos | String | Descripción del subgrupo de contrato |
| Start < EvntGrp > | | | | | |
| → 864 | NoEvents | N | | NumInGroup | |
| →→ 865 | EventType | N | 101 = Último día de negociación 114 = Número de decimales en el precio del contrato | Int | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------|-----|---|---------|-------------|
| | | | 132 = Número máximo de decimales en órdenes | | |
| | | | 146 = Límite LIS-pre (Large in Scale) | | |
| | | | 147 = Límite SSTI-pre (Size Specific to Instrument) | | |
| | | | 148 = Límite LIS-post (Large in Scale) | | |
| | | | 149 = Límite SSTI-post (Size Specific to Instrument) | | |
| | | | 150 = Instrumento Líquido | | |
| | | | 151 = Regla de ajustes | | |
| | | | 152 = Importe nominal a partir del cuál no se admiten órdenes | | |
| | | | 153 = Contrato admite self-match prevention | | |
| | | | 154 = Contrato listado a petición del emisor | | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------|-----|-----------------|---------|--|
| | | | 155 = | | Commodity derivative Indicator para indicar si el contrato pertenece o no a la definición de "commodity derivative" según el Artículo 2(1)(30) de la norma (EU) núm 600/2014 |
| | | | 156 = | | Trading obligation. Indica si el contrato tiene obligación de ser negociado en un mercado regulado |
| | | | 159 = | | Contiene la acción cuyo dividendo es el subyacente del contrato |
| | | | 160 = | | Base product |
| | | | 161 = | | Sub product |
| | | | 162 = | | Further sub product |
| | | | 167 = | | xRolling closing type |
| | | | 168 = | | xRolling Buyer financing rate |
| | | | 169 = | | xRolling buyer rate markup |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------|-----------|-----|--|--------------|--|
| | | | 170 = xRolling seller financing rate | | |
| | | | 171 = xRolling seller rate markup | | |
| | | | 172 = xRolling Dividend settlement percentage | | |
| | | | 173 = xRolling differential between payment date and receipt of ordinary dividend flow | | |
| →→ 866 | EventDate | N | | LocalMktDate | <p>Último día de negociación, cuando EventType = 101</p> <p>Si EventType = 114, contiene el número de decimales en el precio del contrato</p> <p>Si EventType = 132, contiene el número máximo de decimales en órdenes</p> <p>Si EventType = 146, contiene el Límite LIS-pre (Large in Scale)</p> <p>Si EventType = 147, contiene el Límite SSTI-pre (Size Specific to Instrument)</p> |
| →→ 868 | EventText | N | | String | <p>Si EventType = 148, contiene el Límite LIS-post (Large in Scale)</p> <p>Si EventType = 149, contiene el Límite SSTI-post (Size Specific to Instrument)</p> <p>Si EventType = 150, indica si el instrumento es Líquido: Y – Líquido N – Ilíquido</p> <p>Si EventType = 151, contiene la regla de ajustes:</p> |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------|-----|-----------------|---------|---|
| | | | | | <p>E – Sólo se ajustan los dividendos extraordinarios</p> <p>T - Total</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 152, contiene el Importe nominal a partir del cuál no se admiten órdenes</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 153, indica si el contrato admite o no self-match prevention:</p> <p>Y – Admite self-match prevention</p> <p>N – No admite self-match prevention</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 154, indica si el contrato es listado a petición del emisor:</p> <p>Y – Listado a petición del emisor</p> <p>N – Listado por propia iniciativa</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 155, indica si el contrato si el contrato pertenece o no a la definición de "commodity derivative" según el Artículo 2(1)(30) de la norma (EU) núm 600/2014:</p> <p>Y – Es un Commodity derivative</p> <p>N – No es un Commodity derivative</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 156, es el Trading obligation. Indica si el contrato tiene obligación de ser negociado en un mercado regulado:</p> <p>Y – Si</p> <p>N – No</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 159, contiene la acción cuyo dividendo es el subyacente del contrato</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 160, 161 ó 162, contiene la clasificación de commodity derivatives (ver tabla 11 en documento "Codification tables")</p> |
| | | | | | <p>Si EventType = 167, indica si el xRolling puede ser cerrado por alguna de las contrapartes antes de la fecha de vencimiento.</p> |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------------|--------|-----|-----------------|---------|---|
| | | | | | <p>M: Market (Default value). Valor a utilizar en xRolling FLEX con fecha de vencimiento cerrada y sin posibilidad de modificación. 1: By buyer 2: By seller A: By both</p> <p>Si EventType = 168, contiene el tipo de referencia financiación en compras S: €STR (Default value for non-FLEX xRolling) F: FISAnalytics M: MEFF rate 0: Zero ‘: N/A (used in FLEX, in the financing leg)</p> <p>Si EventType = 169, contiene el markup sobre tipo de referencia en compras De -100.0000 a 100.0000</p> <p>Si EventType = 170, contiene el tipo de referencia financiación en ventas S: €STR (Default value for non-FLEX xRolling) F: FISAnalytics M: MEFF rate 0: Zero ‘: N/A (used in FLEX, in the financing leg)</p> <p>Si EventType = 171, contiene el markup sobre tipo de referencia en ventas De -100.0000 a 100.0000</p> <p>Si EventType = 172, contiene el porcentaje de liquidación de dividendos De 0.00 a 100.00</p> <p>Si EventType = 173, contiene el diferencial de fecha de pago/ cobro del flujo de dividendo ordinario 0-999</p> |
| End < EvntGrp > | | | | | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------------|---------------------------------|-----|--------------------------------------|------------|--|
| | Start < ComplexEvents > | | | | |
| → 1483 | NoComplexEvents | N | 1 | NumInGroup | |
| →→ 1484 | ComplexEventType | N | 16 = Foreign exchange cross currency | Int | |
| →→ 2124 | ComplexEventCurrencyOne | N | | Currency | Código de la divisa base. Expresada según estándar ISO 4217 |
| →→ 2125 | ComplexEventCurrencyTwo | N | | Currency | Código de la divisa cotizada. Expresada según estándar ISO 4217 |
| | End < ComplexEvents > | | | | |
| | End <Instrument> | | | | |
| | Start <SecurityTradingRules> | | | | |
| | Start <BaseTradingRules> | | | | |
| → 562 | MinTradeVol | N | | Qty | Mínimo tamaño de la orden |
| → 561 | RoundLot | N | | Qty | Tamaño de lote. Las órdenes sobre este contrato deben ser múltiplos de esta cantidad |
| | End <BaseTradingRules> | | | | |
| | End <SecurityTradingRules> | | | | |
| | Start <StrikeRules> | | | | |
| → 1201 | NoStrikeRules | N | 1 | NumInGroup | |
| →→ 1223 | StrikeRuleID | N | [N/A] | String | |
| | Start <MaturityRules> | | | | |
| →→ 1236 | NoMaturityRules | N | 1 | NumInGroup | |
| →→ → 1222 | MaturityRuleID | N | [N/A] | String | |
| | | | 0 = Months | | |
| →→ → 1302 | MaturityMonthYearIncrementUnits | N | 1 = Days 2 = Weeks 3 = Years | Int | Periodicidad |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------------|-------------------------------|-----|---|------------|---|
| →→ → 1241 | StartMaturityMonthYear | N | YYYYMMDD | Month-Year | Fecha de inicio de entrega para los contratos de energía |
| →→ → 1226 | EndMaturityMonthYear | N | YYYYMMDD | Month-Year | Fecha de fin de entrega para los contratos de energía |
| →→ → 1229 | MaturityMonthYearIncrement | N | | Int | |
| | End < MaturityRules > | | | | |
| | End <StrikeRules> | | | | |
| → 711 | NoUnderlyings | N | 1 | NumInGroup | Presente si el contrato tiene como subyacente a otro contrato |
| | Start <UnderlyingInstrument> | | | | |
| →→ 311 | UnderlyingSymbol | N | | String(22) | Símbolo del contrato que actúa como subyacente |
| →→ 457 | NoUnderlyingSecurityAltID | N | | NumInGroup | |
| →→ → 458 | UnderlyingSecurityAltID | N | | String | Si UnderlyingSecurityAltIDSource [459] = T, contiene el LEI del emisor del subyacente |
| →→ → 459 | UnderlyingSecurityAltIDSource | N | T = LEI del emisor del subyacente | String | |
| →→ 318 | UnderlyingCurrency | N | | Currency | Código de divisa en que se expresa el subyacente y el strike. Expresada según estándar ISO 4217 |
| | End <UnderlyingInstrument> | | | | |
| →15 | Currency | N | | Currency | Código de divisa en la que se negocia el contrato. Expresada según estándar ISO 4217 |
| | Start <Stipulations> | | | | |
| → 232 | NoStipulations | N | | NumInGroup | |
| | | | 100 = Horario futuros IBEX / FX | | |
| →→ 233 | StipulationType | N | 102 = Aplicaciones (horario futuros IBEX) | String | Modalidad de contratación |
| | | | 105 = Horario normal | | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------|--------------------------|-----|--|------------|---|
| | | | 106 = Operaciones Bolsa por Delta y Bases | | |
| | | | 107 = Horario Bono | | |
| | | | 108 = Aplicaciones (horario normal) | | |
| | | | 109 = Aplicaciones (horario Bono) | | |
| | | | 115 = RFQ (horario futuros IBEX) | | |
| | | | 116 = RFQ (horario normal) | | |
| | | | 117 = RFQ (horario Bono) | | |
| | | | 118 = RFQ de xRolling | | |
| →→ 234 | StipulationValue | N | | String | Indica las modalidades válidas de contratación para este contrato. Los valores posibles son Y/N. Si no se envía, significa 'N'. |
| | End <Stipulations> | | | | |
| → 555 | NoLegs | N | | NumInGroup | Sólo presente en contratos time-spread y estrategias |
| →→ | Start <InstrumentLeg> | | | | |
| →→ 600 | LegSymbol | N | | String(22) | Código de contrato. Presente si se ha especificado NoLegs |
| →→ 623 | LegRatioQty | N | | Float | Contiene la ratio del número de contratos de este LegSymbol relativos al conjunto de la estrategia |
| →→ 624 | LegSide | N | 1 = Buy 2 = Sell | Char | Indica si el contrato LegSymbol interviene como compra o venta. Presente si se ha especificado NoLegs |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------|------------------------|-----|-----------------|---------|--------------------------|
| →→ 566 | LegPrice | N | | Price | Precio de la leg |
| | End <InstrumentLeg> | | | | |
| →58 | Text | N | | String | Descripción del contrato |
| | Standard Trailer | S | | | |

6.5.6 Security Status Request (MsgType = e)

Usado por el cliente para solicitar el estado de los contratos.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--------|----------------------------|-----|--|-------------|--|
| | Standard Header | S | MsgType = e | | |
| 324 | SecurityStatusReqID | S | | String (10) | Identificador único para cada mensaje Security Status Request |
| | Start <Instrument> | | | | |
| 55 | Symbol | S | [N/A] | | Siempre [N/A] |
| 48 | SecurityID | N | Para más detalle sobre los activos subyacentes, véase Tabla 7 en documento "Codification tables" | String | Activo subyacente del contrato |
| 22 | SecurityIDSource | N | 8 = Exchange Symbol | String | Requerido si SecurityID está presente |
| 167 | SecurityType | N | Consultar tabla 6 en documento "Codification tables" | String | Tipo de producto |
| 200 | MaturityMonthYear | N | YYYYMM o YYYYMMDD o YYYYMMwW | Month-Year | Vencimiento del contrato |
| | End <Instrument> | | | | |
| 263 | SubscriptionRequestType | S | 1 = Subscribe | Char | Si se ha informado ApplID [1180] + ApplSeqNum [1181] en el mensaje Logon, significa que sólo se desean recibir las actualizaciones a partir del momento indicado |
| 21500* | MoreSubscriptionsFollowing | N | Y (recomendado), N (default) | Boolean | Permite agrupar las peticiones de suscripción relativas a información de mercado. Para más información ver "3.6 - Sincronización a nivel de aplicación" |
| | Standard Trailer | S | | | |

6.5.7 Security Status (MsgType = f)

Mensaje enviado por el servidor para informar del estado de un contrato.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------|---------------------|-----|--|------------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = f | | |
| 1180 | ApplID | N | | String | Conjuntamente con ApplSeqNum [1181] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 1181 | ApplSeqNum | N | | SeqNum | Conjuntamente con ApplID [1180] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 324 | SecurityStatusReqID | N | | String | Identificador del mensaje Security Status Request al que se está respondiendo. Este campo siempre está presente en el mensaje |
| | Start <Instrument> | | | | |
| | | | | | Código de contrato. |
| 55 | Symbol | S | [N/A] o Código de contrato | String(22) | Contiene [N/A] cuando el mensaje corresponde a un conjunto de contratos o cuando SecurityTradingStatus [326] = 20 (Unknown or invalid) |
| 48 | SecurityID | N | Para más detalle sobre los activos subyacentes, véase Tabla 7 en documento "Codification tables" | String | Activo subyacente del contrato. Si no se especifica significa para todos los activos subyacentes |
| 22 | SecurityIDSource | N | 8 = Exchange Symbol | String | Informado si SecurityID está presente |
| 454 | NoSecurityAltID | N | | NumInGroup | |
| → 455 | SecurityAltID | N | | String | <ul style="list-style-type: none"> Si SecurityAltIDSource [456] = 4, contiene el código de contrato ISIN |
| → 456 | SecurityAltIDSource | N | 4 = ISIN number | String | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|------------------|-----------------------|-----|---|------------|---|
| 1151 | SecurityGroup | N | Consúltese la Tabla 8 en documento "Codification tables" para una lista de los valores posibles | String | Familia de productos. Si no se especifica significa para todas las familias de productos |
| 167 | SecurityType | N | Consultar tabla 6 en documento "Codification tables" | String | Tipo de producto Si no se especifica significa para todos los tipos de producto |
| 200 | MaturityMonthYear | N | YYYYMM o YYYYMMDD o YYYYMMwW | Month-Year | Vencimiento del contrato. Si no se especifica significa para todos los vencimientos |
| End <Instrument> | | | | | |
| 325 | UnsolicitedIndicator | N | N = El mensaje es parte de un snapshot Y = El mensaje es enviado como resultado de una suscripción | Boolean | Contiene "Y" cuando el mensaje es enviado como resultado de una suscripción, y "N" en caso contrario. Este campo siempre está presente en el mensaje |
| 326 | SecurityTradingStatus | N | 17 = Ready to trade 18 = Not available for trading 19 = Not Traded on this Segment 20 = Unknown or Invalid 21 = Pre-Open 23 = Fast Market 100 = Extraordinary Market Conditions | Int | Informa del estado del contrato El valor "21" indica que el contrato o familia de productos se halla en subasta. No debe confundirse este valor con el estado "Pre-Open" de la sesión de negociación, que indica que ningún contrato es negociable. (Véase el campo 340, TradSesStatus, del mensaje Trading Session Status). Para evaluar este campo, hay que tener en consideración también el valor del campo TradSesStatus [340] del mensaje Trading Session Status. |
| 327 | HaltReason | N | 100 = Suspendido por regulador | Int | Motivo de la suspensión |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|------------------|-----|--|--------------|--|
| | | | 101 = Interrumpido por supervisión | | |
| 332 | HighPx | N | | Price | Precio máximo aceptado para un contrato. Este valor puede variar durante una sesión de negociación |
| 333 | LowPx | N | | Price | Precio mínimo aceptado para un contrato. Este valor puede variar durante una sesión de negociación |
| 60 | TransactTime | N | | UTCTimeStamp | Hora del suceso |
| 58 | Text | N | | String | Contiene una explicación del error. Puede estar presente si SecurityTradingStatus = 19 ó 20 |
| | Standard Trailer | S | | | |

6.5.8 Market Data Request (Msg Type = V)

Usado por el cliente para solicitar información de precios.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------|-------------------------|-----|---|-------------|--|
| | Standard Header | S | MsgType = V | | |
| 262 | MDReqID | S | | String (10) | Identificador único para cada mensaje Market Data Request |
| 263 | SubscriptionRequestType | S | 1 = Subscribe | Char | Si se ha informado ApplID [1180] + ApplSeqNum [1181] en el mensaje Logon, significa que sólo se desean recibir las actualizaciones a partir del momento indicado |
| 264 | MarketDepth | S | 0 = Full Book 1 = Top of Book n = exact depth (n>1) | Int | Profundidad de precios. Ignorado si ninguna de las ocurrencias de MDEntryType es Bid o Offer |
| 265 | MDUpdateType | N | 0 = Full refresh | Int | Requerido si SubscriptionRequestType = 1 |
| 267 | NoMDEntryTypes | S | | NumInGroup | Número de campos MDEntryType que contiene el mensaje |
| | | | 0 = Bid 1 = Offer 2 = Trade (last) 4 = Opening Price 6 = Settlement Price 7 = Trading Session High Price 8 = Trading Session Low Price 9 = Trading session VWAP price B = Trade Volume (total volume for contract in session) C = Open Interest M = Prior Settle Price N = Session High Bid O = Session Low Offer | | |
| → 269 | MDEntryType | S | | Char | Tipo de información solicitada |
| 146 | NoRelatedSym | S | 1 | NumInGroup | Número de criterios de selección |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--------------------|----------------------------|-----|--|------------|---|
| Start <Instrument> | | | | | |
| →55 | Symbol | S | [N/A] | String | Siempre [N/A] |
| →48 | SecurityID | N | Para más detalle sobre los activos subyacentes, véase Tabla 7 en documento "Codification tables" | String | Activo subyacente del contrato |
| →22 | SecurityIDSource | N | 8 = Exchange Symbol | String | Requerido si se ha especificado SecurityID |
| →167 | SecurityType | N | Consultar tabla 6 en documento "Codification tables" | String | Tipo de producto Si no se especifica significa para todos los tipos de contrato |
| →200 | MaturityMonthYear | N | YYYYMM o YYYYMMDD o YYYYMMwW | Month-Year | Vencimiento del contrato |
| End <Instrument> | | | | | |
| 21500* | MoreSubscriptionsFollowing | N | Y (recomendado), N (default) | Boolean | Permite agrupar las peticiones de suscripción relativas a información de mercado. Para más información ver "3.6 - Sincronización a nivel de aplicación" |
| | Standard Trailer | S | | | |

6.5.9 Market Data Request Reject (Msg Type = Y)

Usado por HF MEFFGate para rechazar una solicitud Market Data Request.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|------------------|-----|--|---------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = Y | | |
| 262 | MDReqID | S | | String | Identificador de la solicitud que se está rechazando |
| 281 | MDReqRejReason | N | 0 = Invalid selection criteria 1 = Duplicate MDReqID 4 = Unsupported SubscriptionRequestType 5 = Unsupported MarketDepth 6 = Unsupported MDUpdateType 8 = Unsupported MDEntryType | Char | Motivo de rechazo. Este campo siempre está presente en el mensaje |
| 58 | Text | N | | String | Texto explicativo del motivo de rechazo |
| | Standard Trailer | S | | | |

6.5.10 Market Data Snapshot Full Refresh (Msg Type = W)

Usado por HF MEFFGate para comunicar la información de precios solicitada con un mensaje Market Data Request.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------|---------------------|-----|--|------------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = W | | |
| 1180 | ApplID | N | | String | Conjuntamente con ApplSeqNum [1181] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 1181 | ApplSeqNum | N | | SeqNum | Conjuntamente con ApplID [1180] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 262 | MDReqID | N | | String | Identificador del mensaje Market Data Request al que se está contestando |
| 1500 | MDStreamID | N | | String | En el caso de información sobre respuestas a RFQ , contiene el correspondiente IOIID |
| 1301 | MarketID | N | | Exchange | Operating MIC |
| 1300 | MarketSegmentID | N | | String | Segment MIC |
| | Start <Instrument> | | | | |
| 55 | Symbol | S | Código de contrato | String(22) | Código de contrato |
| 454 | NoSecurityAltID | N | | NumInGroup | |
| → 455 | SecurityAltID | N | | String | <ul style="list-style-type: none"> Si SecurityAltIDSource [456] = 4, contiene el código de contrato ISIN |
| → 456 | SecurityAltIDSource | N | 4 = ISIN number | String | |
| 864 | NoEvents | N | | NumInGroup | Puede estar presente en una operación o en precios de liquidación |
| → 865 | EventType | N | 201 = Tipo de operación retrocedida o modificada (en caso de retrocesión o modificación) | Int | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------|---------|-----|--|---------|---|
| | | | 204 = Número de registro de negociación de la operación retrocedida, modificada o de la operación en la estrategia (para las operaciones en las patas) | | |
| | | | 205 = Precio de la operación en caso de que sea una operación que no marque last | | |
| | | | 206 = Procedencia de la operación | | |
| | | | 211 = Transaction category MMT: <ul style="list-style-type: none"> • Package Trade (excluding Exchange for Physicals) "TPAC" • Exchange for Physicals Trade "XFPH" | | |
| | | | 212 = Pre- and Post-transparency flags | | |
| | | | 213 = Precio Forward actual | | |
| | | | 214 = Precio Forward anterior | | |
| → 867 | EventPx | N | | Price | Informado cuando EventType = 205, 213 ó 214 |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|------------------|-------------|-----|--|------------|--|
| → 868 | EventText | N | | String | <p>Informado cuando EventType [865] = 201, 204, 206, 211, 212</p> <p>Si EventType [865] = 201 los valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> • 0 (para una operación de Mercado), • TrdSubType [829] (para el resto de tipos de operación) <p>Si EventType [865] = 206 los valores son: Para operaciones procedentes de órdenes:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 (operación procedente de mercado abierto), 2 (operación procedente de subasta de apertura), 3 (operación procedente de subasta de cierre), 4 (operación procedente de subasta de volatilidad), 5 (operación procedente de subasta manual) <p>Si EventType [865] = 211: Level 3.1 - Transaction category MMT model. Puede estar presente si MDEntryType es 2:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Z = Package Trade (excluding Exchange for Physicals) "TPAC" • Y = Exchange for Physicals Trade "XFPH" <p>Si EventType [865] = 212: Contiene los pre-transparency and post-transparency flags de la operación de acuerdo con la directiva MiFID II. Los distintos flags van entre comillas y separados por comas. Puede estar presente si MDEntryType es 2</p> |
| End <Instrument> | | | | | |
| 268 | NoMDEntries | S | | NumInGroup | Número de entradas que siguen |
| → 269 | MDEntryType | S | 0 = Bid 1 = Offer 2 = Trade (last) | Char | Tipo de información que contiene la presente entrada. Si están presentes los valores 0 o 1, el mensaje no contiene ninguno de los otros |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------|-----------|-----|---|---------|--|
| | | | 4 = Opening Price | | |
| | | | 6 = Settlement Price | | |
| | | | 7 = Trading Session High Price | | |
| | | | 8 = Trading Session Low Price | | |
| | | | 9 = Trading session VWAP price | | |
| | | | B = Trade Volume (total volume for contract in session) | | |
| | | | C = Open Interest | | |
| | | | E = Estimated buy mid-price (RFQ) | | |
| | | | F = Estimated sell mid-price (RFQ) | | |
| | | | M = Prior Settle Price | | |
| | | | N = Session High Bid | | |
| | | | O = Session Low Offer | | |
| | | | | | Precio. Presente cuando MDEntryType está en (0,1,2,4,6,7,8,9,E,F,M,N,O). |
| → 270 | MDEntryPx | N | | Price | En el caso que no esté presente cuando MDEntryType=2, ver EventPx [867] cuando EventType [865] = 205 |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------------|------------------|-----|--|-------------|--|
| | | | | | En el caso que no esté presente cuando MDEntryType=6 debe entenderse que el precio es 0. |
| | | | | | Si MDEntryType = 0 ó 1 y sólo existen órdenes de mercado: MDEntryPx [270] = 0 (MDEntrySize [271] > 0) Volumen. |
| → 271 | MDEntrySize | N | | Qty | Presente cuando MDEntryType está en (0,1,2,B,C,E,F). Para el valor "C" es el <i>Open Interest</i> al inicio de la sesión. |
| → 273 | MDEntryTime | N | | UTCTimeOnly | Hora de la entrada del Market Data para MDEntryType [269] = 0 (Bid), 1 (Offer), E (Estimated buy mid-price - RFQ), F (Estimated sell mid-price - RFQ) o 6 (Settlement Price) Si MDEntryType [269] = 0 (Bid) ó 1 (Offer), sólo está presente para uno de los valores (MDPriceLevel = 1) y refiere a la actualización de Bid y Offer en general |
| → 2150 7* | RetailCIFlag | N | Y = Al menos una de las ordenes que componen este precio tiene el 'retail client indicator' activo N = En el volumen no interviene ninguna orden con 'retail client indicator' activo (default) | Boolean | Retail Client Indicator. Presente cuando MDEntryType es (0,1) Indica si alguna de las ordenes que componen el precio tiene el 'retail client indicator' activo |
| → 336 | TradingSessionID | N | 100 = Horario futuros IBEX / FX 102 = Aplicaciones (horario futuros IBEX) | String | Modalidad de contratación Presente cuando MDEntryType = 0,1,E,F y también cuando MDEntryType = 2 (Trade) con TrdMatchID [880] informado |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|------------|-----------------------------------|-----|---|---------------------|---|
| | | | 105 = Horario normal | | |
| | | | 106 = Operaciones Bolsa por Delta y Bases | | |
| | | | 107 = Horario Bono | | |
| | | | 108 = Aplicaciones (horario normal) | | |
| | | | 109 = Aplicaciones (horario Bono) | | |
| | | | 115 = RFQ (horario futuros IBEX) | | |
| | | | 116 = RFQ (horario normal) | | |
| | | | 117 = RFQ (horario Bono) | | |
| | | | 118 = RFQ de xRolling | | |
| → 277 | TradeCondition | N | 6 = Benchmark Trade "BENC" | MultipleStringValue | Level 3.5 - Benchmark or Reference Price Indicator indicator MMT model Puede estar presente si MEntryType es 2 |
| | Start <TradePriceConditionGrp> | | | | |
| → 1838 | NoTradePriceConditions | N | | NumInGroup | |
| →→ 1839 | TradePriceCondition | N | 15 = Non-Price Forming Trade (formerly defined as a Technical Trade) "NPFT" | Int | Level 3.8 - Ordinary/Standard Trades or Trades Outside Price Formation / Discovery Process MMT model Puede estar presente si MEntryType es 2 |
| | End | | | | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------|---------------------------|-----|---|---------------------|---|
| | <TradePriceConditionGrp> | | | | |
| → 2667 | AlgorithmicTradeIndicator | N | 0 = No Algorithmic trade 1 = Algorithmic trade "ALGO" | MultipleStringValue | Level 3.9 - Algorithmic Indicator MMT model Puede estar presente si MDEntryType es 2 |
| → 346 | NumberOfOrders | N | | Int | Cuando MDEntryType es 0 ó 1 indica el número de órdenes a ese precio |
| → 1023 | MDPriceLevel | N | | Int | Número de orden de cada bid o offer. Numerado del más al menos competitivo, empezando por 1. Presente si MDEntryType es 0 ó 1 |
| → 1024 | MDOriOriginType | N | 0 = Central Limit Order Book 1 = Off Book (including Voice or Messaging Trading) 3 = Quote Driven Market 4 = Dark Order Book 5 = Periodic Auction 6 = Request for Quotes | Int | Level 1 - Market Mechanism MMT model Puede estar presente si MDEntryType es 2 |
| → 811 | PriceDelta | N | | float | Puede estar presente si MDEntryType = 6 o M |
| → 828 | TrdType | N | Véase tabla 4 en documento "Codification tables" | Int | Tipo de operación. Puede estar presente si MDEntryType es 2. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829] |
| → 829 | TrdSubType | N | Véase tabla 4 en documento "Codification tables" | Int | Puede estar presente si MDEntryType es 2. Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828] |
| → 1934 | RegulatoryReportType | N | 11 = Limited details trade "LMTF" | Char | Level 4.2 - Post-Trade deferral or Enrichment MMT model Puede estar presente si MDEntryType es 2 |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----------|-----------------------|-----|--|---------|--|
| | | | 12 = Daily aggregated trade "DATF" | | |
| | | | 13 = Volume omission trade "VOLO" | | |
| | | | 14 = Four weeks aggregation trade "FWAF" | | |
| | | | 15 = Indefinite aggregation trade "IDAF" | | |
| | | | 16 = Volume omission trade. Eligible for subsequent enrichment in aggregated form "VOLW" | | |
| | | | 17 = Full details of previous LMTF "FULF" | | |
| | | | 18 = Full details of previous DATF "FULA" | | |
| | | | 19 = Full details of previous VOLO "FULV" | | |
| | | | 20 = Full details of previous FWAF "FULJ" | | |
| | | | 21 = Full details of previous VOLW "COAJ" | | |
| → 1390 | TradePublishIndicator | N | 1 = Immediate Publication 2 = Non-Immediate Publication | Int | Level 4.1 - Publication Mode / Post-Trade Deferral Reason MMT model (ver también TrdRegPublicationType [2669] + TrdRegPublicationReason [2670]) Puede estar presente si MEntryType es 2 |
| | Start | | | | |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------------|-----------------------------------|-----|---|----------------|---|
| | <TrdRegPublication Grp> | | | | |
| → 2668 | NoTrdRegPublicatio ns | N | | NumInGrou p | |
| | | | 0 = Pre-trade transparency waiver | | Valor 0: Level 3.5 - Benchmark or Reference Price Indicator indicator MMT model (ver también TrdRegPublicationReason [2670]) |
| →→ 2669 | TrdRegPublicationT ype | N | 1 = Post-trade deferral | Int | Valor 1: Level 4.1 - Publication Mode / Post-Trade Deferral Reason MMT model (ver también TradePublishIndicator [1390] + TrdRegPublicationReason [2670]) |
| | | | 6 = Non- Immediate Publication: Deferral for "Large in Scale" "LRGS" | | Puede estar presente si MDEntryType es 2 |
| →→ 2670 | TrdRegPublicationR eason | N | 7 = Non- Immediate Publication: Deferral for "Illiquid Instrument" (RTS 2 only) "ILQD" | Int | Valores 6, 7 y 8: Level 4.1 - Publication Mode / Post-Trade Deferral Reason MMT model (se corresponden con TradePublishIndicator [1390] = 2 y TrdRegPublicationType [2669] =1) |
| | | | 8 = Non- Immediate Publication: Deferral for "Size Specific" (RTS 2 only) "SIZE" | | Puede estar presente si MDEntryType es 2 |
| | End <TrdRegPublication Grp> | | | | |
| → 1188 * | Volatility | N | | float | Puede estar presente si MDEntryType = 6 o M |
| → 381* | GrossTradeAmt | N | | Amt | Efectivo de la operación. Puede estar presente si MDEntryType es 2 o B |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|------------|-----------------------------|-----|--|--------------|---|
| → 880* | TrdMatchID | N | | String | Número de registro de negociación asignado por los sistemas centrales de MEFF. Puede estar presente cuando MEntryType=2 |
| | Start <TrdRegTimestamps> | | | | Puede estar presente cuando MEntryType=2 |
| → 768* | NoTrdRegTimestamps | N | | NumInGroup | |
| →→ 769* | TrdRegTimestamp | N | | UTCTimestamp | <ul style="list-style-type: none"> • Si TrdRegTimestampType [770] = 1, contiene la fecha y hora de ejecución de la operación • Si TrdRegTimestampType [770] = 11, contiene la fecha y hora de publicación de la operación |
| →→ 770* | TrdRegTimestampType | N | 1 = Execution time 11 = Publicly reported | Int | |
| | End <TrdRegTimestamps> | | | | |
| | Standard Trailer | S | | | |

7 RFQ y Indicación de Interés

7.1 Introducción

La funcionalidad de RFQ permite a los clientes de HF MEFFGate recibir información sobre los RFQ entrados a los sistemas centrales de MEFF

Un cliente sólo recibe información de los RFQ de aquellos contratos para los que ha solicitado información de precios (Offer o Bid) mediante el mensaje Market Data Request

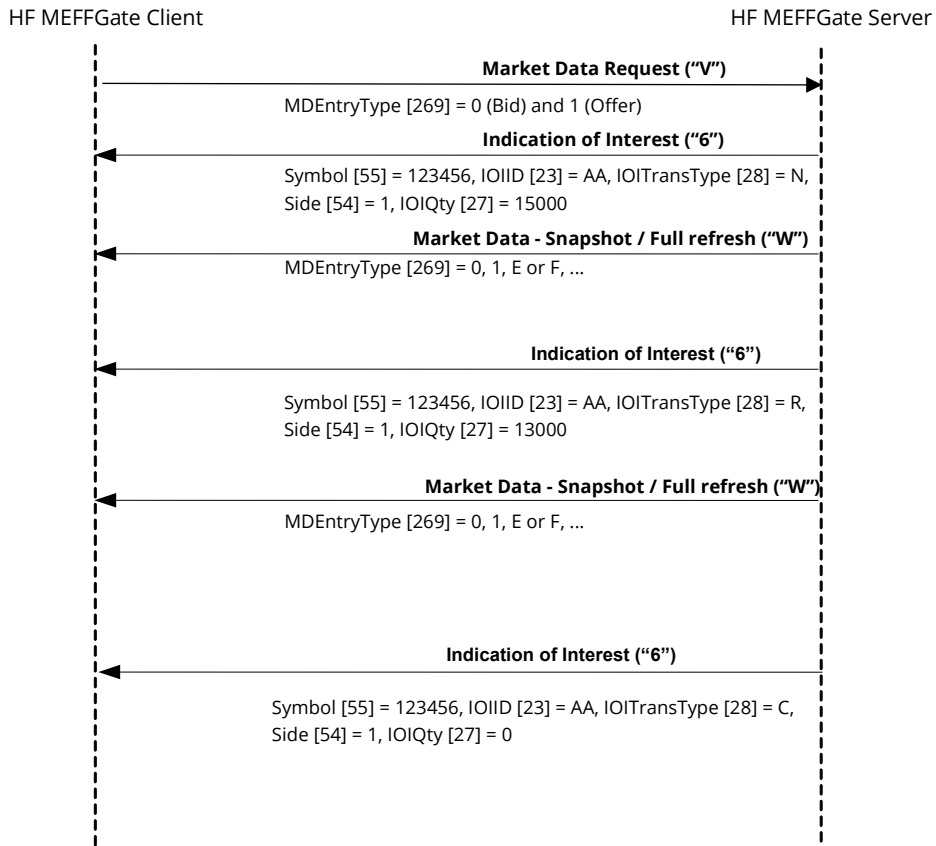
Por otro lado, existe la posibilidad de realizar una Indicación de Interés al mercado con anterioridad a la introducción de órdenes de sentido contrario, con intención de casar una operación previamente acordada. Esta operativa se realizará mediante el mensaje Indication of Interest.

7.2 Lista de mensajes

| Mensaje | Descripción |
|--|--|
| Indication of Interest (Msg Type = 6) | Mensaje enviado por HF MEFFGate para informar de los RFQ sobre un contrato o de las Indicaciones de Interés al mercado |
| Market Data Snapshot Full Refresh (Msg Type = W) | Mensaje enviado por HF MEFFGate para informar de los precios de los RFQ sobre un contrato |

7.3 Flujo de mensajes

Recepción de RFQ / Indicación de Interés al mercado



7.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- Se ha añadido el campo TradingSessionID [336] al mensaje Indication of Interest

7.5 Definición de mensajes

7.5.1 Indication of Interest (Msg Type = 6)

Mensaje enviado por HF MEFFGate para informar de una petición de interés sobre un contrato en concreto.

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------|---------------------|-----|--------------------------------|------------|--|
| | Standard Header | S | MsgType = 6 | | |
| 1180 | ApplID | N | | String | Conjuntamente con ApplSeqNum [1181] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 1181 | ApplSeqNum | N | | SeqNum | Conjuntamente con ApplID [1180] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 23 | IOIid | S | | String | Si el mensaje proviene de un RFQ contendrá el Identificador del mensaje RFQ Si el mensaje proviene de una Indicación de Interés contendrá el Identificador de la suscripción realizada por el usuario |
| | | | N = New | | |
| 28 | IOITransType | S | C = Cancel R = Replace | Char | |
| | Start <Instrument> | | | | |
| 55 | Symbol | S | Código de contrato | String(22) | Código de contrato |
| 454 | NoSecurityAltID | N | | NumInGroup | |
| → 455 | SecurityAltID | N | | String | • Si SecurityAltIDSource [456] = 4, contiene el código ISIN del contrato |
| → 456 | SecurityAltIDSource | N | 4 = ISIN number | String | |
| | End <Instrument> | | | | |
| | | | 1 = Buy | | |
| 54 | Side | S | 2 = Sell 7 = Undisclosed | Char | |
| 27 | IOIQty | S | | String | Volumen por el que se solicita el RFQ |
| 44 | Price | N | | Price | Precio por el que se solicita el RFQ |
| 25 | IOIQtyInd | N | H = High (Solicitud de RFQ) | Char | Tipo de solicitud |

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|------|------------------|-----|-------------------------------------|--------------|--|
| | | | M = Medium (Petición de interés) | | El valor "H" indica que se ha solicitado el RFQ a través de la nuevas modalidades 115, 116, 117 ó 118 de RFQ, para respuestas dirigidas al solicitante. El valor "M" indica que el RFQ solicita cotizaciones en el libro, abiertas a todos los participantes en el mercado. |
| 60 | TransactTime | N | | UTCTimeStamp | Hora del suceso |
| | | | 100 = Horario futuros IBEX / FX | | |
| | | | 105 = Horario normal | | |
| | | | 107 = Horario Bono | | |
| 336* | TradingSessionID | N | 115 = RFQ (horario futuros IBEX) | String | Modalidad de contratación |
| | | | 116 = RFQ (horario normal) | | |
| | | | 117 = RFQ (horario Bono) | | |
| | | | 118 = RFQ de xRolling | | |
| | Standard Trailer | S | | | |

8 Comunicación de Eventos

8.1 Introducción

El mensaje News es utilizado para recibir información del Supervisor de Mercado.

La información recibida es un texto de formato libre.

8.2 Lista de mensajes

| Mensaje | Descripción |
|---------------------|--|
| News (Msg Type = B) | Usado para recibir mensajes de texto del supervisor de mercado |

8.3 Flujo de mensajes

Recepción de mensaje



8.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

No se han realizado acotaciones ni adaptaciones en los mensajes incluidos en este capítulo

8.5 Definición de mensajes

8.5.1 News (Msg Type = B)

| Tag | Nombre | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|------|------------------|-----|---|--------------|---|
| | Standard Header | S | MsgType = B | | |
| 1180 | ApplID | N | | String | Conjuntamente con ApplSeqNum [1181] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 1181 | ApplSeqNum | N | | SeqNum | Conjuntamente con ApplID [1180] se utiliza para indicar, en posteriores conexiones, el punto a partir del que se desea recibir la información |
| 42 | OrigTime | N | | UTCTimeStamp | Hora del suceso |
| 61 | Urgency | N | 0 = Normal 1 = Flash 2 = Background | Char | El valor por defecto es 0 |
| 148 | Headline | S | | String | Encabezado del mensaje. Ignorado por HF MEFFGate |
| 33 | LinesOfText | S | 1 | NumInGroup | Número de líneas del texto. Sólo se permite una línea |
| →58 | Text | S | | String(78) | Una línea de texto |
| | Standard Trailer | S | | | |

Apéndice A Campos de Usuario

En la siguiente tabla se presentan los campos de usuario usados en los mensajes de este manual.

| Tag | Nombre | Formato | Descripción |
|-------|----------------------------|--------------|---|
| 21500 | MoreSubscriptionsFollowing | Boolean | <p>Permite agrupar las peticiones de suscripción relativas a información de mercado.</p> <p>Para más información ver “3.6 - Sincronización a nivel de aplicación”</p> |
| 21501 | LocalMktTimestamp | String | <p>Indica en qué formato se desea recibir las horas:</p> <p>Y – Se divulga la hora oficial del mercado (con una resolución máxima de microsegundos)</p> <p>N – Se divulga la hora en formato UTC, de acuerdo con el estándar FIX (con una resolución máxima de microsegundos)</p> <p>Para más información ver 4.5</p> |
| 21505 | BusinessSessionDate | LocalMktDate | Fecha de la sesión de Negocio actual |
| 21507 | RetailCIFlag | Boolean | Indica si alguna de las ordenes que componen el precio tiene el ‘retail client indicator’ activo |



Plaza de la Lealtad,1
Palacio de la Bolsa
28014 Madrid
www.bolsasymercados.es

