

CONNEQTOR
FIX接続仕様書
(データフォーマット編)



1. 1版

2021年5月 開示

2021年8月適用

株式会社 東京証券取引所

使用許諾条件

本接続仕様書のご利用に当たっては、必ず以下の項目をお読みいただき、以下の使用許諾条件に同意いただくことを条件とします。

(著作権等)

本接続仕様書の各種情報等(以下「技術情報等」という。)に関する著作権等の一切の権利は、東証に帰属します。

(禁止事項)

有償、無償を問わず第三者に対して、使用許諾、譲渡、転売、貸与又は媒体の如何にかかわらず本接続仕様書及び技術情報等の外部への提供若しくは印刷物の出版を禁じます。

(免責)

東証は、本接続仕様書の誤謬、省略若しくは欠落等に起因する損害等、直接又は間接を問わず技術情報等を利用したこと、又は利用できなかったことにより利用者及び利用者の顧客等に生じた一切の損害について、損害賠償責任を負わないものとします。

東証は、東証の故意又は重過失による場合を除き、本サービスの利用に起因しその他本書に関連して利用者及び利用者の顧客等に生じた損害につき、一切の法的責任を負いません。

東証は、東証の予見の有無を問わず特別の事情から利用者及び利用者の顧客等に生じた損害、及び利用者及び利用者の顧客等に生じた逸失利益については、賠償責任を負いません。

利用者等の損害賠償請求権は、損害発生の日から12ヶ月以内に行使しなければ消滅するものとします。

(違反)

利用者が使用許諾条件のいずれかの項目に違反した場合、利用者は東証の指示に異議なく従うものとします。

(その他)

東証は、本接続仕様書に記載した内容について、明示又は黙示の如何を問わずその無誤謬性を一切保証しません。

変更履歴

項番	作成／変更年月	版数	修正ページ	変更概要
1	2020年5月	ドラフト 5月版	-	発行
2	2020年7月	ドラフト 7月版	全般	FIXの対応バージョンを4.4から4.2に変更
3	2020年7月	ドラフト 7月版	全般	記載追加及び改善
4	2020年8月	ドラフト 8月版	別紙3	注文承認拒否通知及び注文エラー通知の統合 8060 タグを廃止 その他 FIX 仕様に合わせた記載修正
5	2020年10月	ドラフト 10月版	別紙1、別紙 3、付録1	注文受付通知、注文承認拒否通知及び注文エラー通知、注文取消エラー通知、注文取消結果通知、及び、注文失効通知における8026 タグを任意項目化 参加者システムからCONNECTORへの電文におけるSenderCompIDを任意の値に変更 注文入力電文、取消注文入力電文及びその他／データ種別エラー通知に8100 (RFQID) タグを追加 5桁コードに対応しないことを記載 その他、誤記修正
6	2021年1月	1.0版	別紙3	約定通知電文におけるSecondaryOrdIDの値を任意の値に変更
7	2021年5月	1.1版	DF編2.2 別紙3	Tag追加に伴うデータ型の追加 注文入力電文にTag15、Tag100、Tag8101を追加

目 次

1. 本仕様書の表記について	1
2. 電文構成	2
2. 1 メッセージの概要	2
2. 2 データ型	2
2. 3 メッセージチェック	3
2. 4 標準メッセージヘッダ/トレーラ	3
3. 管理メッセージ	4
4. アプリケーションメッセージ	5

別紙1 標準メッセージヘッダ/トレーラフォーマット

別紙2 管理メッセージフォーマット

別紙3 アプリケーションメッセージフォーマット

付録1 銘柄コード

付録2 理由コード一覧

付録3 取消変更結果コード一覧

付録4 失効理由コード一覧

1. 本仕様書の表記について

①項目の内容における‘△’はキャラクターコードのスペースを示す。

②FIX タグの必須属性について、以下のように記述する。

◎:FIX メッセージとして必須

○:FIX メッセージとして非必須であるが CONNEQTOR として必須

□:条件により必須

③各種取引における値段の設定／出力方法

値段の設定／出力は ZZZZZZ9.9999 形式である。具体的には、以下のようになる。

CONNEQTOR でのマッチング値段	値段の出力方法
100 円	100.0000
100.5 円	100.5000
100.05 円	100.0500

④フィールドに設定する数値に関しては特に規定がない場合は 2.2 データ型の定義に従って設定する。

例)①Int 型のフィールド定義に数値範囲を0～100と指定されている場合、0は | 0 | となり、100は | 100 | となる。

②char 型のフィールド定義に△△1～100と指定されている場合、△△1は | △△1 | となり、100は | 100 | となる。

⑤ダミー値の扱いについて

表中に“(ダミー値)”として記載されている指定値に関しては、指定項目個々のフォーマット／範囲のチェックを行なうが、項目間の関連性チェックは行なわない。

⑥各メッセージの Standard Header の説明欄について

各メッセージの Standard Header の説明欄には、当メッセージの TAG35:MsgType と当メッセージで使用する「2.4 標準メッセージヘッダ」の”条件により必須”扱いのタグについて記述する。

⑦各取引における注文数量設定

1 株単位で設定する。(例:1,000 株の発注を行う場合、Tag38 には 1000 を設定する。)

2. 電文構成

2.1 メッセージの概要

FIX メッセージのフォーマットは、以下のように標準ヘッダ部に続くボディ部と、それに続く標準トレーラ部で構成される。

標準ヘッダ	ボディ部	標準トレーラ
-------	------	--------

- 各メッセージは、タグ番号とデータ値の組み合わせによる形式(タグ番号=値)で表記されたフィールドの組み合わせで構成され、各フィールドは ASCII コードの区切り文字<SOH>(#001)で終了する。
例えば、8=FIX.4.2<SOH>9=60<SOH>35=A<SOH>…(中略)<SOH>10=027<SOH> の様に、“8=FIX.4.2”で始められ、“10=nnn<SOH>”で終了する。
- 下記のタグについては、無効なタグとして読み捨てる。
CONNEQTOR の各メッセージで定義されているタグ以外のタグ
ボディ部、もしくは標準トレーラ部に存在する標準ヘッダ部のタグ
標準トレーラ部に存在するボディ部のタグ

●メッセージの完全性保証

通信でやり取りされるメッセージの完全性は、BodyLength(Tag=9)によるレコード長の検査と CheckSum(Tag=10)によるチェックサムの検査で確認する。完全性が保証されないメッセージを検知した場合、無効メッセージとしてメッセージを破棄する。

2.2 データ型

データ型とは、タグ単位に指定する値の型である。使用するデータ型を以下に示す。

データ型	定義
Int	整数値(ASCII 文字の“-”及び“0”から“9”) “-”は、負符号を意味するものであり、値の先頭に位置する場合のみ有効。 例. フィールド 21 の 723 は、 21=723 となる。 フィールド 21 の-723 は、 21=-723 となる。
Float	小数値(ASCII 文字の“-”、“.”及び“0”から“9”) 小数点“.”を含まないものは、整数値を float 型で表現したものとす。最大文字数は、15 文字である。
Qty	数量を表す Float 型値。
Price	値段を表す Float 型値。
Char	英数字(区切り文字<SOH>以外の全ての ASCII コードが使用可能、大文字小文字の区別あり<text≠Text>)
Boolean	論理値を表す Char 型値。 'Y' = True/Yes 'N' = False/No
String	英数字フリーフォーマット文字列(0x20~0x7E の範囲の ASCII コードが使用可能、大文字小文字の区別あり<morstatt≠Morstatt>)

データ型	定義
UTCTimestamp	YYYYMMDD-HH:MM:SS(秒単位)または YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss(ミリ秒単位) フォーマットで表現した UTC (Universal Time Coordinated, also known as “GMT”)値。コロン、ハイフン、ピリオドが必要。 有効値範囲: ・YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31, HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-60 (60 only if UTC leap second) (without milliseconds). ・YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31, HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-60 (60 only if UTC leap second), sss=000-999 (indicating milliseconds)
Exchange	取引所を示す文字列コード。 'T' = Tokyo Stock Exchange
Currency	ISO 4217 の通貨コード。 'JPY' = 円

2.3 メッセージチェック

メッセージデータが完全である(FIX メッセージとして認めることができる)メッセージに対して、FIX プロトコル仕様(Ver4.2Errata)の規定に基づき、メッセージの形式チェックを行う。チェック項目は以下の通りである。

- ー必須フィールドの存在有無 (FIX プロトコルとして必須のタグ)
- ー条件付必須フィールドの存在有無 (FIX プロトコルとして必須のタグ)
- ーフィールドの型とデータが適合していること
- ーフィールドの設定値がプロトコルで定められた有効値の範囲内であること

これらの規定に従っていないメッセージを受信した場合、相手システムに Reject を送信して、メッセージにフォーマットエラーがあったことを通知する。

2.4 標準メッセージヘッダ/トレーラ

「別紙1 標準メッセージヘッダ/トレーラフォーマット」に記載する。

3. 管理メッセージ

「別紙 2 管理メッセージフォーマット」に記載する。

4. アプリケーションメッセージ

「別紙 3 アプリケーションメッセージフォーマット」に記載する。

CONNEQTOR
F I X 接続仕様書
(データフォーマット編)

発 行 : 株式会社 東京証券取引所
東京都中央区日本橋兜町 2 番 1 号 〒103-8220
M A I L : ask-conneqtor@jpx.co.jp