

# Анализ времени прохождения заявок: спецификация (валютный рынок)

## Пример продукта

CASE	TIME	TICKER	DIR	ORDERNO	ACTION	PRICE	VOLUME	DSTIP	D1	D2	IS_CLIENT
1	10:00:01.000.000	USD_TOM	B	2	1	65.5400	1 000 000	91...	0	0	0
1	10:00:01.000.000	USD_TOM	S	1	2	65.5400	1 000 000	91...	0	0	0
1	10:00:01.000.000	USD_TOM	B	2	2	65.5400	1 000 000	91...	0	0	0
1	10:00:01.000.030	USD_TOM	B	3	1	65.5400	1 000 000	91...	+30	+2	10.0.0.0
1	10:00:01.000.050	USD_TOM	B	4	1	65.5400	1 000 000	91...	+50	+4	0

## Событие

В стакане стоит пассивная заявка

**Клиент отправляет заявку А (action=1)** – строка 1 в таблице выше

Данная заявка ударяется о пассивную заявку и происходит **инициация сделки (action=2)** – строки 2 и 3

СОБЫТИЕ возникает, если в **интервале времени 250 мкс** зафиксирована **минимум еще одна заявка** – строка 4

Завершение СОБЫТИЯ: по истечении **интервала времени 750 мкс**

## Описание полей

**CASE** номер кейса

**TIME** время торгового ядра в формате HHMMSSZZZZZZ

HH – часы  
MM – минуты  
SS – секунды  
ZZZZZZ – микросекунды

**TICKER** код инструмента

**DIR** тип заявки – BUY / SELL

**ORDERNO** номер заявки

**ACTION**  
1 – постановка заявки  
2 – сделка  
3 – снятие заявки

**PRICE** цена

**VOLUME** объем в единицах инструмента

**DSTIP** Gateway IP

**D1** время ядра относительно заявки А

**D2** время solo, относительно заявки А

**IS\_CLIENT**  
0 – заявки других участников  
IP адрес, откуда отправлена заявка  
– собственные заявки клиента

