

Release 02

QSAM Systemanschluss Makler

XONTRO VALUES API
Planing Version

Stand: 05.11.2020

Version 02.01

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 2
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung	6
2	XONTRO QSAM VALUES API.....	8
2.1	XONTRO QSAM Nachrichten	8
2.1.1	XONTRO QSAM Header	10
2.1.1.1	XONTRO QSAM Request Header	10
2.1.1.2	XONTRO QSAM Response Header.....	11
2.1.1.3	XONTRO QSAM Broadcast Header.....	12
2.1.2	Berechtigungskonzept	13
2.1.3	Behandlung von Mehrfachübertragungen und alten Nachrichten	14
2.1.4	Anmeldung / Abmeldung und Passwortwechsel	15
2.1.4.1	XONTRO Login.....	16
2.1.4.2	XONTRO Logout	18
2.1.4.3	XONTRO Change Password.....	19
2.1.5	Orderverwaltung Front End für skontroführende Makler	20
2.1.5.1	XONTRO Enter Order SKM.....	21
2.1.5.2	XONTRO Modify Order SKM.....	24
2.1.5.3	XONTRO Delete Order SKM.....	26
2.1.6	Orderverwaltung Front End für Freimakler	28
2.1.6.1	XONTRO Enter Order FM	29
2.1.6.2	XONTRO Modify Order FM	32
2.1.6.3	XONTRO Delete Order FM	34
2.1.7	Kurseingabe Front End für skontroführende Makler	36
2.1.7.1	XONTRO Start Pricing.....	38
2.1.7.2	XONTRO Enter Price	40
2.1.7.3	XONTRO Cancel Pricing	42
2.1.7.4	XONTRO Enter Price Plus	43
2.1.7.5	XONTRO Enter Block Price.....	46
2.1.8	Nachbearbeitung Front End für skontroführende Makler	48
2.1.8.1	XONTRO Add Position	49
2.1.8.2	XONTRO Modify Execution.....	51
2.1.8.3	XONTRO Finish Pricing.....	53
2.1.9	Kursaussetzung und Nebenrechte vom Front End	55
2.1.9.1	XONTRO Deactivate Pricing	57
2.1.9.2	XONTRO Deactivate Pricing Block	59
2.1.9.3	XONTRO Reactivate Pricing	61
2.1.9.4	XONTRO Reactivate Pricing Block	62
2.1.9.5	XONTRO Enter Special Right	64
2.1.10	Bestandsinformationen Orders.....	66
2.1.10.1	XONTRO Inquire Orders	67
2.1.10.2	XONTRO Inquire Special Order Updates.....	69
2.1.11	Aktualisierung des Orderbestands, der Kursinformation und der Quotes.....	70
2.1.11.1	XONTRO Order Update	71
2.1.11.1.1	Ordereinstellung für einen Skontroführer (via Back End).....	74
2.1.11.1.2	Ordereinstellung für einen Freimakler (via Back End).....	76

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 3
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.11.1.3	Ordereinstellung für einen Skontrofürer während Sperre (via Back End)	78
2.1.11.1.4	Endgültige Ablehnung einer Ordereinstellung während Sperre für einen Skontrofürer (via Back End)	80
2.1.11.1.5	Nach einer Sperre erfolgreiche Ordereinstellung für einen Freimakler (via Front End) ...	81
2.1.11.1.6	Sofort erfolgreiche Ordereinstellung des Front Ends eines Freimakler (via Front End) ..	82
2.1.11.1.7	Abgelehnte Ordereinstellung für einen Freimakler (via Front End)	83
2.1.11.1.8	Ordereinstellung für einen Skontrofürer (via Front End)	84
2.1.11.1.9	Orderänderung (via Back End)	85
2.1.11.1.10	Umsetzung einer Stop Order durch das Back End	86
2.1.11.1.11	Vorläufige Änderung einer Order des Skontrofürers (via Back End)	87
2.1.11.1.12	Endgültige Annahme einer Orderänderung für den Skontrofürer (via Back End)	89
2.1.11.1.13	Nach einer Sperre erfolgreiche Änderung der Order eines Freimaklers (via Front End) .	90
2.1.11.1.14	Sofort erfolgreiche Änderung der Order eines Freimaklers (via Front End)	91
2.1.11.1.15	Abgelehnte Orderänderung der Order eines Freimaklers (via Front End)	92
2.1.11.1.16	Änderung einer Order des Skontrofürers (via Front End)	94
2.1.11.1.17	Orderlöschung (via Back End)	95
2.1.11.1.18	Vorläufige Löschung einer Order des Skontrofürers (via Back End)	96
2.1.11.1.19	Endgültige Annahme einer Orderlöschung des Skontrofürers (via Back End)	97
2.1.11.1.20	Nach einer Sperre erfolgreiche Löschung der Order eines Freimaklers (via Front End) .	98
2.1.11.1.21	Sofort erfolgreiche Löschung der Order eines Freimaklers (via Front End)	99
2.1.11.1.22	Abgelehnte Orderlöschung der Order eines Freimaklers (via Front End)	100
2.1.11.1.23	Löschung einer Order des Skontrofürers (via Front End)	102
2.1.11.1.24	Orderänderung wegen Nebenrecht	103
2.1.11.1.25	Orderlöschung wegen Nebenrecht	104
2.1.11.1.26	Sperren durch das Back End	105
2.1.11.1.27	Sperren durch das Front End	106
2.1.11.1.28	Entsperren durch das Back End	107
2.1.11.1.29	Entsperren durch das Front End	108
2.1.11.1.30	Kursfeststellung am Back End	109
2.1.11.1.31	Kursfeststellung am Front End (XONTRO Enter Price)	111
2.1.11.1.32	Kursfeststellung am Front End (XONTRO Enter Price Plus)	112
2.1.11.1.33	Eingabe halbes Geschäft am Back End	114
2.1.11.1.34	Eingabe halbes Geschäft am Front End	115
2.1.11.1.35	Teilausführung am Back End	116
2.1.11.1.36	Teilausführung am Front End	117
2.1.11.1.37	Ende Nachbearbeitung am Back End	118
2.1.11.1.38	Ende Nachbearbeitung am Front End	119
2.1.11.1.39	Eingabe von Quotes am Back End	120
2.1.11.1.40	Deaktivierung von Quotes am Back End	121
2.1.11.1.41	Tabellarische Kursfeststellung	122
2.1.11.1.42	Tabellarische Kursänderung	123
2.1.11.1.43	Umsatzlose Kurseingabe über das Front End	124
2.1.11.1.44	Kurseingabe manuell	126
2.1.11.1.45	Kursänderung manuell	127
2.1.11.1.46	Eingabe von Quotes am Front End	129
2.1.11.1.47	Deaktivierung von Quotes am Front End	130
2.1.11.2	XONTRO Order Update Retransmission	131
2.1.11.2.1	XONTRO Request Update Retransmission	132
2.1.12	Aktualisierung der Orderausführungen	135
2.1.12.1	XONTRO Execution Confirmation Update	136
2.1.12.1.1	Ausführungsbestätigungen	137
2.1.12.1.2	Abschluss der Ausführungen	138
2.1.12.2	XONTRO Execution Confirmation Retransmission	139

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 4
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.12.2.1	XONTRO Request Execution Confirmation Retransmission	140
2.1.13	Quoteverwaltung Front End für skontroführende Makler	142
2.1.13.1	XONTRO Enter Quote	143
2.1.13.2	XONTRO Enter Mass Quote	146
2.1.14	Aufgabenverwaltung Front End	149
2.1.14.1	XONTRO Enter Broker Trade.....	151
2.1.14.2	XONTRO Delete Broker Trade	153
2.1.14.3	XONTRO Match Broker Trade	155
2.1.14.4	XONTRO Match All Broker Trades.....	157
2.1.15	Bestandsinformationen Aufgaben	159
2.1.15.1	XONTRO Inquire Broker Trades	160
2.1.16	Aktualisierung des Aufgabenbestands	164
2.1.16.1	XONTRO Broker Trade Update.....	165
2.1.16.1.1	Erzeugung einer temporären Aufgabe	166
2.1.16.1.2	Änderung einer temporären Aufgabe	167
2.1.16.1.3	Löschung einer temporären Aufgabe	168
2.1.16.1.4	Erzeugung einer Aufgabe am Back End	169
2.1.16.1.5	Erzeugung einer neuen Aufgabe am Front End.....	172
2.1.16.1.6	Löschung einer Aufgabe am Back End	175
2.1.16.1.7	Stornierung einer Aufgabe am Back End	176
2.1.16.1.8	Löschung einer Aufgabe am Front End.....	177
2.1.16.1.9	Stornierung einer Aufgabe am Front End.....	178
2.1.16.1.10	Schließung von Aufgaben am Back End.....	179
2.1.16.1.11	Schließung von Aufgaben am Front End	180
2.1.16.1.12	Änderung einer Aufgabe am Back End	181
2.1.16.2	XONTRO Request Broker Trade Update Retransmission	182
2.1.17	Informationen zum Handel unter Maklern (HUM).....	184
2.1.17.1	XONTRO Broker Trade Update (HUM)	185
2.1.17.2	XONTRO Request Broker Trade Update Retransmission (HUM)	187
2.1.18	Geschäftseingabe über das Front End (allgemein).....	189
2.1.18.1	XONTRO Enter Single Trade	190
2.1.19	Geschäftseingabe über das Front End (MAX-ONE)	192
2.1.19.1	XONTRO Enter Exchange Trade	194
2.1.19.2	XONTRO Enter Exchange Trade Reference	197
2.1.20	Stornierung von Aufgaben und Geschäften über das Front End	199
2.1.20.1	XONTRO Cancel Trade.....	200
2.1.21	Aktualisierung der Eigengeschäfte und des Maklertagebuchbestands.....	202
2.1.21.1	XONTRO Own Trade Update	203
2.1.21.2	Erzeugung eines Eigengeschäfts	204
2.1.21.3	Erzeugung eines Geschäftsvorfalles im Maklertagebuch	205
2.1.21.4	XONTRO Request Own Trade Update Retransmission	206
2.1.22	Bestandsinformationen Maklertagebuch	209
2.1.22.1	XONTRO Inquire Broker Diary	210
2.1.23	Supportfunktionen zur Behandlung von Mistrades.....	214
2.1.23.1	XONTRO Reset Price.....	216
2.1.23.2	XONTRO Reset Price Info.....	218
2.1.23.3	XONTRO Subscribe Private Status News.....	220

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 5
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.23.3.1	Kursanullierung/Kursänderung	221
2.1.23.3.2	Orderinformation für den skontroführenden Makler	222
2.1.23.3.3	Orderinformation für den Freimakler	223
2.1.23.4	XONTRO Request Private Status News Retransmission	224
2.1.24	Bestandsinformationen Nebenrechte	226
2.1.24.1	XONTRO Inquire Special Rights	227
2.1.25	Bestandsinformationen Stammdaten	228
2.1.25.1	XONTRO Inquire Skontro Data	229
2.1.25.2	XONTRO Inquire Skontro ISIN	231
2.1.26	Administration	232
2.1.26.1	XONTRO System Status News	233
2.1.26.2	XONTRO Request System Status News Retransmission.....	236
2.1.26.3	XONTRO Private Status News.....	239
2.1.26.3.1	Standardnachrichten (Format 1).....	239
2.1.26.3.2	Versand fehlgeschlagener Broadcasts (Format 2).....	241
2.1.26.4	XONTRO Request Private Status News Retransmission	243
2.2	Programmierhinweise	245
2.2.1	Behandlung von Inquire-Streams	245
2.2.2	Synchronisation von Quotes.....	246
2.2.3	Blockierung von Applikation mit hohem Fehlerrisiko	247
2.2.4	Programmierhinweise für MAX-ONE.....	248
3	Anhang	250
3.1	Datenformate und Initialwerte.....	250
3.2	Feldbeschreibung	251
3.3	Übersicht Feldbezeichner	284
3.4	Completion Codes	287
3.5	Xontro Values API Header und Completion Codes.....	288

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 6
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

1 Einleitung

Das **XONTRO QSAM VALUES API** stellt dem Anwendungsentwickler eine standardisierte Programmierschnittstelle für die Applikation XONTRO zur Verfügung. Das API beschreibt die Kommunikation mit dem Xontro Back End unter direkter Verwendung des MQ Layers.

Das Dokument „**XONTRO QSAM Technical Description**“ beschreibt die Implementierungsmöglichkeiten und Referenzierungsmöglichkeiten mittels MQ-Layers.

Die API-Dokumentation ist in folgende Abschnitte gegliedert:

- QSAM Header
- Berechtigungskonzept
- Behandlung von Mehrfachübertragungen und alten Nachrichten
- Anmeldung / Abmeldung und Passwortwechsel
- Orderverwaltung Front End für skontroführende Makler
- Orderverwaltung Front End für Freimakler
- Kurseingabe Front End für skontroführende Makler
- Nachbearbeitung Front End für skontroführende Makler
- Kursaussetzung und Nebenrechte vom Front End
- Bestandsinformationen Orders
- Aktualisierung des Orderbestands, der Kursinformation und der Quotes
- Aktualisierung der Orderausführungen
- Quoteverwaltung Front End für skontroführende Makler
- Aufgabenverwaltung Front End
- Bestandsinformationen Aufgaben
- Aktualisierung des Aufgabenbestands
- Informationen zum Handel unter Maklern (HUM)
- Geschäftseingabe über das Front End (allgemein)
- Geschäftseingabe über das Front End (MAX-ONE)
- Stornierung von Aufgaben und Geschäften über das Front End
- Aktualisierung der Eigengeschäfte und des Maklertagebuchbestandes
- Bestandsinformationen Maklertagebuch
- Supportfunktionen zur Behandlung von Mistrades
- Bestandsinformationen Nebenrechte
- Bestandsinformationen Stammdaten
- Administration
- Ein Anhang mit ausführlichen Feldbeschreibungen, Completion Codes und weiteren allgemeinen Informationen

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 7
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Der erste inhaltliche Abschnitt beschreibt das Konzept, nach welchem der Zugang zu den angebotenen Aufrufen geregelt wird.

Der zweite inhaltliche Abschnitt beschreibt das Systemverhalten in Situationen, in denen identische Dateninhalte mehrfach vom Front End an das Back End übertragen werden müssen.

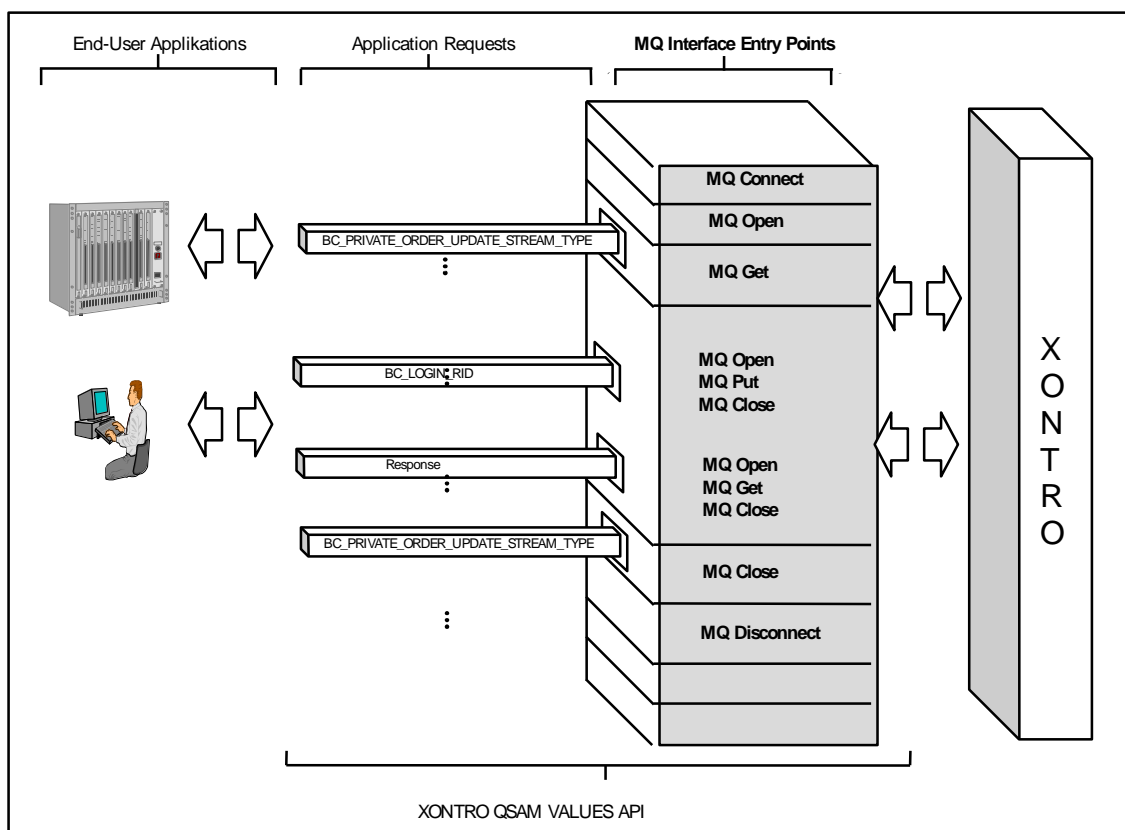
Die folgenden inhaltlichen Abschnitte folgen einem einheitlichen Aufbau:

Zunächst werden alle Requests im Überblick dargestellt, dann wird jeder Einzelrequest nach einem einheitlichen Schema

Request ID, Request Data, Response Data

beschrieben.

Dabei bestehen folgende Zusammenhänge zwischen API, MQ Layer und dem XONTRO Back End:



Ein Request wird vom MQ Interface mittels MQPut entgegengenommen und an das XONTRO Back End übermittelt. Da sämtliche Requests asynchron verarbeitet werden, muss die Antwort vom MQ Interface mittels MQGet wieder entgegengenommen werden. Die Referenzierung von Nachrichten und Streams ist durch Auswertung der Headerfelder oder mittels Message-Id und Corellation-Id möglich. Weitere Informationen können dem Dokument **QSAM Technical Description** entnommen werden.

Broadcast-Nachrichten und Bestandsnachrichten werden vom XONTRO Back End auf den Server des Teilnehmers übermittelt, auch wenn der Teilnehmer noch nicht angemeldet ist.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 8
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2 XONTRO QSAM VALUES API

2.1 XONTRO QSAM Nachrichten

Die Begriffe "Skontroführender Makler" (skm) und "Freimakler" (fm) sind als Funktionen zu verstehen: Dies heißt also nicht, dass eine Maklerfirma oder eine KV-Nummer ausschließlich als Freimakler oder als skontroführender Makler agieren kann. Falls eine KV-Nummer am Börsenplatz als skontroführender Makler für eine ISIN eingetragen ist, werden allerdings alle in dieser ISIN an sie gerichteten Orders als Orders an einen skontroführenden Makler behandelt.

Ist im Folgenden ein Feld mit einem hochgestellten ^m gekennzeichnet, dann muss es belegt sein (mandatory), ist es mit einem hochgestellten ^o gekennzeichnet, dann ist eine Belegung nicht zwingend erforderlich (optional), ein hochgestelltes ^{*} kennzeichnet ein Feld, das innerhalb der Struktur mehrfach vorkommt, ein hochgestelltes ^r (reserved) kennzeichnet ein Feld, das für zukünftige Erweiterungen vorgesehen ist.

Um die Anzahl der Nachkommastellen direkt aus der Feldbeschreibung entnehmen zu können, werden die Feldformate wie folgt ergänzt:

Ein Format **num[8,3]** beschreibt ein numerisches Feld der Gesamtlänge 8 mit drei Nachkommastellen.

Sind Nachkommastellen nicht möglich, dann kann für ein Feld der Gesamtlänge 6 ohne Nachkommastellen alternativ zu **num[6,0]** auch die Bezeichnung **num[6]** verwendet werden.

Ein Format **Snum[11,5]** beschreibt ein numerisches Feld mit Vorzeichen der Gesamtlänge 11 mit fünf Vorkomma- und fünf Nachkommastellen.

Sind Nachkommastellen nicht möglich, dann kann für ein Feld der Gesamtlänge 9 ohne Nachkommastellen alternativ zu **Snum[9,0]** auch die Bezeichnung **Snum[9]** verwendet werden.

Zu beachten ist bei einem Format **Snum[n,m]**, dass n die reale Feldlänge beschreibt. Ein Feld des Formats **Snum[12,3]** kann also 11 Ziffern aufnehmen.

Das Format **char[7]** beschreibt unverändert ein alphanumerisches Feld der Länge 7, in welchem beliebige druckbare Zeichen enthalten sein können.

Nicht belegte Feldteile werden bei

- **num[n,m]** Feldern mit führenden Nullen belegt.
- **Snum[n,m]** Feldern mit führenden Nullen belegt, in die erste Stelle ist + oder – einzutragen
- **char[n]** Feldern mit nachfolgenden Spaces belegt (linksbündige Ausrichtung).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 9
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Es sei darauf hingewiesen, dass alle XONTRO QSAM Nachrichten zusätzlichen Standardisierungen hinsichtlich der Aufrufformate folgen. Alle Formate beginnen mit einem Standardteil, im Folgenden als Header bezeichnet. Es existieren:

- QSAM Request Header + Request Header
- QSAM Response Header + Response Header
- QSAM Broadcast Header + Broadcast Header

Die Header werden im Zusammenhang mit den einzelnen Requests, Responses und Broadcasts auf Feldebene dargestellt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 10
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.1 XONTRO QSAM Header

2.1.1.1 XONTRO QSAM Request Header

Beschreibung Alle Felder des QSAM Request Header sind Pflichtfelder und von der Teilnehmerapplikation zu belegen.

Im Feld `qsamId` ist die 4-stellige numerische QSAM Server-Identifikation zu belegen. Die Nummer wird von BrainTrade bereitgestellt (analog MISS-Id). Bei ungültiger `qsamId` wird der Request mit Completion Code 29220 „UNGUELTIGE QSAM-IDENTIFIKATION“ abgelehnt.

Stimmt die `qsamId` im QSAM Request-Header nicht mit der `qsamId` der Queue-Definition überein, wird der Request mit Completion Code 19020 „QSAM-ID IN HEADER UND QUEUE-DEF STIMMEN NICHT UEBEREIN“ abgelehnt.

Im Feld `qsamMsgType` ist bei Request-Nachrichten die Ausprägung „Q“ zu belegen. Bei ungültigem `qsamMsgType` wird der Request mit Completion Code 21950 „UNGUELTIGER NACHRICHTENTYP“ abgelehnt.

Im Feld `qsamRequestId` ist eine 3-stellig numerische Request-Identifikation zu belegen (siehe `bclayouts_qsam.h`). Bei ungültiger `qsamRequestId` wird der Request mit Completion Code 29210 „UNGUELTIGE REQUEST-IDENTIFIKATION“ abgelehnt.

Im Feld `qsamExchangeld` ist ein gültiger 3-stelliger numerischer Börsenplatz zu belegen. Bei ungültiger `qsamRequestId` wird der Request mit Completion Code 20290 „BOERSENPLATZ UNGUELTIG“ abgelehnt.

Stimmt der Börsenplatz im QSAM Request-Header nicht mit dem Börsenplatz in der Correlation-Id des MQ Message Descriptors (MQMD) überein, wird der Request mit dem Completion Code 19010 „CORRELATION-ID UND BOERSENPLATZ STIMMEN NICHT UEBEREIN“ abgelehnt.

Im Feld `qsamUserId` ist die gültige 10-stellige XONTRO Teilnehmer-Identifikation (ID-KZ) für den jeweiligen Request zu belegen. Wurde noch kein Login für das angegebene ID-KZ durchgeführt, dann wird der Request mit Completion Code 29280 „USER NICHT ANGEMELDET“ abgelehnt.

Request Data	<code>bc_qsam_request_headerT</code>	<code>qsamId</code> ^m <code>qsamMsgType</code> ^m <code>qsamRequestId</code> ^m <code>qsamExchangeld</code> ^m <code>qsamUserId</code> ^m
--------------	--------------------------------------	--

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 11
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.1.2 XONTRO QSAM Response Header

Beschreibung Im QSAM Response Header werden folgende Felder vom Xontro Backend geliefert:

Das Feld `qsamId` liefert die 4-stellig numerische QSAM Server-Identifikation des Teilnehmers (analog MISS-Id).

Das Feld `qsamMsgType` liefert die Ausprägung „R“ für Response.

Das Feld `qsamRequestId` liefert die 3-stellig numerische Request-Identifikation aus dem Request.

Das Feld `qsamExchangeld` liefert den 3-stelligen numerischen Börsenplatz aus dem Request.

Das Feld `qsamUserId` liefert die 10-stellige XONTRO Teilnehmer-Identifikation (ID-KZ) aus dem Request.

Das Feld `qsamComplCode` liefert im Falle eines abgelehnten Requests einen Xontro spezifischen Completion Code (siehe `XONTROmsg_qsam.dat`).

Bei fehlerfreier Verarbeitung wird im Feld `qsamComplCode` der Initialwert „00000“ geliefert.

Response Data	<code>bc_qsam_response_headerT</code>	<code>qsamId</code> <code>qsamMsgType</code> <code>qsamRequestId</code> <code>qsamExchangeld</code> <code>qsamUserId</code> <code>qsamComplCode</code>
---------------	---------------------------------------	---

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 12
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.1.3 XONTRO QSAM Broadcast Header

Beschreibung Im QSAM Broadcast Header werden folgende Felder vom Xontro Backend geliefert:

Das Feld `qsamId` liefert die 4-stellige numerische QSAM Server-Identifikation des Teilnehmers (analog MISS-Id).

Das Feld `qsamMsgType` liefert folgende Ausprägungen:

„B“ = Broadcast
 „I“ = Bestandstransfer (Initialbestand)
 „T“ = Retransmission

Das Feld `qsamExchangeld` liefert den 3-stelligen numerischen Börsenplatz der Nachricht.

Das Feld `qsamDat` liefert den Börsentag der Nachricht.

Das Feld `qsamBkrNo` liefert die 4-stellige KV-Nummer des Nachrichtenempfängers.

Das Feld `qsamStreamId` liefert den 2-stelligen Stream-Type der Nachricht (siehe `bclayouts_qsam.h`)

Broadcast Data	<code>bc_qsam_broadcast_headerT</code>	<code>qsamId</code> <code>qsamMsgType</code> <code>qsamExchangeld</code> <code>qsamDat</code> <code>qsamBkrNo</code> <code>qsamStreamId</code>
----------------	--	---

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 13
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.2 Berechtigungskonzept

XONTRO bietet börsenplatzspezifische Funktionalität an. Dies bedeutet, dass Teile des API nicht mehr allen Teilnehmern zur Verfügung stehen. Diese Einschränkung gilt bei Broadcaststreams bis auf die Ebene des Subtype, d. h. ein Broadcaststream kann nicht nur an- oder abgeschaltet sein, sondern für zwei Teilnehmer auch unterschiedliche Nachrichten zur Verfügung stellen.

Das API besitzt also folgende Struktur:

Es gibt eine Basismenge von Requests und Broadcaststreams, die allen Anwendern zur Verfügung stehen.

Teile dieser Funktionalität sind optional und können abgeschaltet werden.

Zusätzlich existiert ergänzende Funktionalität, die nur den Teilnehmern eines oder mehrerer Börsenplätze zur Verfügung steht. Dies können Requests, Broadcaststreams oder Subtypes eines Broadcaststreams sein.

Ist ein Teilnehmer berechtigt, erweiterte Funktionalität zu nutzen, dann kann er grundsätzlich optionale Subtypes aus einem Broadcaststream ausblenden.

Weitere Einzelheiten können dem „**XONTRO Security Administration Guide**“ entnommen werden.

Das Formular für die Änderung des Berechtigungsprofils „SAM-Teilnehmerprofil“ ist auf der Internetseite www.xontro.de unter **Xontro → Anmeldung** abrufbar.

In dieser Dokumentation werden Requests, Broadcaststreams und Subtypes, welche nicht allen Teilnehmern zur Verfügung stehen, mit dem Symbol



gekennzeichnet.

In dieser Dokumentation werden Requests, Broadcaststreams und Subtypes, welche nur für BörsenMISSEN zur Verfügung stehen, mit dem Symbol



gekennzeichnet:

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 14
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.3 Behandlung von Mehrfachübertragungen und alten Nachrichten

Erkennt das XONTRO Back End bei der Bearbeitung eines Requests über die Prüfung der inSeqNo eine Mehrfachübertragung, und sind die Daten beider Nachrichten identisch, dann erhält die Front End Applikation die **gleiche Response (Daten und Completion Code)** wie beim ursprünglichen Request. Eine Verarbeitung findet nicht mehr statt.

Sind die Daten bei identischer inSeqNo nicht gleich, dann erhält die Front End Applikation den Completion Code 29040 „DOPPELTE SEQUENCE-NUMBER MIT UNTERSCHIEDLICHEN REQUEST-DATEN“. Eine Verarbeitung findet nicht statt.

Folgende Requests sind davon ausgenommen und nicht über inSeqNo gesichert:

- Login Request
- Logout Request
- Change Password Request
- Retransmission Request
- Mass Quote Request

Die Einstellungszeit eines Requests (MQ-Puttime der Front End Applikation) wird vom XONTRO Back End geprüft. **Veraltete Nachrichten** können aus folgenden Gründen abgelehnt werden:

- Verzögerung von Requests durch kurzfristige Leitungsprobleme
- Übermittlung von Requests außerhalb der Xontro-Servicezeiten
- Verzögerungen durch zu viele offene Requests (to-many-outstanding-requests)

Request-Nachrichten mit **Ausnahme von Order-Requests**, die nach MQ-Einstellung älter als 10 Sekunden sind, werden mit dem Completion Code 27790 „MQ-PUTTIME DER REQUEST-NACHRICHT ZU ALT“ abgelehnt. Die inSeqNo gilt in diesem Fall als nicht verbraucht. Eine Verarbeitung in Xontro findet nicht statt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 15
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.4 Anmeldung / Abmeldung und Passwortwechsel

Die folgende Tabelle beschreibt die Requests sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQ Message Descriptors (MQMD) muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Login
Request ID	BC_LOGIN_RID oder BC_LOGIN_QUOTE_BYPASS_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_pwdT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT

Request Name	XONTRO Logout
Request ID	BC_LOGOUT_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT

Request Name	XONTRO Change Password
Request ID	BC_CHANGE_PASSWORD_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_change_pwdT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 16
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.4.1 XONTRO Login

Beschreibung Mit dem Request XONTRO Login meldet sich ein Benutzer bzw. Teilnehmer am Xontro Back End an.

Im Feld `qsamUserId` ist eine gültige 10-stellige XONTRO Teilnehmer-Identifikation (ID-KZ) mitzugeben, wobei die ersten vier Stellen die KV-Nummer bilden müssen.

Der Request ist nicht erfolgreich, wenn die `qsamUserId` nicht zur Nutzung des Systemanschlusses berechtigt ist, das Passwort ungültig ist oder ein Request für einen Quote-User ohne Quote-Bypass-Berechtigung abgesetzt wird. Das Front End erhält einen situationsspezifischen Completion Code (`qsamComplCode`).

Eine Nutzung des Requests XONTRO Enter Mass Quote (**Quote-Bypass**) ist nur möglich, wenn ein Login mit der Request-Id `BC_LOGIN_QUOTE_BYPASS_RID` durchgeführt wurde. Details sind dem Security Administration Guide zu entnehmen.

Ein mehrfacher Login mit gleicher `qsamUserId` ist möglich, da das Back End diesen Login wie die erste Anmeldung verarbeitet. Es ist Sache der Front End Applikation, Mehrfachanmeldungen zu verarbeiten.

Das Feld **inSeqNo** ist bei diesem Request optional und kann vom Teilnehmer zur Referenzierung von Request und Response verwendet werden.

Nach einem erfolgreichen Login muss die `qsamUserId` bei allen nachfolgenden Xontro Requests im QSAM-Header mitgegeben werden. War der Login nicht erfolgreich, werden die nachfolgenden Requests abgelehnt.

Bei einem erfolgreichen Login erhält der Anwender im Stream `BC_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE` eine Broadcast-Nachricht mit Subtype `BCBE_NOTIFY_PW_EXPIRATION_DATE`, die ihn über die Restgültigkeit des Passworts informiert.

`qsamRequestId` → `BC_LOGIN_RID` oder
`BC_LOGIN_QUOTE_BYPASS_RID`

Request Data	<code>bc_qsam_request_headerT</code>	<code>qsamId</code> ^m <code>qsamMsgType</code> ^m <code>qsamRequestId</code> ^m <code>qsamExchangeld</code> ^m <code>qsamUserId</code> ^m
	<code>bc_request_headerT</code>	<code>inSeqNo</code> ^o
	<code>bc_pwdT</code>	<code>bcPwd</code> ^m

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 17
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamCompICode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

Das Feld **errFieldRef** liefert beim Request BC_LOGIN_QUOTE_BYPASS_RID folgende Ausprägungen für die Quote-Bypass Verarbeitung zurück:

BC_BYPASS_INSTANCE_A_ACTIVE	Kursvermarkter (DBAG CEF) auf Instanz A aktiv (siehe XONTRO Enter Mass Quote)
BC_BYPASS_INSTANCE_B_ACTIVE	Kursvermarkter (DBAG CEF) auf Instanz B aktiv (siehe XONTRO Enter Mass Quote)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 18
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.4.2 XONTRO Logout

Beschreibung Mit dem Request XONTRO Logout meldet sich ein Benutzer am Xontro Back End ab.

Im Feld `qsamUserId` ist die gültige 10-stellige XONTRO Teilnehmer-Identifikation (ID-KZ) mitzugeben, wobei die ersten vier Stellen die KV-Nummer bilden müssen.

Das Feld **inSeqNo** ist bei diesem Request optional und kann vom Teilnehmer zur Referenzierung von Request und Response verwendet werden.

Der Request ist nicht erfolgreich, wenn die `qsamUserId` nicht zur Nutzung des Systemanschlusses berechtigt ist, das Passwort ungültig ist oder noch kein Login vorhanden ist. Das Front End erhält einen situationsspezifischen Completion Code (`qsamComplCode`).

Alle UserIds werden nach der Tagesendeverarbeitung automatisch abgemeldet. Ein untätiger Logout hat nur protokollarischen Charakter.

`qsamRequestId` → BC_LOGOUT_RID

Request Data	<code>bc_qsam_request_headerT</code>	<code>qsamId</code> ^m <code>qsamMsgType</code> ^m <code>qsamRequestId</code> ^m <code>qsamExchangeld</code> ^m <code>qsamUserId</code> ^m
	<code>bc_request_headerT</code>	<code>inSeqNo</code> ^o
Response Data	<code>bc_qsam_response_headerT</code>	<code>qsamId</code> <code>qsamMsgType</code> <code>qsamRequestId</code> <code>qsamExchangeld</code> <code>qsamUserId</code> <code>qsamComplCode</code>
	<code>bc_response_headerT</code>	<code>tranDat</code> <code>tranTim</code> <code>execTranDat</code> <code>execTranTim</code> <code>errFieldRef</code> <code>inSeqNo</code>

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 19
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.4.3 XONTRO Change Password

Beschreibung Mit dem Request XONTRO Change Password hat der Benutzer die Möglichkeit das Passwort seiner Teilnehmer-Identifikation zu ändern.

Im Feld `qsamUserId` ist eine gültige 10-stellige XONTRO Teilnehmer-Identifikation (ID-KZ) mitzugeben, wobei die ersten vier Stellen die KV-Nummer bilden müssen.

Das Feld **`inSeqNo`** ist bei diesem Request optional und kann vom Teilnehmer zur Referenzierung von Request und Response verwendet werden.

Der Request ist nicht erfolgreich, wenn die `qsamUserId` nicht zur Nutzung des Systemanschlusses berechtigt ist, das aktuelle bzw. abgelaufenen Passwort (`bcOldPwd`) ungültig ist, oder das neue Passwort (`bcNewPwd`) nicht den Passwort-Regeln entspricht. Das Front End erhält einen situationsspezifischen Completion Code (`qsamComplCode`).

`qsamRequestId` → BC_CHANGE_PASSWORD_RID

Request Data	<code>bc_qsam_request_headerT</code>	<code>qsamId</code> ^m <code>qsamMsgType</code> ^m <code>qsamRequestId</code> ^m <code>qsamExchangeld</code> ^m <code>qsamUserId</code> ^m
	<code>bc_request_headerT</code>	<code>inSeqNo</code> ^o
	<code>bc_request_change_pwdT</code>	<code>bcOldPwd</code> ^m <code>bcNewPwd</code> ^m
Response Data	<code>bc_qsam_response_headerT</code>	<code>qsamId</code> <code>qsamMsgType</code> <code>qsamRequestId</code> <code>qsamExchangeld</code> <code>qsamUserId</code> <code>qsamComplCode</code>
	<code>bc_response_headerT</code>	<code>tranDat</code> <code>tranTim</code> <code>execTranDat</code> <code>execTranTim</code> <code>errFieldRef</code> <code>inSeqNo</code>

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 20
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.5 Orderverwaltung Front End für skontroführende Makler

Die folgende Tabelle beschreibt die Requests, sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Enter Order SKM
Request ID	BC_ENTER_ORDER_SKM_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_ent_ord_skmT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT + bc_response_ent_ordT

Request Name	XONTRO Modify Order SKM
Request ID	BC_MODIFY_ORDER_SKM_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_mod_ordT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT + bc_response_mod_ordT

Request Name	XONTRO Delete Order SKM
Request ID	BC_DELETE_ORDER_SKM_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_del_ord_skmT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT + bc_response_mod_ordT ¹

¹ Im Fall der Orderänderung oder Orderlöschung wird in der Response immer die gleiche Struktur [bc_response_mod_ordT] verwendet.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 21
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.5.1 XONTRO Enter Order SKM

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Order SKM** dient dem skontroführenden Makler zur Einstellung von Orders. Der Skontroführer kann dabei sowohl limitierte als auch unlimitierte Kauf- und Verkauforders eingeben. Es ist möglich, die Orders hinsichtlich des Limitzusatzes (SB, SL) und des Handelshinweises (EK, KS, VA) zu spezifizieren. Aufgeber (ctpyNo) einer Order kann ein Kreditinstitut, ein Freimakler oder der Skontroführer selbst sein.

Der Empfänger der Order muss der Skontroführer selbst sein. Ist das Feld bkrNo nicht belegt ('0000'), dann trägt das Back End hier den skontroführenden Makler ein.

Ist der Makler nicht Skontroführer in der Gattung, so ist der Request XONTRO Enter Order FM zu verwenden.

Die Felder acctTypCodXontro und ordrStopLim sind für zukünftige Erweiterungen vorgesehen. Sie werden zurzeit in XONTRO nicht unterstützt.

Das Feld fwdOrdrCod wird für Orders vom Skontroführer nicht benötigt und ist mit Initialwert zu belegen.

Ist das Orderbuch in der Gattung nicht gesperrt, so wird eine vom Front End eingehende Order sofort orderbuchwirksam.

Ist das Orderbuch in der Gattung durch eine Reservierung vom Front End gesperrt, wird die Order sofort orderbuchwirksam, wenn die gültige Reservierung im Feld ticket mitgeschickt wird (siehe Abschnitt Kurseingabe Front End). Die Ordereinstellung wird abgelehnt, wenn keine gültige Reservierung vorliegt oder die Gattung durch die XONTRO Dialog-Anwendung gesperrt ist.

Bei erfolgreicher Ordereinstellung wird in der Response die DWZ-Ordernummer zurückgeliefert. Wurden optionale Felder im Request nicht gefüllt und existieren Defaultwerte, dann werden die Defaultwerte in der Response mitgeteilt.

Tritt bei der Einstellung der Order auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlnachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird zusätzlich der Broadcast BCFE_ENTER_ORDER_SKM generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, kann entscheiden, ob sie die Response verarbeitet oder ignoriert. Im zweiten Fall muss der Broadcast ausgewertet werden.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 22
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_ENTER_ORDER_SKM_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_ent_ord_skmT	acctTypCodXontro ^r bkrNo ^o buyCod ^m ctpyNo ^m isinCod ^m isinCodSrs ^o odrExePrc ^o odrExpDat ^m odrQty ^m odrResCod ^o odrStopLim ^r text ^o trdResTypCod ^o userOrdNum ^o fwdOrdCod ^o netTypCodXontro ^r ticket ^o clientInd ^o clientCod ^o investmentInd ^o investmentCod ^o executionInd ^m executionCod ^m deaFlag ^o tradCapacityCod ^o optOutFlag ^o liquidityProvFlag ^o

*Diese Struktur wird auf der
folgenden Seite fortgesetzt*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 23
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_ent_ordT	bkrNo isinCod isinCodSrs ordrNo trdResTypCod fwdOrdrNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 24
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.5.2 XONTRO Modify Order SKM

Beschreibung Der Request **XONTRO Modify Order SKM** dient dem skontroführenden Makler zur Änderung der Orders, für die er Empfänger ist. Änderbar sind das Limit, die Gültigkeit und der Text einer Order. Zurzeit werden Eingaben in den Feldern ordrQty und ordrStopLim nicht berücksichtigt.

Das einzige Identifikationskriterium der Order ist die DWZ-Ordernummer (ordrNo). Selektionen auf Basis der bankinternen Ordernummer (userOrdNum) werden nicht unterstützt.

Bei erfolgreicher Orderänderung werden in der Response die DWZ-Ordernummer und die ISIN (isinCod) zurückgeliefert.

In Ausnahmefällen kann eine vorangegangene und vorgehaltene² Orderänderung zwar logisch, aber noch nicht physisch verarbeitet sein. Trifft der Request **XONTRO Modify Order SKM** in einer solchen Situation auf dem Back End ein, so erhält die Maklerapplikation einen Broadcast vom Subtyp BCBE_PEND_MODIFY_ORDER. Bei der physischen Verarbeitung wird für jede Änderung ein Broadcast vom Subtyp BCBE_CONFIRM_MODIFY_ORDER gesendet.

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene DWZ-Ordernummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB_BC_ORDER_NOEX. In der Response ist nur der Header belegt.

Tritt bei der Änderung der Order auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird zusätzlich der Broadcast BCBE_MODIFY_ORDER_SKM generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, kann entscheiden, ob sie die Response verarbeitet oder ignoriert. Im zweiten Fall muss der Broadcast ausgewertet werden.

In folgenden Fällen wird eine Änderung der Order abgelehnt und in der Response nur der Header belegt:

- das Orderbuch ist in der Gattung gesperrt
- der letzte in der XONTRO Dialog-Anwendung gestellte Kurs ist noch nicht fest
- der letzte in der XONTRO Dialog-Anwendung gestellte Kurs war ein
- bezahlt Kurs mit Zusatz (BG, BB, RG, RB, etc.) und die Nachbearbeitung für diesen Kurs ist nicht abgeschlossen

² Vorgehalten werden in XONTRO Änderungen und Löschungen durch Kreditinstitute oder Freimakler, die am Back End während Orderbuchsperrung bzw. Korrekturzeit eines festgestellten Kurses eingehen.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 25
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_MODIFY_ORDER_SKM_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserld ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_mod_ordT	isinCod ^m ordrExePrc ^o ordrExpDat ^o ordrNo ^m ordrQty ^r ordrStopLim ^r text ^o ordrStatCod ^o clientInd ^o clientCod ^o investmentInd ^o investmentCod ^o executionInd ^m executionCod ^m deaFlag ^o optOutFlag ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserld qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_mod_ordT	isinCod ordrNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 26
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.5.3 XONTRO Delete Order SKM

Beschreibung Der Request **XONTRO Delete Order SKM** dient dem skontroführenden Makler zur Löschung von Orders, für die er Empfänger ist. Das einzige Identifikationskriterium der Order ist die DWZ-Ordernummer (ordrNo). Selektionen auf Basis der bankinternen Ordernummer (userOrdNum) werden nicht unterstützt.

Bei erfolgreicher Orderlöschung werden in der Response die DWZ-Ordernummer und die ISIN (isinCod) zurückgeliefert.

In Ausnahmefällen kann eine vorangegangene und vorgehaltene³ Orderänderung zwar logisch, aber noch nicht physisch verarbeitet sein. Trifft der Request **XONTRO Delete Order SKM** in einer solchen Situation auf dem Back End ein, so erhält die Maklerapplikation einen Broadcast vom Subtyp BCBE_PEND_DELETE_ORDER. Bei der physischen Verarbeitung wird für die Änderung ein Broadcast vom Subtyp BCBE_CONFIRM_MODIFY_ORDER und für die Löschung ein Broadcast vom Subtyp BCBE_CONFIRM_DELETE_ORDER gesendet.

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene DWZ-Ordernummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamCompCode) ELB_BC_ORDER_NOEX.

In der Response ist nur der Header belegt.

Tritt bei der Löschung der Order auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationspezifischen Completion Code (qsamCompCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlermeldung, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Im Fehlerfall ist in der Response nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird zusätzlich der Broadcast BCBE_DELETE_ORDER_SKM generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, kann entscheiden, ob sie die Response verarbeitet oder ignoriert. Im zweiten Fall muss der Broadcast ausgewertet werden.

Ist das Orderbuch in der Gattung gesperrt, so wird die Löschung durchgeführt, wenn eine gültige Reservierung der Gattung für eine Kursfeststellung vom Front End vorliegt und diese Reservierung in dem Feld ticket im Request mitgeschickt wird (siehe Abschnitt Kursfeststellung).

In folgenden Fällen wird eine Löschung der Order abgelehnt und in der Response nur der Header belegt:

- das Orderbuch in der Gattung ist gesperrt und beim Request wird keine gültige Reservierung (Ticket) mitgeschickt
- der letzte in der XONTRO Dialog-Anwendung gestellte Kurs ist noch nicht fest
- der letzte in der XONTRO Dialog-Anwendung gestellte Kurs war ein bezahlt Kurs mit Zusatz (BG, BB, RG, RB, etc.) und die Nachbearbeitung für diesen Kurs ist nicht abgeschlossen

³ Vorgehalten werden in XONTRO Änderungen und Löschungen durch Kreditinstitute oder Freimakler, die am Back End während Orderbuchsperrung bzw. Korrekturzeit eines festgestellten Kurses eingehen.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind gelb hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 27
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_DELETE_ORDER_SKM_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserld ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_del_ord_skmT	isinCod ^m ordrNo ^m ticket ^o ordrStatCod ^o clientInd ^o clientCod ^o investmentInd ^o investmentCod ^o executionInd ^m executionCod ^m killFlag ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserld qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_mod_ordT	isinCod ordrNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 28
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.6 Orderverwaltung Front End für Freimakler

Die folgende Tabelle beschreibt die Requests sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Enter Order FM
Request ID	BC_ENTER_ORDER_FM_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_ent_ordT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT + bc_response_ent_ordT

Request Name	XONTRO Modify Order FM
Request ID	BC_MODIFY_ORDER_FM_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_mod_ordT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT + bc_response_mod_ordT

Request Name	XONTRO Delete Order FM
Request ID	BC_DELETE_ORDER_FM_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_del_ordT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 29
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT + bc_response_mod_ordT ⁴
---------------	--

2.1.6.1 XONTRO Enter Order FM

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Order FM** dient dem Freimakler zur Einstellung von Orders. Der Freimakler kann dabei sowohl limitierte als auch unlimitierte Kauf- und Verkaufsorders eingeben. Es ist möglich, die Orders hinsichtlich des Limitzusatzes (SB, SL) und des Handelshinweises (EK, KS, VA) zu spezifizieren. Aufgeber (ctpyNo) einer Order kann dabei sowohl der Freimakler selbst, als auch ein Kreditinstitut sein. Ist der Aufgeber ein Kreditinstitut, muss der Freimakler Empfänger sein, ist er selbst Aufgeber, dann muss der skontroführende Makler Empfänger sein.

Ist der Makler Skontrofürer in der Gattung, so ist der Request XONTRO Enter Order SKM zu verwenden.

Bei erfolgreicher Ordereinstellung wird die DWZ-Ordernummer zurückgeliefert. Wurden optionale Felder im Request nicht gefüllt, und existieren Defaultwerte, dann werden die Defaultwerte in der Response mitgeteilt.

Ist das Feld bkrNo nicht belegt ('0000') und ist der Freimakler Orderaufgeber (ctpyNo), dann trägt das Back End hier den skontroführenden Makler, ist eine Bank Orderaufgeber (ctpyNo), dann trägt das Back End den Freimakler selbst ein.

Tritt bei der Einstellung der Order auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Die Felder acctTypCodXontro und ordrStopLim sind für zukünftige Erweiterungen vorgesehen. Sie werden zurzeit in XONTRO noch nicht unterstützt.

Ist eine Bank Orderaufgeber (ctpyNo), dann wird die Order unabhängig vom Inhalt des Feldes fwdOrdrCod **immer** automatisch an den Skontrofürer weitergeleitet.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird zusätzlich ein Broadcast generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, kann entscheiden, ob sie die Response verarbeitet oder ignoriert. Im zweiten Fall muss der Broadcast ausgewertet werden.

Erfolgt die Einstellung der Order auf dem Back End während das Orderbuch gesperrt ist, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB_BC_PRICE_FIXING.

In der Response sind nur der Header, die DWZ-Ordernummer (ordrNo) und das Feld fwdOrdrNo belegt.

Die Nachricht über die endgültige Einstellung der Order (oder deren Ablehnung) wird über den Request **XONTRO Subscribe Order Update** zur Verfügung gestellt. Diese Nachricht wird auch einer Backup MISS zugestellt.

⁴ Im Fall der Orderänderung oder Orderlöschung wird in der Response immer die gleiche Struktur [bc_response_mod_ordT] verwendet.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 30
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_ENTER_ORDER_FM_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_ent_ordT	acctTypCodXontro ^r bkrNo ^o buyCod ^m ctpyNo ^m isinCod ^m isinCodSrs ^o ordrExePrc ^o ordrExpDat ^m ordrQty ^m ordrResCod ^o ordrStopLim ^r text ^o trdResTypCod ^o userOrdNum ^o fwdOrdrCod ^o netTypCodXontro ^r clientInd ^o clientCod ^o investmentInd ^o investmentCod ^o executionInd ^m executionCod ^m deaFlag ^o tradCapacityCod ^o optOutFlag ^o liquidityProvFlag ^o

*Diese Struktur wird auf der
folgenden Seite fortgesetzt*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 31
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_ent_ordT	bkrNo isinCod isinCodSrs ordrNo trdResTypCod fwdOrdrNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 32
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.6.2 XONTRO Modify Order FM

Beschreibung Der Request **XONTRO Modify Order FM** dient dem Freimakler zur Änderung der Orders, für die er Orderaufgeber oder Empfänger ist. Änderbar sind das Limit, die Gültigkeit und der Text einer Order. Darüber hinaus ist vorgesehen, später auch das Stop-Limit einer Stop-Limit-Order und das Volumen einer Order über diesen Request ändern zu können. **Zurzeit werden Eingaben in diesen Feldern jedoch noch nicht berücksichtigt.**

Das einzige Identifikationskriterium der Order ist die DWZ-Ordernummer (ordrNo). Selektionen auf Basis der bankinternen Ordernummer werden nicht unterstützt.

Bei erfolgreicher Orderänderung werden die DWZ-Ordernummer und die ISIN (isinCod) zurückgeliefert.

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene DWZ-Ordernummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB_BC_ORDER_NOEX. In der Response ist nur der Header belegt.

Erfolgt die Änderung der Order auf dem Back End während das Orderbuch gesperrt ist, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB_BC_PRICE_FIXING.

In der Response ist nur der Header belegt.

Die Nachricht über die endgültige Änderung der Order (oder deren Ablehnung) wird über den Request **XONTRO Subscribe Order Update** zur Verfügung gestellt.

Tritt bei der Änderung der Order auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird zusätzlich ein Broadcast generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, kann entscheiden, ob sie die Response verarbeitet oder ignoriert. Im zweiten Fall muss der Broadcast ausgewertet werden.

Eine weitergeleitete Order kann mit diesem Request nicht geändert werden.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 33
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_MODIFY_ORDER_FM_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserld ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_mod_ordT	isinCod ^m ordrExePrc ^o ordrExpDat ^o ordrNo ^m ordrQty ^r ordrStopLim ^r text ^o ordrStatCod ^o clientInd ^o clientCod ^o investmentInd ^o investmentCod ^o executionInd ^m executionCod ^m deaFlag ^o optOutFlag ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserld qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_mod_ordT	isinCod ordrNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 34
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.6.3 XONTRO Delete Order FM

Beschreibung Der Request **XONTRO Delete Order FM** dient dem Freimakler zur Löschung der Orders, für die er Orderaufgeber oder Empfänger ist. Ist er Empfänger, einer Order, dann kann er die Ursprungorder und die weitergeleitete Order mit einem einzigen Request löschen. Er kann hierzu jede der beiden DWZ-Ordernummern verwenden.

Das einzige Identifikationskriterium der Order ist die DWZ-Ordernummer (ordrNo). Selektionen auf Basis der bankinternen Ordernummer werden nicht unterstützt.

Bei erfolgreicher Orderlöschung werden die DWZ-Ordernummer und die ISIN (isinCod) zurückgeliefert.

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene DWZ-Ordernummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB_BC_ORDER_NOEX.

In der Response ist nur der Header belegt.

Erfolgt die Löschung der Order auf dem Back End während das Orderbuch gesperrt ist, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB_BC_PRICE_FIXING.

In der Response ist nur der Header belegt.

Die Nachricht über die endgültige Löschung der Order (oder deren Ablehnung) wird über den Request **XONTRO Subscribe Order Update** zur Verfügung gestellt.

Tritt bei der Löschung der Order auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Im Fehlerfall ist in der Response nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird zusätzlich ein Broadcast generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, kann entscheiden, ob sie die Response verarbeitet oder ignoriert. Im zweiten Fall muss der Broadcast ausgewertet werden.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 35
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_DELETE_ORDER_FM_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_del_ordT	isinCod ^m ordrNo ^m clientInd ^o clientCod ^o investmentInd ^o investmentCod ^o executionInd ^m executionCod ^m killFlag ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_mod_ordT	isinCod ordrNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 36
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.7 Kurseingabe Front End für skontroführende Makler

Die folgende Tabelle beschreibt die Requests sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Start Pricing
Request ID	BC_START_PRICING_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_start_pricingT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT
Request Name	XONTRO Enter Price
Request ID	BC_ENTER_PRICE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_enter_priceT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT
Request Name	XONTRO Cancel Pricing
Request ID	BC_CANCEL_PRICING_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_cancel_pricingT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 37
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Request Name	XONTRO Enter Price Plus
Request ID	BC_ENTER_PRICE_PLUS_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_enter_price_plusT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT + bc_response_enter_price_plusT

Request Name	XONTRO Enter Block Price
Request ID	BC_ENTER_BLOCK_PRICE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + mehrfach bc_request_ent_block_priceT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT + bc_response_ent_block_price_noT + mehrfach bc_response_ent_block_priceT

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 38
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.7.1 XONTRO Start Pricing

Beschreibung Der Request **XONTRO Start Pricing** dient dem skontroführenden Makler zur Reservierung einer Kursfeststellung.

Tritt bei der Reservierung der Kursfeststellung auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situations-spezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests (technischer Completion Code ELB_TECH_OK) wird das Orderbuch in der Gattung zur Kursfeststellung gesperrt. Zusätzlich wird der Broadcast BCFE_LOCK_ORDERS generiert, der die Reservierung der Kursfeststellung als eindeutigen Schlüssel im Feld ticket enthält. Das Front End muss den Broadcast auswerten, um das Ticket im Request XONTRO Enter Price anzugeben.

Liegt bereits eine gültige Reservierung vor und der Request wird mit einer neuen Kursart (trdResTypCod) durchgeführt, wird das Orderbuch für die alte Kursart entsperrt und für die neue gesperrt. Zusätzlich werden die Broadcasts BCFE_UNLOCK_ORDERS und BCFE_LOCK_ORDERS generiert. Bei gleicher Kursart wird der Request abgelehnt.

Erfolgt die Anforderung der Reservierung während das Orderbuch durch die XONTRO Dialog-Anwendung gesperrt ist, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode).

Erfolgt die Anforderung der Reservierung nach der Übernahme der Nachbearbeitung durch die XONTRO Dialog-Anwendung, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode).

Eine vom Front End begonnene Kursfeststellung kann im Notfall jederzeit von der XONTRO Dialog-Anwendung übernommen werden. Dies kann nach der Reservierung, nach der Kursfeststellung oder während der Nachbearbeitung der Fall sein. Mit der Übernahme wird die Reservierung (Ticket) entwertet und die Kursfeststellung muss von der XONTRO Dialog-Anwendung vollständig zu Ende geführt werden.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 39
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_START_PRICING_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_start_pricingT	isinCod ^m trdResTypCod ^m
Response Data	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim ⁵ errFieldRef inSeqNo

⁵ Im Feld execTranTim wird der Zeitpunkt des Setzens der Sperre (lockTim) hinterlegt Diese Zeit entspricht dem Inhalt des Feldes lockTim im Broadcast BCFE_LOCK_ORDERS.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind gelb hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 40
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.7.2 XONTRO Enter Price

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Price** dient dem skontroführenden Makler zur Übermittlung eines Kurses mit Umsatz an das Back End.

Bei der umsatzbehafteten, dezentralen Kursfeststellung muss erkennbar und nachvollziehbar sein, welche Person für einen Kurs verantwortlich ist. Das Front End muss sicherstellen, dass der Request XONTRO Enter Price eindeutig einem ID-KZ (10-stellig) aus dem LOGIN zugeordnet werden kann.

Das vom Back End im Broadcast BCFE_LOCK_ORDERS übermittelte Ticket ist mitzugeben. Liegt keine gültige Reservierung vor, wird der Request abgelehnt.

Tritt bei der Verarbeitung des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests (technischer Completion Code ELB_TECH_OK) wird zusätzlich der Broadcast BCFE_ENTER_PRICE generiert und das Orderbuch in der Gattung entsperrt. Es wird **kein** zusätzlicher Broadcast vom Subtyp BCFE_UNLOCK_ORDERS verschickt.

Der Kurs ist sofort fest. Eine Kurskorrektur ist nicht möglich.

Über das Feld postProcFlag steuert das Front End, ob eine Nachbearbeitung erfolgen soll. Die gültigen Feldausprägungen sind

“A“ = Request Enter Price mit automatischer Nachbearbeitung durch das XONTRO Back End; der Request Finish Pricing ist für diese Kursfeststellung nicht zulässig

“E“ = Request Enter Price mit expliziter Nachbearbeitung durch den Makler am Front End; der Request Finish Pricing ist für den Abschluss der Nachbearbeitung zwingend erforderlich

Das XONTRO Back End führt keine inhaltliche Überprüfung des Kurses (tradMtchPrc) durch. Es liegt in der Verantwortung der Makler, die von der jeweiligen Börse festgelegten Regeln (z.B. bei Preissprüngen) für die Kursfeststellung einzuhalten.⁶

Für die Übergabe von umsatzlosen Kursen (Kurszusatz G, B) wird die Verwendung des Requests XONTRO Enter Block Price dringend empfohlen.

⁶ Die Einhaltung der Regeln wird von den Handelsüberwachungsstellen der Börsen wie bisher überwacht.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 41
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_ENTER_PRICE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_enter_priceT	isinCod ^m tradMtchCod ^m tradMtchPrc ^m trdResTypCod ^m ordrBkExeQty ^o currExcRat ^o postProcFlag ^m ticket ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 42
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.7.3 XONTRO Cancel Pricing

Beschreibung Der Request XONTRO Cancel Pricing dient dem skontroführenden Makler zur Stornierung der Reservierung einer Kursfeststellung.

Enthält der Request kein gültiges Ticket oder wurde mit dem Ticket bereits ein Kurs gestellt, wird die Stornierung abgelehnt.

Liegt am Back End ein gültiges Ticket vor (durch einen Request XONTRO Start Pricing), so kann die Stornierung der Reservierung auch erfolgen, indem das Ticket mit dem Wert **BC_DO_NOT_CHECK_TICKET** belegt wird.

Tritt bei der Verarbeitung des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird das Orderbuch in der Gattung entsperrt. Zusätzlich wird ein Broadcast BC_FE_UNLOCK_ORDERS generiert.

qsamRequestId → BC_CANCEL_PRICING_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_cancel_pricingT	isinCod ^m ticket ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 43
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.7.4 XONTRO Enter Price Plus

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Price Plus** dient dem skontroführenden Makler zur sofortigen Übermittlung eines umsatzbehafteten Kurses an das Back End, ohne zuvor eine Orderbuchsperrung mittels *XONTRO Start Pricing* durchführen zu müssen. Dadurch kann die Dauer vom Erkennen einer ausführbaren Ordersituation am Front End bis zum Abschluss der dezentralen Kursfeststellung verkürzt werden.

Weiterhin kann der Request zusätzlich die Informationen des Requests *XONTRO Add Position* enthalten, d.h. es kann optional ein halbes Geschäft oder neu auch ein komplettes Geschäft mitgeschickt werden.

Wird dieser Request ohne vorherige Orderbuchsperrung übermittelt, ist das Ticket mit dem Initialwert „zero“ zu belegen. In diesem Fall sind für die Validierung der aktuellen Orderbuchlage zum übermittelten Kurs folgende Felder mitzuliefern:

- checkExeQtyBid: Kumulierte ausführbare Nominale auf der Kaufseite
- checkExeQtyAsk: Kumulierte ausführbare Nominale auf der Verkaufseite
- checkExePrcBid: Bestes Limit auf der Kaufseite (nach „billigst“)
- checkExePrcAsk: Bestes Limit auf der Verkaufseite (nach „bestens“)

Stimmen die gelieferten Prüffelder nicht mit der aktuellen Orderbuchlage am Back End überein, wird der Request abgelehnt. Im Datenbereich der Response werden in diesem Fall die korrekten Prüffelder geliefert.

Über das Setzen des Kennzeichens `possLockFlag` kann das Front End veranlassen, dass das Orderbuch bei fehlerhaften Prüffeldern gesperrt und ein Broadcast vom Subtyp `BCFE_LOCK_ORDERS` verschickt wird.

Tritt bei der Verarbeitung des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (`qsamComplCode`).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlermeldung, dann ist das Headerfeld `errFieldRef` belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Ansonsten wird das Orderbuch „intern“ gesperrt und der Request verarbeitet. Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird der Broadcast `BCFE_ENTER_PRICE_PLUS` generiert und das Orderbuch wird „intern“ wieder entsperrt. Es werden im Rahmen der „internen“ Orderbuchsperrverarbeitung keine Broadcasts vom Subtyp `BCFE_LOCK_ORDERS` und `BCFE_UNLOCK_ORDERS` verschickt.

Wird in diesem Request das Feld `tradMtchCod` (Kurszusatz) mit dem Wert „TRG“ belegt, dann wird eine Stoporder nach den geltenden Umsetzungsregeln getriggert und anschließend als Marketorder sofort zu diesem Kurs (`tradMtchPrc`) ausgeführt. Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird der Broadcast `BCFE_ENTER_PRICE_PLUS` generiert, ein Broadcast für das Triggern der Stoporder wird **nicht** erzeugt.

Die Ausführungsregeln des Kurszusatzes „TRG“ entsprechen denen eines reinen bezahlten Kurses (bz). Beim Request **XONTRO Enter Price** ist der Kurszusatz „TRG“ nicht zugelassen.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 44
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Der Kurs ist sofort fest, eine Kurskorrektur ist nicht möglich, die Nachbearbeitung wird automatisch abgeschlossen.

Falls im o.a. Request ein (halbes) Geschäft mitgeliefert wurde, wird dies vorher eingestellt. Die Informationen zum (halben) Geschäft sind im o.g. Broadcast BCFE_ENTER_PRICE_PLUS enthalten.

Dieser Request kann auch entsprechend dem Verfahren der Kursfeststellung mittels Request XONTRO Enter Price mit vorheriger Orderbuchsperrung genutzt werden. In diesem Fall ist das im Broadcast BCFE_LOCK_ORDERS übermittelte Ticket im Request mitzuliefern, die Felder checkExeQtyBid, checkExeQtyAsk, checkExePrcBid, checkExePrcAsk werden nicht geprüft.

Die Felder allotCapQty und allotType sind für zukünftige Erweiterungen vorgesehen. Sie werden zurzeit in XONTRO nicht unterstützt.

Tritt bei der formalen Prüfung des Requests ein Fehler auf, oder wurde der Request mit Ticket übermittelt, sind die Prüffelder im Datenbereich der Response mit dem Initialwert „zero“ belegt.

qsamRequestId → BC_ENTER_PRICE_PLUS_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_enter_price_plusT	isinCod ^m tradMtchCod ^m tradMtchPrc ^m trdResTypCod ^m ordrBkExeQty ^o currExcRat ^o ticket ^o checkExeQtyBid ^o checkExeQtyAsk ^o checkExePrcBid ^o checkExePrcAsk ^o possLockFlag ^o ctpyNoBid ^o ctpyNoAsk ^o tradMtchQty ^o feeFlag ^o fee ^o tranFeeFlag ^o tranFee ^o allotCapQty ^o allotType ^o

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 45
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_enter_price_plusT	checkExeQtyBid checkExeQtyAsk checkExePrcBid checkExePrcAsk

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 46
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.7.5 XONTRO Enter Block Price

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Block Price** dient dem skontroführenden Makler zur Einstellung von mehreren **umsatzlosen** Kursen in einer Nachricht.

Das Sperren und Entsperrern der betroffenen Orderbücher ist nicht erlaubt, da dies implizit mit dem Request erfolgt. Ist das Orderbuch einer Gattung bereits gesperrt (z.B. durch den Request BC_START_PRICING_RID) wird die Einstellung des Kurses abgelehnt.

Alle Angaben sind verbindlich. Eine Nachricht kann bis zu 30 Kurse enthalten. Das Minimum wird zurzeit mit MAX_NO_PRC_DEFAULT fest definiert, d.h. dass bis zu MAX_NO_PRC_DEFAULT Kurse unter allen Umständen akzeptiert werden.

Eine Applikation sollte beim ersten Aufruf dieses Request nach einem Login nicht mehr als MAX_NO_PRC_DEFAULT Kurse mitgeben. Die Nachricht wird bei dieser Parametrisierung in jedem Fall verarbeitet. Die Response enthält dann den Maximalwert für die Anzahl Kurse, die in einem Request zurzeit verschickt werden dürfen.

In der Response wird die Reaktion auf alle Kurse mitgeteilt. Dabei entspricht die Reihenfolge der errCods in der Response derjenigen der Kursfeststellungen im Request. Jedem errCod wird die korrespondierende ISIN (isinCod) aus dem Request vorangestellt.

Ein errCod = 0 bedeutet eine einwandfreie Ausführung. In allen anderen Fällen entspricht die Belegung der des Completion Code.

Das Feld maxNoPrc muss ausgewertet werden. Es enthält die zurzeit maximal zulässige Anzahl von Kursen für eine Nachricht.

Eine ISIN darf nur einmal innerhalb einer Nachricht übermittelt werden. Wird diese Bedingung nicht eingehalten, dann erhält die Anwendung ab dem zweiten Auftreten der ISIN den Fehlercode ELB_BC_DUPLICATE_ISIN (im korrespondierenden errCod) für alle Wiederholungen.

Alle Kursfeststellungen, die vom Back End akzeptiert wurden, werden dem Front End mit **einem einzigen Broadcast** vom Subtyp **BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE** im Stream der Order Updates zur Verfügung gestellt. Es wird keine Sperrnachricht vom Subtyp BCFE_LOCK_ORDERS erzeugt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 47
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId →	BC_ENTER_BLOCK_PRICE_RID	
Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	<i>bis zu 30 Einträge:</i> bc_request_ent_block_priceT	isinCod ^{m*} tradMtchCod ^{m*} tradMtchPrc ^{m*} trdResTypCod ^{m*}
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_ent_block_price_noT	maxNoPrc
	<i>bis zu 30 Einträge:</i> bc_response_ent_block_priceT	isinCod* errCod*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 48
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.8 Nachbearbeitung Front End für skontroführende Makler

Die folgende Tabelle beschreibt die Requests sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Add Position
Request ID	BC_ADD_POSITION_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_add_posT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT
Request Name	XONTRO Modify Execution
Request ID	BC_MODIFY_EXECUTION_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_modify_executionT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT
Request Name	XONTRO Finish Pricing
Request ID	BC_FINISH_PRICING_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_finish_pricingT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 49
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.8.1 XONTRO Add Position

Beschreibung Mit dem Request **XONTRO Add Position** kann ein skontroführender Makler eine Kursfeststellung nach einem erfolgreichen Request **XONTRO Enter Price** um halbe Geschäfte ergänzen.

Der Request kann nicht verwendet werden, wenn im Request XONTRO Enter Price das Feld postProcFlag mit "A" belegt war.

Das vom Back End im Broadcast BCFE_LOCK_ORDERS übermittelte Ticket ist mitzugeben.

Tritt bei der Verarbeitung des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests bleibt das Ticket weiterhin gültig.

Im Feld ctpyNo ist als Kontrahent die Angabe eines Kreditinstitutes oder eines Freimaklers zulässig. Der Kontrahent darf nicht der skontroführende Makler selbst sein.

Halbe Geschäfte werden erst mit dem Abschluss der Nachbearbeitung durch den Request XONTRO Finish Pricing wirksam.

Offene Nachbearbeitungen von Kursen, die in der XONTRO Dialog-Anwendung gestellt wurden, können vom Front End **nicht** nachbearbeitet werden.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 50
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_ADD_POSITION_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_add_posT	isinCod ^m tradMtchPrcNo ^m ticket ^m buyCod ^m ctpyNo ^m tradMtchQty ^m feeFlag ^o fee ^o tranFeeFlag ^o tranFee ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 51
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.8.2 XONTRO Modify Execution

Beschreibung Mit dem Request **XONTRO Modify Execution** kann ein skontroführender Makler die Ausführungsnominale einer Order festlegen. Der Request ist nur erlaubt, wenn sowohl der Kurs (bG, bB,...) als auch die betroffene Order eine Teilausführung zulässt. Der Abschluss der Nachbearbeitung mit dem Request XONTRO Finish Pricing darf noch **nicht** erfolgt sein.

Der Request kann nicht verwendet werden, wenn im Request XONTRO Enter Price das Feld postProcFlag mit "A" belegt war.

Das vom Back End im Broadcast BCFE_LOCK_ORDERS übermittelte Ticket ist mitzugeben.

Tritt bei der Verarbeitung des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlermeldung, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests bleibt das Ticket weiterhin gültig.

Im Feld tradMtchQty ist die Nominale anzugeben, die ausgeführt werden soll. Ist die Nominale 0, so nimmt die Order nicht an der Kursfeststellung (Ausführung) teil.

Werden mehrere Requests auf eine Order durchgeführt, gilt immer der Letzte.

Teilausführungen werden erst mit dem Abschluss der Nachbearbeitung durch den Request XONTRO Finish Pricing wirksam.

Offene Nachbearbeitungen von Kursen, die in der XONTRO Dialog-Anwendung gestellt wurden, können vom Front End **nicht** nachbearbeitet werden.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 52
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_MODIFY_EXECUTION_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_modify_executionT	isinCod ^m ordrNo ^m tradMtchPrcNo ^m tradMtchQty ^m ticket ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 53
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.8.3 XONTRO Finish Pricing

Beschreibung Der Request **XONTRO Finish Pricing** dient dem skontroführenden Makler zum Abschluss der Nachbearbeitung einer zuvor mit dem Request XONTRO Start Pricing angeforderten Kursfeststellung.

Der Request kann nicht verwendet werden, wenn im Request XONTRO Enter Price das Feld postProcFlag mit "A" belegt war.

Das vom Back End im Broadcast BCFE_LOCK_ORDERS übermittelte Ticket ist mitzugeben.

Außerdem kann der Abschluss offener Nachbearbeitungen von Kursfeststellungen, die entweder am Back End oder per Front End gestellt wurden, durchgeführt werden, indem das Ticket mit dem Wert BC_DO_NOT_CHECK_TICKET belegt wird. Mit SAM Release 28 wird der Request um den Devisenkurs (currExcRat) erweitert. Durch diese Erweiterung wird dem Front End ermöglicht, in Gattungen, für die ein Devisenkurs benötigt wird, diesen nicht bereits beim Request XONTRO Enter Price zwingend mitzuschicken, sondern erst nachträglich beim Abschluss der Nachbearbeitung im Request XONTRO Finish Pricing mitzugeben.

Für reine bezahlt Kurse (BZ) wird ebenfalls ermöglicht, mehrere dezentrale Kursfeststellungen ohne Abschluss der Nachbearbeitung durchzuführen. Für jede dieser Kursfeststellungen kann dann später die Nachbearbeitung durch den Request XONTRO Finish Pricing in beliebiger Reihenfolge abgeschlossen werden.

Ein bezahlt Kurs mit Zusatz (BG, BB, RG, RB, etc.) muss weiterhin erst nachbearbeitet werden, bevor der nächste Kurs gestellt werden kann.

Per Front End gestellte Kurse, bei denen die Nachbearbeitung bis zum Beginn des XONTRO-Buchungsschnittes nicht erfolgt ist, werden nach den gleichen Regeln wie am Back End gestellte Kurse maschinell nachbearbeitet.

Tritt bei der Verarbeitung des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird die Nachbearbeitung abgeschlossen und das Ticket verliert seine Gültigkeit. Zusätzlich wird ein Broadcast vom Subtype BCFE_FINISH_PRICING generiert.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 54
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_FINISH_PRICING_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_finish_pricingT	isinCod ^m tradMchPrcNo ^m ticket ^m currExcRat ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 55
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.9 Kursaussetzung und Nebenrechte vom Front End

Die folgende Tabelle beschreibt die Requests sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Deactivate Pricing
Request ID	BC_DEACTIVATE_PRICING_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_dea_pricingT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT

Request Name	XONTRO Deactivate Pricing Block
Request ID	BC_DEACTIVATE_PRICING_BLOCK_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + mehrfach bc_request_dea_pricing_blockT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT + bc_response_pricing_block_noT + mehrfach bc_response_pricing_blockT

Request Name	XONTRO Reactivate Pricing
Request ID	BC_REACTIVATE_PRICING_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_rea_pricingT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 56
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Request Name	XONTRO Reactivate Pricing Block
Request ID	BC_REACTIVATE_PRICING_BLOCK_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + mehrfach bc_request_rea_pricing_blockT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT + bc_response_pricing_block_noT + mehrfach bc_response_pricing_blockT

Request Name	XONTRO Enter Special Right
Request ID	BC_ENTER_SP_RIGHT_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_sp_rightT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 57
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.9.1 XONTRO Deactivate Pricing

Beschreibung Der Request **XONTRO Deactivate Pricing** dient dem skontroführenden Makler dazu, eine Kursaussetzung für eine bestimmte Gattung durchzuführen. In Frankfurt erfolgt die Eingabe einer Kursaussetzung ausschließlich durch die Marktsteuerung.

Ist das Feld deactToDat nicht belegt, so wird die Gattung ab dem im Feld deactFromDat angegebenen Datum unbefristet kursausgesetzt.

Wird der Request vom Back End akzeptiert und enthält das Feld deactFromDat den aktuellen Börsentag, so wird die Gattung sofort kursausgesetzt und alle offenen Orders der Gattung werden unwiderruflich gelöscht.

In folgenden Fällen ist eine sofortige Kursaussetzung nicht möglich und der Request wird abgelehnt:

- das Orderbuch in der Gattung ist gesperrt
- die Nachbearbeitung in der Gattung ist nicht abgeschlossen

Das Datum im Feld deactToDat darf nicht in der Vergangenheit liegen.

Der Request kann auch dazu genutzt werden, eine vorhandene Kursaussetzung zu ändern.

Tritt bei der Verarbeitung des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlnachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird ein Broadcast vom Subtype BCFE_DEACTIVATE_PRICING verschickt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 58
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_DEACTIVATE_PRICING_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_dea_pricingT	isinCod ^m deactFromDat ^m deactToDat ^o deactComment ^o deactText ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 59
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.9.2 XONTRO Deactivate Pricing Block

Beschreibung Der Request **XONTRO Deactivate Pricing Block** dient dem skontroführenden Makler dazu, mehrere Kursaussetzungen in einer Nachricht durchzuführen. Insbesondere an Börsentagen mit volatilen Märkten, an denen es ein Vielfaches an Knock-outs gegenüber einem „normalen“ Börsentag gibt, wird das Nachrichtenaufkommen durch diesen Request deutlich reduziert.

Eine Nachricht kann bis zu 30 Kursaussetzungen enthalten. Das Minimum wird zurzeit mit MAX_NO_PRC_DEFAULT (d.h. mit dem identischen Parameter wie beim Request XONTRO Enter Block Price) fest definiert, so dass bis zu MAX_NO_PRC_DEFAULT Kursaussetzungen unter allen Umständen akzeptiert werden.

Eine Applikation sollte beim ersten Aufruf dieses Request nach einem Login nicht mehr als MAX_NO_PRC_DEFAULT Kursaussetzungen mitgeben. Die Nachricht wird bei dieser Parametrisierung in jedem Fall verarbeitet. Die Response enthält dann den Maximalwert für die Anzahl Kursaussetzungen, die in einem Request zurzeit verschickt werden dürfen.

In der Response wird die Reaktion auf alle Kursaussetzungen mitgeteilt. Dabei entspricht die Reihenfolge der errCods in der Response derjenigen der Kursaussetzungen im Request. Jedem errCod wird die korrespondierende ISIN (isinCod) aus dem Request vorangestellt.

Ein errCod = 0 bedeutet eine einwandfreie Ausführung. In allen anderen Fällen entspricht die Belegung der des Completion Code.

Das Feld maxNoPrc muss ausgewertet werden. Es enthält die zurzeit maximal zulässige Anzahl von Kursaussetzungen für eine Nachricht.

Wird diese Zahl beim nächsten Request überschritten, dann erhält die Applikation den Completion Code ELB_BC_MAXIMUM_NUMBER_EXCEEDED.

Eine ISIN darf nur einmal innerhalb einer Nachricht übermittelt werden. Wird diese Bedingung nicht eingehalten, dann erhält die Anwendung ab dem zweiten Auftreten der ISIN den Fehlercode ELB_BC_DUPLICATE_ISIN (im korrespondierenden errCod) für alle Wiederholungen.

Alle Kursaussetzungen, die vom Back End akzeptiert wurden, werden dem Front End mit **einem einzigen Broadcast** vom Subtyp **BCFE_DEACTIVATE_PRICING_BLOCK** zur Verfügung gestellt.

Für jede im Request enthaltene Gattung gelten die gleichen Regeln für die Feldbelegungen sowie die identischen Plausibilitätsprüfungen hinsichtlich Kursaussetzung und Orderlöschung wie beim Request für eine einzelne Kursaussetzung, dem direkt vorher beschriebenen XONTRO Deactivate Pricing.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 60
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

qsamRequestId →	BC_DEACTIVATE_PRICING_BLOCK_RID	
Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	<i>bis zu 30 Einträge:</i> bc_request_dea_pricing_blockT	isinCod ^{m*} deactFromDat ^{m*} deactToDat ^{o*} deactComment ^{o*} deactText ^{o*}
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_pricing_block_noT	maxNoPrc
	<i>bis zu 30 Einträge:</i> bc_response_pricing_blockT	isinCod* errCod*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 61
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.9.3 XONTRO Reactivate Pricing

Beschreibung Der Request **XONTRO Reactivate Pricing** dient dem skontroführenden Makler dazu, eine vorhandene Kursaussetzung für eine Gattung zurückzunehmen. In Frankfurt erfolgt die Rücknahme einer Kursaussetzung ausschließlich durch die Marktsteuerung.

Tritt bei der Verarbeitung des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird ein Broadcast vom Subtype BCFE_REACTIVATE_PRICING verschickt.

Die Rücknahme der Kursaussetzung wird sofort aktiv. Danach können in dieser Gattung wieder Orders und Kurse eingestellt werden.

qsamRequestId → BC_REACTIVATE_PRICING_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_rea_pricingT	isinCod ^m deactText ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 62
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.9.4 XONTRO Reactivate Pricing Block

Beschreibung Der Request **XONTRO Reactivate Pricing Block** dient dem skontroführenden Makler dazu, mehrere vorhandene Kursaussetzungen mit einer Nachricht zurückzunehmen. Des Weiteren ist es möglich, für jede Gattung, für die eine Kursaussetzung zurückgenommen wird, mit diesem Request einen umsatzlosen Kurs sowie eine erneute Kursaussetzung mitzuschicken.

Eine Nachricht kann bis zu 30 Rücknahmen von Kursaussetzungen enthalten. Das Minimum wird zurzeit mit MAX_NO_PRC_DEFAULT (d.h. mit dem identischen Parameter wie beim Request XONTRO Enter Block Price) fest definiert, so dass bis zu MAX_NO_PRC_DEFAULT Rücknahmen von Kursaussetzungen unter allen Umständen akzeptiert werden.

Eine Applikation sollte beim ersten Aufruf dieses Request nach einem Login nicht mehr als MAX_NO_PRC_DEFAULT Rücknahmen von Kursaussetzungen mitgeben. Die Nachricht wird bei dieser Parametrisierung in jedem Fall verarbeitet. Die Response enthält dann den Maximalwert für die Anzahl Rücknahmen von Kursaussetzungen, die in einem Request zurzeit verschickt werden dürfen.

In der Response wird die Reaktion auf alle Rücknahmen von Kursaussetzungen mitgeteilt. Dabei entspricht die Reihenfolge der errCods in der Response derjenigen der Rücknahmen der Kursaussetzungen im Request. Jedem errCod wird die korrespondierende ISIN (isinCod) aus dem Request vorangestellt.

Ein errCod = 0 bedeutet eine einwandfreie Ausführung. In allen anderen Fällen entspricht die Belegung der des Completion Code.

Das Feld maxNoPrc muss ausgewertet werden. Es enthält die zurzeit maximal zulässige Anzahl von Rücknahmen von Kursaussetzungen für eine Nachricht.

Wird diese Zahl beim nächsten Request überschritten, dann erhält die Applikation den Completion Code ELB_BC_MAXIMUM_NUMBER_EXCEEDED.

Eine ISIN darf nur einmal innerhalb einer Nachricht übermittelt werden. Wird diese Bedingung nicht eingehalten, dann erhält die Anwendung ab dem zweiten Auftreten der ISIN den Fehlercode ELB_BC_DUPLICATE_ISIN (im korrespondierenden errCod) für alle Wiederholungen.

Alle Rücknahmen von Kursaussetzungen, die vom Back End akzeptiert wurden, werden dem Front End mit **einem einzigen Broadcast** vom Subtyp **BCFE_REACTIVATE_PRICING_BLOCK** zur Verfügung gestellt.

Im Fall der Rücknahme der Kursaussetzung mit Übermittlung eines umsatzlosen Kurses wird zusätzlich der Broadcast BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE an den skontroführenden Makler übermittelt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 63
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

qsamRequestId →	BC_REACTIVATE_PRICING_BLOCK_RID	
Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	<i>bis zu 30 Einträge:</i> bc_request_rea_pricing_blockT	isinCod ^{m*} processingCod ^{m*} tradMtchCod ^{o*} tradMtchPrc ^{o*} trdResTypCod ^{o*} deactFromDat ^{o*} deactToDat ^{o*} deactComment ^{o*} deactText ^{o*}
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_pricing_block_noT	maxNoPrc
	<i>bis zu 30 Einträge:</i> bc_response_pricing_blockT	isinCod* errCod*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 64
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.9.5 XONTRO Enter Special Right

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Special Right** dient dem skontroführenden Makler dazu, ein Nebenrecht für eine bestimmte Gattung einzustellen.

Die Art des Nebenrechtes wird im Feld nrCod verschlüsselt. Die gültigen Schlüssel sind in der Feldbeschreibung aufgeführt.

Nebenrechte für den aktuellen Börsentag können nur bis Börsenbeginn eingestellt werden.

Wenn ein Nebenrecht die Löschung von Orders zur Folge hat, wird die Löschung unmittelbar nach Verarbeitung des Requests für den aktuellen Börsentag durchgeführt. Die Löschung ist unwiderruflich.

Tritt bei der Verarbeitung des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird ein Broadcast vom Subtype BCFE_ENTER_SP_RIGHT verschickt.

qsamRequestId → BC_ENTER_SP_RIGHT_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_sp_rightT	nrCod ^m isinCod ^m isinCodNew ^o ordrExePrcMod ^o nrDat ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 65
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

bc_response_headerT

tranDat
tranTim
execTranDat
execTranTim
errFieldRef
inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 66
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.10 Bestandsinformationen Orders

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsinformationen:

qsamStreamId	BC_INQUIRE_ORDERS_STREAM_TYPE
qsamMsgType	I = Bestandstransfer (Initialbestand)
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	bKeyInq
Bestandstransfer Queue	XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_response_inq_ordT)
qsamStreamId	BC_INQUIRE_SPECIAL_ORDERS_STREAM_TYPE
qsamMsgType	I = Bestandstransfer (Initialbestand)
Correlation ID	qsamDate + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	bKeyInq
Bestandstransfer Queue	XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_nrT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 67
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.10.1 XONTRO Inquire Orders

Beschreibung Der Stream **BC_INQUIRE_ORDERS_STREAM_TYPE** liefert dem Front End den verbindlichen Orderbestand zum Zeitpunkt des Abschlusses des vorherigen Börsentags. Dieser Orderbestand ist gleichzeitig der Initialbestand des aktuellen Börsentages. Die dezentralen Bestände des Maklersystems können mit den Bestandsdaten abgeglichen werden, um so zu Beginn eines neuen Börsentages die Konsistenz der dezentralen Bestände sicherzustellen.

Der Stream liefert mehrere Orders in einer Nachricht. Die tatsächliche Länge kann über das Längengeld der Antwort (MQ Layer) ermittelt werden. Die Nachricht muss von der Anwendung in Einzelorders aufgeteilt werden. Die erste Nachricht wird mit `bKeyInq = 1` geliefert. Alle Folgenachrichten enthalten eine lückenlos aufsteigende Sequenz-Nummer.

Sind noch keine Bestandsdaten vorhanden, dann erhält die Applikation den Zugriffsfehler des MQ-Layers. Die Applikation kann den Lesezugriff zu einem späteren Zeitpunkt wiederholen.

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType `BCBE_ORDERS_END` feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn für eine KV-Nummer keine Orders vorliegen. Im Standardfall ist das Feld subType mit `BCBE_ORDER` belegt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 68
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamStreamId → BC_INQUIRE_ORDERS_STREAM
_TYPE

Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_key_inquireT	bKeyInq
	mehrfach	
	bc_subTypeT	subType*
	bc_response_inq_ordT	acctTypCodXontro* bkrNo* buyCod* ctpyNo* fwdOrdNo* isinCod* isinCodSrs* ordrBegDatCod* ordrEntNo* ordrExePrc* ordrExpDat* ordrNo* ordrQty* ordrResCod* ordrStopLim* text* trdResTypCod* userNo* userOrdNum* netTypCodXontro*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 69
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.10.2 XONTRO Inquire Special Order Updates

Beschreibung Der Stream **BC_INQUIRE_SPECIAL_ORDERS_STREAM_TYPE** liefert dem Front End die Orders, die im Rahmen der Nebenrechtsverarbeitung in der Tagesende-verarbeitung des letzten vorhergegangenen Börsentags geändert oder gelöscht wurden. Orderänderungen bzw. Orderlöschungen, die im Rahmen des - der Tagesende-verarbeitung vorausgehenden - Buchungsschnitts erzeugt wurden, werden über die Subtypes **BCBE_MODIFY_ORDER_N** bzw. **BCBE_DELETE_ORDER_N** des **BC_PRIVATE_ORDER_UPDATE_STREAM_TYPE** verteilt.

Der Stream liefert mehrere Orders in einer Nachricht. Die tatsächliche Länge kann über das Längelfeld der Antwort (MQ Layer) ermittelt werden. Die Nachricht muss von der Anwendung in Einzelorders aufgeteilt werden. Die erste Nachricht wird mit **bKeyInq = 1** geliefert. Alle Folgenachrichten enthalten eine lückenlos aufsteigende Sequenz-Nummer.

Sind noch keine Bestandsdaten vorhanden, dann erhält die Applikation den Zugriffsfehler des MQ Layers. Die Applikation kann den Lesezugriff zu einem späteren Zeitpunkt wiederholen.

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType **BCBE_SPECIAL_END** feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn für eine KV-Nummer keine gelöschten oder geänderten Orders vorliegen. Im Standardfall ist subType mit **BCBE_ORDER_DELETED_N** belegt.

qsamStreamId → BC_INQUIRE_SPECIAL_ORDERS_STREAM_TYPE

Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_key_inquireT	bKeyInq
	mehrfach	
	bc_subTypeT	subType*
	bc_nrT ⁷	nrCod* ordrExePrc* ordrNo* userNo*

⁷ Die Struktur bc_nrT wird sowohl bei Broadcasts als auch bei Requests/Responses verwendet.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 70
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11 Aktualisierung des Orderbestands, der Kursinformation und der Quotes

Die folgenden Tabellen beschreiben die Subtypes und Datenstrukturen der Broadcasts.

qsamStreamId	BC_PRIVATE_ORDER_UPDATE_STREAM_TYPE
qsamMsgId	B = Broadcast
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	outSeqNo
Broadcast Queue	XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + (eine der Strukturen vom Typ bc_orderT, bc_brd_mod_orderT, bc_brd_del_orderT, bc_nrT, bc_brd_pend_ent_orderT, bc_brd_pend_mod_orderT, bc_brd_pend_del_orderT, bc_brd_ent_priceT, bc_brd_ent_price_plusT, bc_brd_lockT, bc_brd_unlockT, bc_brd_finish_pricingT, bc_brd_ent_quoteT, bc_brd_deact_quoteT, bc_brd_ent_price_manT, bc_brd_ent_block_priceT, bc_brd_ent_quote_feT, bc_brd_deact_quote_feT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 71
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.11.1 XONTRO Order Update

Beschreibung Der Stream **XONTRO Order Update** versorgt das Front End mit allen relevanten, auf dem Back End veranlassten Orderänderungen, Kursfeststellungen und Kurskorrekturen, Sperrungen und Ende der Nachbearbeitung eines nicht ausgeglichenen Kurses, sowie den Eingaben und Löschungen von Quotes.

Lediglich die Ausführungsbestätigungen müssen über einen anderen Broadcaststream angefordert werden.

Zusätzlich werden alle Orderneueinstellungen, Orderänderungen und Orderlöschungen, die über das Front End eingestellt wurden, noch einmal in diesem Stream übermittelt.

Entsprechend den unterschiedlichen sachlichen Inhalten werden auch unterschiedliche Formate angeliefert, die über den Stream Subtype (subType) unterschieden werden können.

Subtype	Verwendung
BCBE_ENTER_ORDER (SKM)	Ordereinstellung für einen Skontroführer (via Back End)
BCBE_ENTER_ORDER_FM (FM)	Ordereinstellung für einen Freimakler (via Back End)
BCBE_PEND_ENTER_ORDER (SKM)	Ordereinstellung für einen Skontroführer während Sperre (via Back End)
BCBE_REJ_ENTER_ORDER (SKM)	Endgültige Ablehnung einer Ordereinstellung während Sperre für einen Skontroführer (via Back End)
BCFE_ENTER_ORDER (FM)	Nach einer Sperre erfolgreiche Ordereinstellung für einen Freimakler (via Front End)
BCFE_ENTER_ORDER_DIR (FM)	Sofort erfolgreiche Ordereinstellung des Front Ends eines Freimakler (via Front End)
BCFE_REJ_ENTER_ORDER (FM)	Abgelehnte Ordereinstellung für einen Freimakler (via Front End)
BCFE_ENTER_ORDER_SKM (SKM)	Ordereinstellung für einen Skontroführer (via Front End)
BCBE_MODIFY_ORDER	Orderänderung (via Back End)
BCBE_MODIFY_SBSL	Umsetzung von Stop Orders am Back End
BCBE_PEND_MODIFY_ORDER (SKM)	Vorläufige Änderung einer Order des Skontroführers (via Back End)

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 72
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Subtype	Verwendung
BCBE_CONFIRM_MODIFY_ORDER (SKM)	Endgültige Annahme einer Orderänderung für den Skontroführer (via Back End)
BCFE_MODIFY_ORDER (FM)	Nach einer Sperre erfolgreiche Änderung der Order eines Freimaklers (via Front End)
BCFE_MODIFY_ORDER_DIR (FM)	Sofort erfolgreiche Änderung der Order eines Freimaklers (via Front End)
BCFE_REJ_MODIFY_ORDER (FM)	Abgelehnte Orderänderung der Order eines Freimaklers (via Front End)
BCFE_MODIFY_ORDER_SKM (SKM)	Orderänderung für den Skontroführer (via Front End)
BCBE_DELETE_ORDER	Orderlöschung (via Back End)
BCBE_PEND_DELETE_ORDER (SKM)	Vorläufige Löschung einer Order des Skontroführers (via Back End)
BCBE_CONFIRM_DELETE_ORDER (SKM)	Endgültige Annahme einer Orderlöschung des Skontroführers (via Back End)
BCFE_DELETE_ORDER (FM)	Nach einer Sperre erfolgreiche Löschung der Order eines Freimaklers (via Front End)
BCFE_DELETE_ORDER_DIR (FM)	Sofort erfolgreiche Löschung der Order eines Freimaklers (via Front End)
BCFE_REJ_DELETE_ORDER (FM)	Abgelehnte Orderlöschung der Order eines Freimaklers (via Front End)
BCFE_DELETE_ORDER_SKM (SKM)	Orderlöschung für den Skontroführer (via Front End)
BCBE_MODIFY_ORDER_N	Orderänderung wegen Nebenrecht
BCBE_DELETE_ORDER_N	Orderlöschung wegen Nebenrecht
BCBE_LOCK_ORDERS (SKM)	Sperren (via Back End)
BCFE_LOCK_ORDERS (SKM)	Sperren (via Front End)
BCBE_UNLOCK_ORDERS (SKM)	Entsperren (via Back End)
BCFE_UNLOCK_ORDERS (SKM)	Entsperren (via Front End)
BCBE_ENTER_PRICE (SKM)	Kursfeststellung (via Back End)

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 73
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Subtype	Verwendung
BCFE_ENTER_PRICE (SKM)	Kursfeststellung (via Front End)
BCBE_ADD_POSITION (SKM)	Eingabe Halbes Geschäft (via Back End)
BCFE_ADD_POSITION (SKM)	Eingabe Halbes Geschäft (via Front End)
BCBE_MODIFY_EXECUTION (SKM)	Teilausführung (via Back End)
BCFE_MODIFY_EXECUTION (SKM)	Teilausführung (via Front End)
BCBE_FINISH_PRICING (SKM)	Ende Nachbearbeitung ⁸ (via Back End)
BCFE_FINISH_PRICING (SKM)	Ende Nachbearbeitung ⁹ (via Front End)
BCBE_ENTER_QUOTE (SKM)	Eingabe einer Quote/Taxe/Spanne (via Back End)
BCBE_DEACTIVATE_QUOTE (SKM)	Deaktivierung/Löschung einer Quote (via Back End)
BCBE_ENTER_PRICE_TAB (SKM)	Kursfeststellung tabellarisch
BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_TAB (SKM)	Kurskorrektur tabellarisch
BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE (SKM)	geblockte Kurseingabe über das Front End
BCBE_ENTER_PRICE_MAN (SKM)	Kurseingabe manuell
BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_MAN (SKM)	Kursänderung manuell
BCFE_ENTER_QUOTE (SKM)	Eingabe einer Quote (via Front End)
BCFE_DEACTIVATE_QUOTE (SKM)	Deaktivierung/Löschung einer Quote (via Front End)

Die mit einem **(FM)** markierten Subtypes werden nur einem Freimakler zugestellt, die mit einem **(SKM)** markierten nur einem skontroführenden Makler.

⁸ Die Nachricht wird verschickt, wenn der festgestellte Kurs Teilausführungen zulässt und Umsätze zu diesem Kurs vorliegen (bG, bB, ratG,... etc.)

⁹ Die Nachricht wird immer verschickt, wenn der Abschluss der Nachbearbeitung durch den Request Xontro Finish Pricing erfolgt.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 74
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1 Ordereinstellung für einen Skontroführer (via Back End)

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_ENTER_ORDER** werden die Systeme eines skontroführenden Maklers mit Nachrichten hinsichtlich der auf dem Back End durch die Dialoganwendung und den Systemanschluss Banken neu eingestellten Bank-, SKM- und FM-Orders versorgt.

Stellt ein Freimakler über den Systemanschluss Makler eine Order an einen skontroführenden Makler ein, dann wird das Front End des **skontroführenden Maklers** hierüber mit diesem Broadcast informiert.

Im Feld lockTim wird der Zeitpunkt des Setzens der letzten Sperre hinterlegt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_pend_ent_orderT	acctTypCodXontro bkrNo buyCod ctpyNo fwdOrdrNo isinCod ¹⁰ isinCodSrs ordrBegDatCod ordrEntNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty

¹⁰ Aus Kompatibilitätsgründen sowohl in bc_brd_pend_ent_orderT als auch bc_response_headerT enthalten.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind gelb hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 75
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

*Diese Struktur wird auf der
folgenden Seite fortgesetzt*

ordrResCod
ordrStopLim
text
trdResTypCod
userNo
userOrdNum
netTypCodXontro
lockTim
regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 76
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.2 Ordereinstellung für einen Freimakler (via Back End)

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_ENTER_ORDER_FM** werden die Systeme eines Freimaklers mit Nachrichten hinsichtlich der auf dem Back End durch die Dialoganwendung und den Systemanschluss Banken neu eingestellten Bank und FM-Orders versorgt.

Im Fall der automatischen Orderweiterleitung eines Freimaklers wird für den Freimakler nur eine Nachricht erzeugt. In diesem Fall ist im Feld (fwdOrdrNo) die DWZ-Ordernummer der Originalorder hinterlegt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_orderT	acctTypCodXontro bkrNo buyCod ctpyNo fwdOrdrNo isinCod ¹¹ isinCodSrs ordrBegDatCod ordrEntNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrResCod

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

¹¹ Aus Kompatibilitätsgründen sowohl in bc_orderT als auch bc_response_headerT enthalten.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 77
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

ordrStopLim
text
trdResTypCod
userNo
userOrdNum
netTypCodXontro
regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 78
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.11.1.3 Ordereinstellung für einen Skontroführer während Sperre (via Back End)

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_PEND_ENTER_ORDER** erhalten die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers Nachrichten über Orderzugänge, die während einer Sperre eingehen. Die Nachricht wird sofort bei Eingang einer Order verschickt. Die Orders können dabei über die Dialoganwendung, den Systemanschluss Banken oder im Fall eines Freimaklers auch über den Systemanschluss Makler eingestellt werden.

Im Feld lockTim wird der Zeitpunkt des Setzens der Sperre hinterlegt.

Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_pend_ent_orderT	acctTypCodXontro bkrNo buyCod ctpyNo fwdOrdrNo isinCod ¹² isinCodSrs ordrBegDatCod ordrEntNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

¹² Aus Kompatibilitätsgründen sowohl in bc_orderT als auch bc_response_headerT enthalten.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 79
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

ordrQty
ordrResCod
ordrStopLim
text
trdResTypCod
userNo
userOrdNum
netTypCodXontro
lockTim
regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 80
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.4 Endgültige Ablehnung einer Ordereinstellung während Sperre für einen Skontroführer (via Back End)

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_REJ_ENTER_ORDER** wird ein skontroführender Makler darüber informiert, dass eine während Sperre für ihn eingestellte Order wegen einer besonderen Konstellation wieder verworfen wurde (z.B. tagesgültige Order zum ersten Kurs, die während Sperre zum ersten Kurs einging).

Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_del_orderT	ordrNo userNo ordrQty ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 81
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.5 Nach einer Sperre erfolgreiche Ordereinstellung für einen Freimakler (via Front End)

Beschreibung Geht eine am Front End eingestellte Order am Back End während der Sperre des Orderbuchs ein, dann wird sie nach Aufhebung der Sperre erneut geprüft. Akzeptierte Orders werden nach Sperre über den Subtype **BCFE_ENTER_ORDER** zugestellt.

Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_orderT	acctTypCodXontro bkrNo buyCod ctpyNo fwdOrdrNo isinCod isinCodSrs ordrBegDatCod ordrEntNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrResCod ordrStopLim text trdResTypCod userNo userOrdNum netTypCodXontro regulatoryID

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 82
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.6 Sofort erfolgreiche Ordereinstellung des Front Ends eines Freimakler (via Front End)

Beschreibung Kann eine am Front End eingestellte Order am Back End direkt verarbeitet werden, dann wird zusätzlich zur synchronen Antwort ein Broadcast vom Subtype **BCFE_ENTER_ORDER_DIR** zugestellt.

Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_orderT	acctTypCodXontro bkrNo buyCod ctpyNo fwdOrdrNo isinCod isinCodSrs ordrBegDatCod ordrEntNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrResCod ordrStopLim text trdResTypCod userNo userOrdNum netTypCodXontro regulatoryID

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 83
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.7 Abgelehnte Ordereinstellung für einen Freimakler (via Front End)

Beschreibung Geht eine am Front End eingestellte Order am Back End während der Sperre des Orderbuchs ein, dann wird sie nach Aufhebung der Sperre – soweit möglich - eingestellt. Verworfen Orders (Ausnahmen, z.B. eine tagesgültige Order zum ersten Kurs, die während Sperre zum ersten Kurs einging) werden über den Subtype **BCFE_REJ_ENTER_ORDER** zugestellt.

Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_orderT	acctTypCodXontro bkrNo buyCod ctpyNo fwdOrdrNo isinCod isinCodSrs ordrBegDatCod ordrEntNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrResCod ordrStopLim Text trdResTypCod userNo userOrdNum netTypCodXontro regulatoryID

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 84
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.8 Ordereinstellung für einen Skontroführer (via Front End)

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_ENTER_ORDER_SKM** erhalten die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers Nachricht über Ordereinstellungen, die am Front End getätigt wurden.

Im Feld lockTim wird der Zeitpunkt des Setzens der letzten Sperre hinterlegt.

Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_pend_ent_orderT	acctTypCodXontro bkrNo buyCod ctpyNo fwdOrdrNo isinCod isinCodSrs ordrBegDatCod ordrEntNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrResCod ordrStopLim text trdResTypCod userNo userOrdNum netTypCodXontro lockTim

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 85
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

regulatoryID

2.1.11.1.9 Orderänderung (via Back End)

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_MODIFY_ORDER** werden die Maklersysteme mit Nachrichten hinsichtlich der auf dem Back End durch die Dialoganwendung und den Systemanschluss Banken geänderten Bank-, SKM- und FM-Orders versorgt. Die Änderung einer Order durch das Back End wird nur dann an das Front End weitergeleitet, wenn auch solche Informationen geändert wurden, die dem Makler zur Verfügung gestellt werden. Werden ausschließlich Informationen geändert, die nur für die Bankseite bestimmt sind, dann wird dem Front End keine Nachricht zugestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_mod_orderT	ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrStopLim text userNo ctpyNo ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 86
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.10 Umsetzung einer Stop Order durch das Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_MODIFY_SBSL** werden die Maklersysteme mit Nachrichten hinsichtlich der Umsetzung einer Stop-Loss und Stop-Buy Order durch das Xontro Back End auf „bestens“ bzw. „billigst“ versorgt. Dieser Subtype kann alternativ zum bisher bei diesem Ereignis versendeten Subtype BCBE_MODIFY_ORDER im Rahmen des Profiling ausgewählt werden.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_mod_orderT	ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrStopLim text userNo ctpyNo ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 87
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.11 Vorläufige Änderung einer Order des Skontroführers (via Back End)

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_PEND_MODIFY_ORDER** werden dem Front End eines skontroführenden Maklers Orderänderungen mitgeteilt, die nicht endgültig festgeschrieben werden können und/oder die während einer Sperre des Orderbuchs eingegangen sind. Änderungen können nicht festgeschrieben werden, wenn eine Order betroffen ist, die zur letzten Kursfeststellung bereits vorhanden war und der Kurs dieser Kursfeststellung noch korrigiert werden kann. In diesem Fall ist das pendFlag mit dem Status „vorläufig“ versorgt. Die Felder lockFlag und lockTim können gesetzt sein, wenn die Änderung zusätzlich während einer Sperre eingegangen ist. Liegt lediglich ein Eingang des Auftrags während Sperre vor und ist der letzte Kurs nicht mehr korrigierbar oder eine Order betroffen, die erst nach dem letzten Kurs einging, dann ist pendFlag mit dem Status „endgültig“ versorgt. Ein Änderungsauftrag wird auch dann übermittelt, wenn eine Order von der letzten Kursfeststellung betroffen ist. Es ist Sache des Front Ends, dies festzustellen und geeignet zu reagieren.

Wird eine Änderung endgültig durchgeführt, dann erhält das Front End einen Broadcast BCBE_CONFIRM_MODIFY_ORDER.

Die Änderung einer Order wird vom Back End nur dann an das Front End übermittelt, wenn Informationen geändert wurden, die dem Makler zur Verfügung gestellt werden. Werden ausschließlich Informationen geändert, die nur für die Bankseite bestimmt sind, dann wird dem Front End keine Nachricht zugestellt.

Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 88
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_pend_mod_orderT	ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrStopLim text userNo lockTim lockFlag pendFlag ctpyNo regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 89
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.12 Endgültige Annahme einer Orderänderung für den Skontroführer (via Back End)

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_CONFIRM_MODIFY_ORDER** wird dem Front End eines skontroführenden Maklers mitgeteilt, dass eine über den Subtype **BCBE_PEND_MODIFY_ORDER** zugestellte vorläufige Änderung endgültig festgeschrieben (also durchgeführt) wird.

Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_mod_orderT	ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrStopLim text userNo ctpyNo ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 90
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.13 Nach einer Sperre erfolgreiche Änderung der Order eines Freimaklers (via Front End)

Beschreibung Geht eine am Front End eingestellte Orderänderung am Back End während der Sperre des Orderbuchs ein, dann wird sie nach Aufhebung der Sperre erneut geprüft. Akzeptierte Orderänderungen werden über den Subtype **BCFE_MODIFY_ORDER** zugestellt.

Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_mod_orderT	ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrStopLim text userNo ctpyNo ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 91
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.14 Sofort erfolgreiche Änderung der Order eines Freimaklers (via Front End)

Beschreibung Kann eine am Front End eingestellte Orderänderung am Back End direkt verarbeitet werden, dann wird zusätzlich zur synchronen Antwort ein Broadcast vom Subtype **BCFE_MODIFY_ORDER_DIR** zugestellt.

Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_mod_orderT	ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrStopLim text userNo ctpyNo ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 92
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.15 Abgelehnte Orderänderung der Order eines Freimaklers (via Front End)

Beschreibung Geht eine am Front End eingestellte Orderänderung am Back End während der Sperre des Orderbuchs ein, dann wird sie nach Aufhebung der Sperre erneut geprüft. Ist die Änderung nicht mehr möglich (z.B. Order ist ausgeführt), dann wird die abgelehnte Orderänderung über den Subtype **BCFE_REJ_MODIFY_ORDER** zugestellt.

Der Broadcast enthält den gültigen (unveränderten) Zustand der Order; die Änderungen sind nicht durchgeführt.

Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_orderT	acctTypCodXontro bkrNo buyCod ctpyNo fwdOrdrNo isinCod isinCodSrs ordrBegDatCod ordrEntNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrResCod ordrStopLim

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 93
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

*Diese Struktur wird auf der
folgenden Seite fortgesetzt*

text
trdResTypCod
userNo
userOrdNum
netTypCodXontro
regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 94
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.16 Änderung einer Order des Skontroführers (via Front End)

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_MODIFY_ORDER_SKM** erhalten die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers Nachricht über Orderänderungen, die am Front End getätigt wurden.

Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_mod_orderT	ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrStopLim text userNo ctpyNo ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 95
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.17 Orderlöschung (via Back End)

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_DELETE_ORDER** werden die Maklersysteme mit Nachrichten hinsichtlich der auf dem Back End durch die Dialoganwendung und den Systemanschluss Banken gelöschten Bank-, SKM- und FM-Orders versorgt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_del_orderT	ordrNo userNo ordrQty ¹³ ordrStatCod regulatoryID

¹³ In Xontro kann es im Rahmen der Kursfeststellung zu Orderteillöschungen kommen. In diesem Fall liefert das Feld ordrQty nicht die aktuelle Nominale, sondern die gelöschte Teilnominale der Order. Über den Streamtype BC_PRIVATE_ORDER_EXECUTION_UPDATE_STREAM_TYPE wird nur die ausgeführte Nominale geliefert.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 96
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.11.1.18 Vorläufige Löschung einer Order des Skontroführers (via Back End)

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_PEND_DELETE_ORDER** werden dem Front End eines skontroführenden Maklers Orderlöschungen mitgeteilt, die nicht endgültig festgeschrieben werden können und/oder während einer Sperre des Orderbuchs eingegangen sind. Löschungen können nicht festgeschrieben werden, wenn eine Order betroffen ist, die zur letzten Kursfeststellung bereits vorhanden war und der Kurs dieser Kursfeststellung noch korrigiert werden kann. In diesem Fall ist das pendFlag mit dem Status „vorläufig“ versorgt. Die Felder lockFlag und lockTim können gesetzt sein, wenn die Löschung zusätzlich während einer Sperre eingegangen ist. Liegt lediglich ein Eingang des Auftrags während Sperre vor und ist der letzte Kurs nicht mehr korrigierbar oder eine Order betroffen, die erst nach dem letzten Kurs einging, dann ist pendFlag mit dem Status „endgültig“ versorgt. Ein Löschauftrag wird auch dann übermittelt, wenn eine Order von der letzten Kursfeststellung betroffen ist. Es ist Sache des Front Ends, dies festzustellen und geeignet zu reagieren.

Wird eine Löschung endgültig durchgeführt, dann erhält das Front End einen Broadcast **BCBE_CONFIRM_DELETE_ORDER**.

Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_pend_del_orderT	ordrNo userNo lockTim lockFlag pendFlag regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 97
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.19 Endgültige Annahme einer Orderlöschung des Skontroführers (via Back End)

Beschreibung Wird eine über den Subtype **BCBE_PEND_DELETE_ORDER** zugestellte vorläufige Löschung endgültig festgeschrieben (also durchgeführt), dann wird dem Front End eines skontroführenden Maklers die endgültige Festschreibung über den Subtype **BCBE_CONFIRM_DELETE_ORDER** mitgeteilt.

Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_del_orderT	ordrNo userNo ordrQty ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 98
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.11.1.20 Nach einer Sperre erfolgreiche Löschung der Order eines Freimaklers (via Front End)

Beschreibung Geht eine am Front End eingestellte Orderlöschung am Back End während der Sperre des Orderbuchs ein, dann wird sie nach Aufhebung der Sperre erneut geprüft. Akzeptierte Orderlöschungen werden über den Subtype **BCFE_DELETE_ORDER** gestellt.

Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_del_orderT	ordrNo userNo ordrQty ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 99
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.21 Sofort erfolgreiche Löschung der Order eines Freimaklers (via Front End)

Beschreibung Kann eine am Front End eingestellte Orderlöschung am Back End direkt verarbeitet werden, dann wird zusätzlich zur synchronen Antwort ein Broadcast vom Subtype **BCFE_DELETE_ORDER_DIR** zugestellt.

Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_del_orderT	ordrNo userNo ordrQty ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 100
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.11.1.22 Abgelehnte Orderlöschung der Order eines Freimaklers (via Front End)

Beschreibung Geht eine am Front End eingestellte Orderänderung am Back End während der Sperre des Orderbuchs ein, dann wird sie nach Aufhebung der Sperre erneut geprüft. Verworfenen Orderlöschungen werden über den Subtype **BCFE_REJ_DELETE_ORDER** zugestellt. Der Broadcast enthält den gültigen (unveränderten) Zustand der Order; die Löschung ist nicht durchgeführt.

Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_orderT	acctTypCodXontro bkrNo buyCod ctpyNo fwdOrdrNo isinCod isinCodSrs ordrBegDatCod ordrEntNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrResCod ordrStopLim text

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 101
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

*Diese Struktur wird auf der
folgenden Seite fortgesetzt*

trdResTypCod
userNo
userOrdNum
netTypCodXontro
regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 102
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.23 Löschung einer Order des Skontroführers (via Front End)

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_DELETE_ORDER_SKM** erhalten die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers Nachricht über Orderlöschungen, die am Front End getätigt wurden.

Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_del_orderT	ordrNo userNo ordrQty ordrStatCod regulatoryID

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 103
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.24 Orderänderung wegen Nebenrecht

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_MODIFY_ORDER_N** werden die Maklersysteme mit Nachrichten zu denjenigen Orders versorgt, die im Rahmen der untertägigen Nebenrechtsverarbeitung oder des Buchungsschnitts geändert wurden.

Orderänderungen, die im Rahmen der Tagesendeverarbeitung erzeugt wurden, werden im Stream **BC_INQUIRE_SPECIAL_ORDERS_STREAM_TYPE** geliefert.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_nrT	nrCod ordrExePrc ordrNo userNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 104
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.25 Orderlöschung wegen Nebenrecht

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_DELETE_ORDER_N** werden die Maklersysteme mit Nachrichten der Orders versorgt, die im Rahmen der untertägigen Nebenrechtsverarbeitung oder des Buchungsschnitts gelöscht wurden.

Orderlöschungen, die im Rahmen der Tagesendeverarbeitung erzeugt wurden, werden im Stream **BC_INQUIRE_SPECIAL_ORDERS_STREAM_TYPE** geliefert..

Die Datenstruktur entspricht der Orderänderung wegen Nebenrecht (bc_qsambroadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + bc_nrT).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 105
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.26 Sperren durch das Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_LOCK_ORDERS** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über das Sperren eines Orderbuchs auf dem Back End informiert.

Im Feld lockTim wird der Zeitpunkt des Setzens der Sperre hinterlegt. Das Feld trdResTypCod enthält die Kursart, für die das Orderbuch gesperrt wurde. Im Feld userNo wird die Eingabe-ID übermittelt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_unlockT	lockTim trdResTypCod userNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 106
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.11.1.27 Sperren durch das Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_LOCK_ORDERS** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über die Sperrung des Orderbuchs durch das Front End informiert.

Die Sperre wird durch eine Reservierung der Kursfeststellung mittels des Requests **XONTRO Start Pricing** ausgelöst.

Im Feld lockTim wird der Zeitpunkt des Setzens der Sperre hinterlegt. Im Feld ticket wird der eindeutige Schlüssel der Reservierung geliefert. Das Feld trdResTypCod enthält die Kursart, für die das Orderbuch gesperrt wurde. Im Feld userNo wird die Eingabe-ID übermittelt.

Mit der Nachricht wird sichergestellt, dass das Front End bis zum Erhalt dieses Broadcasts alle Orderbuch-relevanten Informationen, die vor der Sperre des Orderbuchs liegen, erhalten hat.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_lockT	lockTim ticket ¹⁴ trdResTypCod userNo

¹⁴ Wird der Broadcasts an mehrere MISS-Installationen verschickt, so wird das gültige Ticket nur an die MISS verschickt, welche den Request XONTRO Start Pricing durchgeführt hat. Bei den anderen MISS-Installationen ist das Feld „ticket“ mit dem Initialwert belegt.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind gelb hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 107
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.28 Entsperrn durch das Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_UNLOCK_ORDERS** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über das Entsperrn eines Orderbuchs auf dem Back End informiert. Diese Nachricht wird nur erzeugt, wenn **kein Kurs** festgestellt wurde. Im Feld lockTim wird der Zeitpunkt des Setzens der Sperre hinterlegt.

Das Feld trdResTypCod enthält die Kursart, für die das Orderbuch entsperrt wurde. Im Feld userNo wird die Eingabe-ID übermittelt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_unlockT	lockTim trdResTypCod userNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 108
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.29 Entsperrungen durch das Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_UNLOCK_ORDERS** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über das Entsperrungen des Orderbuchs durch das Front End informiert.

Das Entsperrungen wird durch die Stornierung einer Reservierung mittels des Requests **XONTRO Cancel Pricing** ausgelöst.

Diese Nachricht wird nur erzeugt, wenn am Front End **kein Kurs** gestellt wurde und die Reservierung mit dem Request Xontro Cancel Pricing storniert wurde.

Im Feld lockTim wird der Zeitpunkt des Setzens der Sperre hinterlegt.

Das Feld trdResTypCod enthält die Kursart, für die das Orderbuch entsperrt wurde. Im Feld userNo wird die Eingabe-ID übermittelt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_unlockT	lockTim trdResTypCod userNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 109
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.30 Kursfeststellung am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_ENTER_PRICE** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über die auf dem Back End durchgeführten Kursfeststellungen informiert.

Im Feld lockTim ist der Zeitpunkt des Setzens der Sperre hinterlegt.

Im Feld confirmTim ist der für die Synchronisierung erforderliche Zeitstempel hinterlegt (siehe Abschnitt „Quoteverwaltung Front End für skontroführende Makler“).

Auf die folgenden Besonderheiten ist zu achten:

Dieser Subtype wurde - ebenso wie die folgenden - eingeführt, um einer Front End Applikation durch die Nachbildung des Kursfeststellungsalgorithmus zeitnah und mit minimalen Informationen eine Bereinigung des Orderbestands zu ermöglichen. Es war nicht geplant, eine vollständige Kurskette im Sinne eines Kursproviders nachzubilden. Folglich werden nicht alle Kurse übermittelt.

Das Feld tradMtchPrcNo ist nicht lückenlos belegt; der Wert des Felds kann für den gleichen Kurs durch eine Nachricht des nachfolgend beschriebenen Subtypes (Korrektur eines Kurses) verändert werden.

Lücken treten z.B. bei Kassakursfeststellungen ohne ersten Kurs, Änderungen der Nummer der Kursfeststellung (tradMtchPrcNo), bei Kassakursfeststellungen mit abweichendem variablen Kurs und deren Korrekturen auf. Sollen Kurse eindeutig identifiziert werden, dann ist statt des Felds tradMtchPrcNo das Feld lockTim heranzuziehen.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_ent_priceT	tradMtchCod tradMtchPrc tradMtchPrcNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 110
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

*Diese Struktur wird auf der
folgenden Seite fortgesetzt*

trdResTypCod
lockTim
confirmTim
ordrBkExeQty
postProcFlag
tradMtchPrcTim
tradMtchPrcTimFraction
tradMtchPrcDat
venueMic

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 111
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.31 Kursfeststellung am Front End (XONTRO Enter Price)

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_ENTER_PRICE** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über die auf dem Front End mittels Request XONTRO Enter Price durchgeführten Kursfeststellungen informiert.

Im Feld lockTim ist der Zeitpunkt des Setzens der Sperre hinterlegt.

Im Feld confirmTim ist der für die Synchronisierung erforderliche Zeitstempel hinterlegt (siehe Abschnitt „Quoteverwaltung Front End für skontroführende Makler“).

Die für den Subtype **BCBE_ENTER_PRICE** geltenden Hinweise sind zu berücksichtigen.

Die Datenstruktur entspricht der Kursfeststellung am Back End (bc_qsambroadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + bc_brd_ent_priceT).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 112
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.32 Kursfeststellung am Front End (XONTRO Enter Price Plus)

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_ENTER_PRICE_PLUS** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über die auf dem Front End mittels Request XONTRO Enter Price Plus durchgeführten Kursfeststellungen informiert.

Im Feld lockTim ist der Zeitpunkt des Setzens der Sperre hinterlegt.

Im Feld confirmTim ist der für die Synchronisierung erforderliche Zeitstempel hinterlegt (siehe Abschnitt „Quoteverwaltung Front End für skontroführende Makler“).

Die für den Subtype **BCBE_ENTER_PRICE** geltenden Hinweise sind zu berücksichtigen.

Der Broadcast **BCFE_ENTER_PRICE_PLUS** enthält alle Informationen, die nach einer Kursfeststellung mittels Request XONTRO Enter Price in den Broadcasts BCFE_LOCK_ORDERS, BCFE_ENTER_PRICE, BCFE_ADD_POSITION, BCFE_FINISH_PRICING enthalten sind.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 113
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_ent_price_plusT	userNo ticket lockTim confirmTim trdResTypCod tradMtchCod tradMtchPrc tradMtchPrcNo tradMtchPrcTim tradMtchPrcTimFraction tradMtchPrcDat ordrBkExeQty postProcFlag ctpyNoBid ctpyNoAsk tradMtchQty feeFlag fee tranFeeFlag tranFee currExcRat inSeqNoRef venueMic

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 114
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.33 Eingabe halbes Geschäft am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_ADD_POSITION** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über ein im Rahmen der Nachbearbeitung am Back End eingegebenes halbes Geschäft informiert.

Das Feld inSeqNoRef ist in diesem Broadcast mit ‚Zero‘ belegt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_add_posT	tradMtchPrcNo buyCod ctpyNo tradMtchQty feeFlag fee tranFeeFlag tranFee inSeqNoRef

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 115
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.34 Eingabe halbes Geschäft am Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_ADD_POSITION** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über ein im Rahmen der Nachbearbeitung vom Front End geschicktes halbes Geschäft informiert.

Im Feld inSeqNoRef wird die Input Sequence Number des korrespondierenden Requests vom Typ **XONTRO Add Position** zurückgegeben.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_add_posT	tradMtchPrcNo buyCod ctpyNo tradMtchQty feeFlag fee tranFeeFlag tranFee inSeqNoRef

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 116
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.35 Teilausführung am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_MODIFY_EXECUTION** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über eine im Rahmen der Nachbearbeitung am Back End eingegebene Teilausführung einer Order informiert.

Das Feld inSeqNoRef ist in diesem Broadcast mit ‚Zero‘ belegt.

Sollten aufgrund mehrfacher Änderungen bei der Teilausführung einer Order mehrere Broadcasts für die gleiche Order geschickt werden, so enthält der letzte Broadcast die aktuellen Daten für diese Order.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_modify_executionT	ordrNo tradMtchPrcNo tradMtchQty inSeqNoRef

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 117
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.36 Teilausführung am Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_MODIFY_EXECUTION** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über eine im Rahmen der Nachbearbeitung vom Front End geschickte Teilausführung einer Order informiert.

Im Feld inSeqNoRef wird die Input Sequence Number des korrespondierenden Requests vom Typ **XONTRO Modify Execution** zurückgegeben.

Sollten mehrere Requests für die gleiche Order geschickt werden, so enthält der Broadcast für den letzten Request die aktuellen Daten.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_modify_executionT	ordrNo tradMtchPrcNo tradMtchQty inSeqNoRef

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 118
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.37 Ende Nachbearbeitung am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_FINISH_PRICING** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über ein auf dem Back End ausgelöstes Ende der Nachbearbeitung einer Kursfeststellung informiert. Die Nachricht wird verschickt, wenn der festgestellte Kurs Teilausführungen zulässt und Umsätze zu diesem Kurs vorliegen (bG, bB, ratG, etc.).

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_finish_pricingT	tradMtchCod tradMtchPrc tradMtchPrcNo trdResTypCod currExcRat

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 119
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.38 Ende Nachbearbeitung am Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_FINISH_PRICING** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über ein auf dem Front End ausgelöstes Ende der Nachbearbeitung einer Kursfeststellung informiert. Die Nachricht wird immer verschickt, wenn die Nachbearbeitung durch den Request XONTRO Finish Pricing erfolgreich abgeschlossen wurde.

Die Datenstruktur entspricht der Ende Nachbearbeitung am Back End (bc_qsambroadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + bc_brd_finish_pricingT).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 120
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.39 Eingabe von Quotes am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_ENTER_QUOTE** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über die auf dem **Back End** eingegebenen Quotes (Taxen und Spannen) informiert.

Im Feld confirmTim ist der für die Synchronisierung erforderliche Zeitstempel hinterlegt (siehe Abschnitt „Eingabe von Quotes am Front End“).

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_ent_quoteT	quoteType quoteStatus odrExePrcAsk odrQtyAsk odrVolAsk odrExePrcBid odrQtyBid odrVolBid confirmTim quoteTimeStamp

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 121
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.40 Deaktivierung von Quotes am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_DEACTIVATE_QUOTE** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über die auf dem Back End durchgeführten Deaktivierungen (Löschungen) informiert.

Im Feld confirmTim ist der für die Synchronisierung erforderliche Zeitstempel hinterlegt. Wird der Wert BC_DO_NOT_CONFIRM geliefert, ist keine Synchronisierung erforderlich (siehe Abschnitt „Eingabe von Quotes am Front End“).

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_deact_quoteT	confirmTim quoteTimeStamp

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 122
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.41 Tabellarische Kursfeststellung

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_ENTER_PRICE_TAB** werden tabellarisch erfasste Kurse übermittelt. Die Kurse sind umsatzlos, zum Zeitpunkt der Erfassung darf kein ausführbares Volumen vorgelegen haben.

Zu beachten ist, dass Kurse mit den Zusätzen „_“, „_G“, „_B“ mit einem Kurs 0 (tradMtchPrc) übermittelt werden. Das Feld ordrBkExeQty ist immer mit 0 belegt.

Die Datenstruktur entspricht der Kursfeststellung am Back End (bc_qsambroadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + bc_brd_ent_priceT).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 123
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.42 Tabellarische Kursänderung

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_TAB** werden tabellarisch erfasste Kursänderungen übermittelt. Die Kurse sind umsatzlos, zum Zeitpunkt der Erfassung darf kein ausführbares Volumen vorgelegen haben.

Zu beachten ist, dass Kurse mit den Zusätzen „_“, „_G“, „_B“ mit einem Kurs 0 (tradMtchPrc) übermittelt werden. Das Feld ordrBkExeQty ist immer mit 0 belegt.

Die Datenstruktur entspricht der Kursfeststellung am Back End (bc_qsambroadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + bc_brd_ent_priceT).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 124
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.11.1.43 Umsatzlose Kurseingabe über das Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über die erfolgreich durchgeführten Einzelkurse eines Requests **XONTRO Enter Block Price** informiert. Die Anzahl der übermittelten Kurse wird in counter geliefert. Achten Sie bitte darauf, dass die Felder confirmTim und ordrBkExeQty in der gelieferten Broadcaststruktur fehlen.

Das Feld confirmTimBypass wird mit dem Zeitpunkt der Verarbeitung des Requests XONTRO Enter Block Price am Backend belegt.

Ein nachfolgender Request XONTRO Enter Mass Quote (via Bypass) muss im Feld confirmTim diesen Wert enthalten, denn der empfangende Server prüft anhand dieses Zeitstempels, dass der Quote auch tatsächlich nach dem korrekten Kurs veröffentlicht wird. Soll diese Prüfung nicht durchgeführt werden, dann muss confirmTim mit dem Wert BC_DO_NOT_CHECK_CONFIRM_TIM belegt sein.

Bei einem nachfolgenden Request XONTRO Enter Quote (via Backend) darf das Feld confirmTim diesen Wert **nicht** enthalten. Es muss wie bisher mit dem Zeitstempel des letzten quoterelevanten Ereignisses oder aber mit dem Wert BC_DO_NOT_CHECK_CONFIRM_TIM belegt sein.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod ¹⁵ subType
	bc_brd_confirm_tim_bypassT bc_counterT	confirmTimBypass counter

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

¹⁵ bei diesem Subtype immer mit Spaces belegt

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 125
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

bis zu 30 Einträge

bc_brd_ent_block_priceT

isinCod*

tradMtchCod*

tradMtchPrc*

tradMtchPrcNo*

trdResTypCod*

lockTim*

tradMtchPrcTim*

tradMtchPrcTimFraction*

tradMtchPrcDat*

venueMic*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 126
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.44 Kurseingabe manuell

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_ENTER_PRICE_MAN** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über die auf dem Back End durchgeführten manuellen Kurseingaben (über die Funktionen BCOS/KU bzw. BROS/KU der Xontro Dialog-Anwendung) informiert. Es handelt sich um rein informatorische Kursfeststellungen.

Für nachfolgende manuelle Änderungen oder Löschungen (siehe Subtype **BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_MAN**) kann der neu eingefügte Kurs in der Kurskette über die Einstellzeit im Feld enterTim identifiziert werden.

Das Feld refTim ist nicht belegt. Im Feld tradMtchPrcDat wird der Börsentag des Kurses geliefert.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_ent_price_manT	tradMtchCod tradMtchPrc tradMtchPrcNo trdResTypCod ordrBkExeQty enterTim refTim tradMtchPrcDat

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 127
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.11.1.45 Kursänderung manuell

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_MAN** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über die manuellen „rein informatorischen“ Änderungen und Löschungen von Kursfeststellungen informiert. Die Eingabe dieser Kursänderung / -löschung erfolgte über die Funktionen BCOS/KU bzw. BROS/KU in der Xontro Dialog-Anwendung oder über den Request BC_RESET_PRICE_RID.

Bei Durchführung einer manuellen Änderung oder Löschung eines Kurses, welcher zuvor

1. **über das Orderbuch** eingestellt wurde, wird im Feld „refTim“ die ursprüngliche **Kursbestätigungszeit** („execTranTim“ oder „tradMtchPrcTim“ aus den Broadcasts BCBE_ENTER_PRICE, BCFE_ENTER_PRICE, BCBE_ENTER_PRICE_TAB, BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_TAB, BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE) geliefert.

2. **manuell** in die Kurskette eingefügt wurde, wird im Feld „refTim“ die **Einstellzeit** („enterTim“ aus dem Broadcast BCBE_ENTER_PRICE_MAN) geliefert.

Das Feld „enterTim“ ist bei einer manuellen Kursänderung / -löschung nicht belegt.

Liegen für den Vortag Kassa- und Schlusskurs vor und ist der Kassakurs für den aktuellen Tag bereits gestellt, dann wird bei einer Änderung des Vortages-Kassakurses das Feld trdResTypCod mit „SK“ belegt.

Bei einer Kurslöschung werden die Felder tradMtchPrc = ‚Zero‘, tradMtchCod = ‚blank‘ und ordrBkExeQty = ‚Zero‘ mit Initialwerten belegt.

Im Feld „tradMtchPrcDat“ wird der Börsentag des Kurses geliefert.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 128
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_ent_price_manT	tradMtchCod tradMtchPrc tradMtchPrcNo trdResTypCod ordrBkExeQty enterTim refTim tradMtchPrcDat

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 129
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020



2.1.11.1.46 Eingabe von Quotes am Front End

Beschreibung Der Request XONTRO Enter Quote liefert eine qualifizierte Response. Eine Front End Applikation erhält entweder eine positive Quittung (Quote ist akzeptiert) oder eine Ablehnung mit einer detaillierten Aufschlüsselung der Ablehnungsgründe. Sie muss diese Response immer auswerten.

Akzeptiert das XONTRO Back End einen auf dem **Front End** erzeugten Quote, dann informiert es zusätzlich die Systeme des Maklers (Skontroführer) mit einer Nachricht des Subtypes **BCFE_ENTER_QUOTE**.

Wird für die betroffene KV-Nummer eine zweite MISS-Gruppe betrieben, dann können die an ihr angeschlossenen Workstation und ihre Front End Applikationen diesen Subtyp (und den Folgenden) auswerten.

Im Feld inSeqNo wird die Input Sequence Number des korrespondierenden Requests vom Typ **XONTRO Enter Quote** als Referenz zurückgegeben.

Werden diese Input Sequence Numbers bei Aufruf des Requests **XONTRO Enter Quote** pro ISIN eindeutig und aufsteigend vergeben, dann kann eine Applikation durch Auswertung des Broadcasts feststellen, welcher Quote bzw. welche Quote-löschung dieser ISIN vom Back End zuletzt akzeptiert wurde.

In jedem Fall sind Vergabe und Auswertung dieser Referenzinformation Sache des Teilnehmers. XONTRO prüft diese Information nur auf formale Gültigkeit und wertet sie nicht aus.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_ent_quote_feT	ordrExePrcAsk ordrQtyAsk ordrExePrcBid ordrQtyBid inSeqNo quoteTimeStamp

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 130
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020



2.1.11.1.47 Deaktivierung von Quotes am Front End

Beschreibung Eine Front End Applikation erhält entweder eine positive Quittung (Quotelöschung ist akzeptiert) oder eine Ablehnung mit einer detaillierten Aufschlüsselung der Ablehnungsgründe. Sie muss diese Response immer auswerten.

Akzeptiert das XONTRO Back End eine auf dem **Front End** eingestellte Quote-löschung, dann informiert es zusätzlich die Systeme des Maklers (Skontroführer) mit einer Nachricht des Subtypes **BCFE_DEACTIVATE_QUOTE**.

Wird für die betroffene KV-Nummer eine zweite MISS-Gruppe betrieben, dann können die an ihr angeschlossenen Workstation und ihre Front End Applikationen diesen Subtyp (ebenso wie den Vorhergehenden) auswerten.

Im Feld inSeqNo wird die Input Sequence Number des korrespondierenden Requests vom Typ **XONTRO Enter Quote** als Referenz zurückgegeben.

Werden diese Input Sequence Numbers bei Aufruf des Requests **XONTRO Enter Quote** pro ISIN eindeutig und lückenlos aufsteigend vergeben, dann kann eine Applikation durch Auswertung des Broadcasts feststellen, welcher Quote bzw. welche Quotelöschung dieser ISIN vom Back End zuletzt akzeptiert wurde.

In jedem Fall sind Vergabe und Auswertung dieser Referenzinformation Sache des Teilnehmers. XONTRO prüft diese Information nur auf formale Gültigkeit und wertet sie nicht aus.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_deact_quote_feT	inSeqNo quoteTimeStamp

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 131
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.11.2 XONTRO Order Update Retransmission

Die folgende Tabelle beschreibt den Retransmission Request. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Request Order Update Retransmission
Request ID	BC_RET_ORDER_UPDATE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_retransT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT

Die über den Retransmission Request angeforderten Daten werden in der Bestandstransfer Queue bereitgestellt.

qsamStreamId	BC_RET_ORDER_UPDATE_STREAM_TYPE
qsamMsgType	T = Retransmission
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	outSeqNo
Bestandstransfer Queue	XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + (eine der Strukturen vom Typ bc_orderT, bc_brd_mod_orderT, bc_brd_del_orderT, bc_nrT, bc_brd_pend_ent_orderT, bc_brd_pend_mod_orderT, bc_brd_pend_del_orderT, bc_brd_ent_priceT, bc_brd_ent_price_plusT, bc_brd_lockT, bc_brd_unlockT, bc_brd_finish_pricingT, bc_brd_ent_quoteT, bc_brd_deact_quoteT, bc_brd_ent_price_manT, bc_brd_ent_block_priceT, bc_brd_ent_quote_feT, bc_brd_deact_quote_feT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 132
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.11.2.1 XONTRO Request Update Retransmission

Beschreibung Stellt eine Applikation über die Kontrolle der Output Sequence Number fest, dass eine Nachricht des Streams verloren wurde, kann sie diese Nachrichten mit dem Request **XONTRO Request Update Retransmission** vom XONTRO Back End nachfordern.

Voraussetzung hierfür ist die korrekte Verwaltung der Output Sequence Number in der Teilnehmerapplikation.

Die Wiederholung einer Übertragung ist nur für den Notfall vorgesehen. Aufgrund eines Fehlers der Teilnehmerapplikation wurden eventuell Nachrichten verloren.

Die Synchronisierung mit dem Empfang des Broadcast Streams ist ebenfalls Sache der Teilnehmerapplikation.

Der Request fordert Nachrichten (Sequenz-Nummern-Bereiche) vom Back End an und erhält eine Bestätigung per Response.

Angeforderten Nachrichten werden vom XONTRO Back End in der Bestandstransfer-Queue mit dem Wert „T“ im Feld **qsamMsgType** bereitgestellt. Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmerapplikation, die nachgeforderten Broadcasts gesondert zu verarbeiten.

Es können maximal 100 Sequenz-Nummern (von/bis) mit einem Retransmission Request angefordert werden. Es ist Sache der Anwendung, zu entscheiden, ob ein Folgerequest erforderlich ist.

Sind zu einem Request bzw. zu einer Sequenz-Nummer keine Daten vorhanden, dann erhält die Applikation den Completion Code „28060“ (qsamComplCode) in der Response.

qsamRequestId → BC_RET_ORDER_UPDATE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^o
	bc_request_retransT	startStmSeqNo ^m stopStmSeqNo ^m

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 133
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	<i>bc_response_headerT</i>	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

qsamStreamId → BC_RET_ORDER_UPDATE_STREAM_TYPE

mehrere Nachrichten: jeweils ein Broadcast Header und eine der aufgeführten Strukturen

Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat* tranTim* execTranDat* execTranTim* errFieldRef* outSeqNo* bkrUserNo* isinCod* subType*

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 134
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

(bc_orderT,
bc_brd_mod_orderT,
bc_brd_del_orderT,
bc_nrT,
bc_brd_pend_ent_orderT,
bc_brd_pend_mod_orderT,
bc_brd_pend_del_orderT,
bc_brd_lockT,
bc_brd_unlockT,
bc_brd_ent_priceT,
bc_brd_ent_price_plusT,
bc_brd_ent_block_priceT,
bc_brd_finish_pricingT,
bc_brd_ent_quoteT,
bc_brd_deact_quoteT,
bc_brd_ent_price_manT,
bc_brd_ent_quote_feT,
bc_brd_deact_quote_feT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 135
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.12 Aktualisierung der Orderausführungen

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsinformationen:

qsamStreamId	BC_PRIVATE_ORDER_EXECUTION_UPDATE_STREAM_TYPE
qsamMsgId	B = Broadcast
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	outSeqNo
Broadcast Queue	XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + (eine der Strukturen vom Typ bc_brd_exec_confT, bc_brd_end_execT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 136
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.12.1 XONTRO Execution Confirmation Update

Beschreibung Der Stream **XONTRO Execution Confirmation Update** versorgt das Front End mit allen auf dem Back End durchgeführten Orderausführungen bzw. deren Rücksetzung. Folgende Subtypes (subType) werden angeliefert:

Subtype	Verwendung
BCBE_EXECUTION_SKM	Orderauszeichnung durch den Skontroführer, Nachricht für den Skontroführer
BCBE_END_EXECUTION ¹⁶	Abschluss der Ausführungen zu einem Kurs für einen Skontroführer
BCBE_EXECUTION_SKM_TO_FM	Orderauszeichnung durch den Skontroführer, Nachricht für den Freimakler

Hinweis Die ersten beiden Subtypes werden nur dem Skontroführer, der letzte Subtype wird nur einem Freimakler zugestellt.

¹⁶ Die Nachricht wird verschickt, wenn der festgestellte Kurs Teilausführungen zulässt und Umsätze zu diesem Kurs vorliegen (bG, bB, ratG,.. etc.).

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 137
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.12.1.1 Ausführungsbestätigungen

Beschreibung Über die Subtypes **BCBE_EXECUTION_SKM** und **BCBE_EXECUTION_SKM_TO_FM** werden die Orderausführungen zugestellt:
Die Felder tradMtchPrcTim und tradMtchPrcDat enthalten den Zeitpunkt und das Datum der Kursfeststellung.

qsamStreamId → BC_PRIVATE_ORDER_EXECUTION_UPDATE_STREAM_TYPE

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_exec_confT	execConfType ordrNo userOrdNum tradMtchCod tradMtchPrc tradMtchPrcNo tradMtchQty tradMtchPrcTim tradMtchPrcTimFraction tradMtchPrcDat trdResTypCod userNo tvTic algoFlag

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 138
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.12.1.2 Abschluss der Ausführungen

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_END_EXECUTION** wird dem Front End eines Skontroführers mitgeteilt, dass ihm alle Ausführungen zu einem Kurs zugestellt wurden Die Nachricht wird nur verschickt, wenn der festgestellte Kurs Teilausführungen zulässt und Umsätze zu diesem Kurs vorliegen (bG, bB, ratG, etc.).

qsamStreamId→ BC_PRIVATE_ORDER_EXECUTION_UPDATE_STREAM_TYPE

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_end_execT	tradMtchCod tradMtchPrc tradMtchPrcNo trdResTypCod

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 139
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.12.2 XONTRO Execution Confirmation Retransmission

Die folgende Tabelle beschreibt den Retransmission Request. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Request Execution Confirmation Retransmission
Request ID	BC_RET_ORDER_EXECUTION_UPDATE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_retransT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT

Die über den Retransmission Request angeforderten Daten werden in der Bestandstransfer Queue bereitgestellt.

qsamStreamId	BC_RET_ORDER_EXECUTION_UPDATE_STREAM_TYPE
qsamMsgType	T = Retransmission
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	outSeqNo
Bestandstransfer Queue	XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + (eine der Strukturen vom Typ bc_brd_exec_confT, bc_brd_end_execT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 140
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.12.2.1 XONTRO Request Execution Confirmation Retransmission

Beschreibung Stellt eine Applikation über die Kontrolle der Output Sequence Number fest, dass eine Nachricht des Streams verloren wurde, kann sie diese Nachrichten mit dem Request **XONTRO Request Execution Confirmation Retransmission vom XONTRO Back End** nachfordern.

Voraussetzung hierfür ist die korrekte Verwaltung der Output Sequence Number in der Teilnehmerapplikation.

Die Wiederholung einer Übertragung ist nur für den Notfall vorgesehen. Aufgrund eines Fehlers der Teilnehmerapplikation wurden eventuell Nachrichten verloren.

Die Synchronisierung mit dem Empfang des Broadcast Streams ist ebenfalls Sache der Teilnehmerapplikation.

Der Request fordert Nachrichten (Sequenz-Nummern-Bereiche) vom Back End an und erhält eine Bestätigung per Response. Die angeforderten Nachrichten werden vom XONTRO Back End in der Bestandstransfer-Queue mit dem Wert „T“ im Feld **qsamMsgType** bereitgestellt. Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmerapplikation, die nachgeforderten Broadcasts gesondert zu verarbeiten.

Es können maximal 100 Sequenz-Nummern (von/bis) mit einem Retransmission Request angefordert werden. Es ist Sache der Anwendung, zu entscheiden, ob ein Folgerequest erforderlich ist.

Sind zu einem Request bzw. zu einer Sequenz-Nummer keine Daten vorhanden, dann erhält die Applikation den Completion Code „28060“ (qsamComplCode) in der Response.

qsamRequestId → BC_RET_ORDER_EXECUTION_UPDATE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^o
	bc_request_retransT	startStmSeqNo ^m stopStmSeqNo ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 141
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
qsamStreamId →	BC_RET_ORDER_EXECUTION_UPDATE_STREAM_TYPE	
	mehrere Nachrichten: jeweils ein Broadcast Header und eine der aufgeführten Strukturen	
Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat* tranTim* execTranDat* execTranTim* errFieldRef* outSeqNo* bkrUserNo* isinCod* subType*
	(bc_brd_exec_confT, bc_brd_end_execT)	

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 142
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.13 Quoteverwaltung Front End für skontroführende Makler

Die folgende Tabelle beschreibt die Requests, sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Einstellung und Verteilung von XONTRO Front End Quotes klassisch via XONTRO mit Anzeige im Orderbuch BxOS/OM:

Request Name	XONTRO Enter Quote
Request ID	BC_ENTER_QUOTE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_ent_quoteT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT + bc_response_ent_quoteT

Einstellung und Verteilung von XONTRO Front End Quotes via XONTRO **Quote-Bypass** ohne Anzeige im Orderbuch BxOS/OM:

Request Name	XONTRO Enter Mass Quote
Request ID	BC_ENTER_MASS_QUOTE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.MIRTOH.<qsamId>.A (A = Instanz A) XOSAM.QA.MIRTOH.<qsamId>.B (B = Instanz B)
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + mehrfach bc_request_ent_mass_quoteT
Response Queue	XOSAM.QA.MIRFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT + mehrfach bc_response_ent_mass_quoteT

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 143
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.13.1 XONTRO Enter Quote

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Quote** dient dem skontroführenden Makler zur Einstellung (bzw. Löschung¹⁷) eines Quotes in das Orderbuch der Dialoganwendung (BxOS/OM) auf dem XONTRO Back End. Zusätzlich werden diese Quotes über die Börsen-Anwendung der Kurs- und Quotevermarktung veröffentlicht.

Alle Angaben sind verbindlich.

Die Response enthält qualifizierte Informationen darüber, ob ein Quote erfolgreich in den Markt gestellt werden konnte.

Das Feld **confirmTim** im Request XONTRO Enter Quote dient dem skontroführenden Makler zur Synchronisation der Quotes mit quoterelevanten Ereignissen am Back End. Das Feld muss im Request immer mit dem aktuellen Zeitstempel für die betroffene ISIN belegt werden. Den erforderlichen Wert kann man den Benachrichtigungsbroadcasts des Xontro Order Update Streams entnehmen.

Tritt am Xontro Back End ein Ereignis ein, welches die Marktsituation entscheidend ändert, dann wird hierüber eine Broadcast Nachricht mit einem Zeitstempel im Feld **confirmTim** versendet. Diese Ereignisse sind: eine Kursfeststellung oder Kurskorrektur am Back End und die manuelle Eingabe bzw. Löschung eines Quote.

In diesen Situationen lehnt das Back End alle folgenden Quote-Requests mit einem alten Zeitstempel im Feld **confirmTim** ab, da sie aus einer abweichenden Marktsituation gestellt wurden. Erst wenn die Front End Applikation den Zeitstempel aus den Benachrichtigungsbroadcasts in den Quote-Request übernimmt, werden ihre Quotes wieder akzeptiert.

Die publizierte **confirmTim** wird am BE vorgehalten und beim Eintreten des nächsten quoterelevanten Ereignisses durch die nächste gültige **confirmTim** überschrieben.

Ist noch keine aktuelle **confirmTim** verfügbar, so ist die **confirmTim** mit **BC_INIT_CONFIRM_TIM** zu belegen.

Sollen die Quotes ohne Prüfung der **confirmTim** am Back End eingestellt werden, so ist die **confirmTim** im Request mit dem Wert **BC_DO_NOT_CHECK_CONFIRM_TIM** zu belegen.

Achtung: Dies kann zu nicht marktgerechten Quotes führen.

Die **inSeqNo** hat beim Request **Xontro Enter Quote** eine besondere Bedeutung.

Die Werte im Feld **inSeqNo** der Quote Requests für eine ISIN müssen **aufsteigend** vergeben werden. Am Back End wird die **inSeqNo** der letzten gültigen Quote für eine ISIN gespeichert. Beim Einstellen einer Quote wird geprüft, ob der Wert der **inSeqNo** größer ist als der gespeicherte. Ist dies nicht der Fall, so wird der Quote Request abgelehnt. In der Response wird der Grund der Ablehnung mitgeteilt.

Der Wert der **inSeqNo** für den ersten Quote einer ISIN am Börsentag muss größer als 0 sein.

Wechselt das Quoting einer ISIN im Laufe eines Börsentags von einer Applikation (bzw. Applikationsinstanz) auf eine andere (z.B. im Failover-Fall), so muss von Anwenderseite sichergestellt werden, dass die Vergabe der **inSeqNo** zwischen den Applikationen bzw. Instanzen synchronisiert wird.

¹⁷ Ein Löschung kann sowohl einen FE als auch einen BE Quote (Taxe/Spanne) betreffen

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 144
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Das im Request enthaltene Feld quoteTimeStamp wird im zugehörigen Quote Broadcast veröffentlicht. Am BE wird lediglich geprüft, ob das Feld numerisch ist.

Wurde ein Request **Xontro Enter Quote** mit dem qsamComplCode:

ELB_BC_INSEQNO_OUTDATED

abgelehnt, so ist erneut ein Quote einzustellen. Die Datenfelder der Response sind belegt. Die inSeqNo des Requests muss dann größer sein als die in der Response enthaltene inSeqNoCurrent sein.

Bei einer Ablehnung mit

ELB_BC_CONFIRM_TIM_OUTDATED

ist ein neuer Quote mit gültiger confirmTim einzustellen. Die Datenfelder der Response sind belegt. Der Wert ist der letzten quote-relevanten Nachricht des Xontro Order Update Broadcast für diese ISIN zu entnehmen.

Wird der Request mit dem qsamComplCode

ELB_BC_QUOTING_STOPPED

abgelehnt, dann ist zurzeit kein Quoting möglich. Die Datenfelder der Response sind **nicht** belegt. Der Grund wird im XONTRO Private Status News Stream mitgeteilt.

Eine mögliche Wiederaufnahme wird ebenfalls über diesen Stream publiziert.

Die Felder im Datenteil der Response sind bei erfolgreicher Verarbeitung immer belegt.

Wird ein Request aus anderen Gründen (Sperrung des Orderbuchs, formale Fehler etc.) abgelehnt, dann sind die Datenfelder der Response **nicht** belegt.

qsamRequestId → BC_ENTER_QUOTE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_ent_quoteT	isinCod ^m ordrExePrcAsk ^m ordrQtyAsk ^m ordrExePrcBid ^m ordrQtyBid ^m confirmTim ^m quoteTimeStamp ^o

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 145
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_ent_quoteT	inSeqNoCurrent confirmTimCurrent bkrQuoteVolRemain

Die folgende Tabelle gibt Auskunft über die Belegungsmöglichkeiten der Felder und die daraus resultierenden Reaktionen. Dargestellt ist nur eine Seite (Bid):

ordrExePrcBid	ordrQtyBid	Reaktion
nicht belegt	nicht belegt	Deaktivierung der Bid Seite
nicht belegt	belegt	errCod: ELB_BC_INVALID_QUOTE
belegt	nicht belegt	Quote ohne Stückzahl für Bid Seite
belegt	belegt	Quote mit Stückzahl für Bid Seite

Die Responsestruktur bc_response_ent_quoteT enthält die Werte inSeqNoCurrent und confirmTimCurrent. Sie beinhalten bei erfolgreicher Verarbeitung des Request die Werte des Quotes der zuletzt verarbeitet wurde. Das Gleiche gilt für die erwähnten Sonderfälle, in denen eine Quote wegen eines Fehlers in der Reihenfolge abgelehnt wurde.

Weiterhin wird bei erfolgreicher Request-Verarbeitung in der Response im Feld bkrQuoteVolRemain das am aktuellen Börsentag noch verbleibende Quote-Kontingent der jeweiligen KV-Nummer des Maklers zurückgegeben.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 146
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.13.2 XONTRO Enter Mass Quote

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Mass Quote** dient dem skontroführenden Makler zur Übermittlung von geblockten Quotes an die Börsen-Anwendung für die Kurs- und Quoteverteilung (CEF).

Eine Nachricht kann bis zu 50 Quotes unterschiedlicher ISINs enthalten. Die Blockung der Quotes auf Teilnehmerseite ist entscheidend für das Erreichen eines **hohen Durchsatzes**.

Es erfolgt **keine Einstellung in das Orderbuch** der XONTRO Dialog-Anwendung (BxOS/OM). Die Quotes werden auf direktem Wege an die kursverteilenden Systeme weitergeleitet.

Für die Quote-Bypass-Verarbeitung ist pro Börsenplatz und KV-Nummer ein gesonderter Login mit der Request-Id **BC_LOGIN_QUOTE_BYASS_RID** erforderlich, siehe Kapitel Login.

Das Feld **inSeqNo** ist bei diesem Request optional und kann vom Teilnehmer zur Referenzierung von Request und Response über den Header verwendet werden.

Das Feld **quoteSeqNo** muss für jede ISIN im Block mit einer aufsteigenden Sequenz-Nummer belegt werden.

Das Feld **confirmTim** dient dem skontroführenden Makler zur Synchronisation der Quotes mit quoterelevanten Ereignissen am Back End. Das Feld muss im Request mit dem aktuellen Zeitstempel für die betroffene ISIN belegt werden. Der erforderliche Wert muss aus den Benachrichtigungsbroadcasts des XONTRO Order Update Streams entnommen werden.

Das Feld **quoteTimeStamp** kann optional mit der Zeit der Veröffentlichung belegt werden. Ist das Feld mit dem Initialwert „000000000000“ belegt, so wird für die Veröffentlichung **der aktuelle Zeitstempel des Quote-Bypass-Servers** verwendet. Die Zeit muss mit einer **Genauigkeit von 12 Stellen** belegt werden!

Die Anzahl und Reihenfolge der Quotes im Request entspricht der Anzahl und Reihenfolge der **Returncodes** (quoteReturnCod) in der Response.

Für jede erfolgreich eingestellte Quote wird ein **quoteReturnCod = Y** geliefert.

Der empfangende Server führt folgende Prüfungen durch und informiert den Quote-Sender über das Ergebnis der Prüfung per Response:

- Syntax- bzw. Kontext-Prüfung der Quotedaten. Im Fehlerfall wird der Quote für die ISIN mit **quoteReturnCod = X** abgelehnt.
- Prüfung ob ein ausreichendes Quote-Kontingent für die sendende KV-Nummer vorhanden ist. Ist kein Kontingent vorhanden, wird der Quote mit **quoteReturnCod = V** abgelehnt.
- Optionale Prüfung des Feldes confirmTim, um sicherzustellen, dass ein Bypass-Quote auch tatsächlich nach dem korrekten Kurs veröffentlicht wird (ohne Prüfung: confirmTim = BC_DO_NOT_CHECK_CONFIRM_TIM).
Eine falsche confirmTim wird mit **quoteReturnCod = F** abgelehnt.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 147
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

- Prüfung der Sequenz-Nummer, um sicherzustellen, dass ein Bypass-Quote in aufsteigender Sequenz pro ISIN übermittelt wurde. Eine ungültige quoteSeqNo wird mit **quoteReturnCod = S** abgelehnt.
- Durchführung von Syntax-Prüfungen (z.B. Prüfung auf gültige Header-Felder, Nachrichten-Format und Nachrichtenlänge). Im Fehlerfall wird der komplette Nachrichtenblock abgelehnt (qsamComplCode) und die Struktur *bc_response_ent_mass_quoteT* **nicht** geliefert.
- Prüfung auf das **aktive Zielsystem** (Instanz A oder B). Der abnehmende Kursvermarkter (DBAG CEF) ist immer nur auf einer Instanz aktiv. Wechselt der Kursvermarkter die Instanz, wird der komplette Nachrichtenblock mit dem qsamComplCode **19090** - KURSDATENVERMARKTER AUF DIESER INSTANZ NICHT ANGEMELDET abgelehnt. Die aktive Instanz wird in der Response des Requests BC_LOGIN_QUOTE_BYPASS_RID im Feld errFieldRef geliefert.

qsamRequestId →	BC_ENTER_MASS_QUOTE_RID	
Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^o
	<i>bis zu 50 Einträge:</i> bc_request_ent_mass_quoteT	quoteSeqNo ^{m*} isinCod ^{m*} ordrExePrcAsk ^{m*} ordrQtyAsk ^{m*} ordrExePrcBid ^{m*} ordrQtyBid ^{m*} confirmTim ^{m*} quoteTimeStamp ^{o*}
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 148
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

bc_response_headerT

tranDat
tranTim
execTranDat
execTranTim
errFieldRef
inSeqNo

bis zu 50 Einträge:

bc_response_ent_mass_quoteT

quoteReturnCod *

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 149
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.14 Aufgabenverwaltung Front End

Die folgende Tabelle beschreibt die Requests, sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Enter Broker Trade
Request ID	BC_ENTER_BROKER_TRADE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_ent_btradeT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT

Request Name	XONTRO Delete Broker Trade
Request ID	BC_DELETE_BROKER_TRADE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_del_btradeT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT

Request Name	XONTRO Match Broker Trade
Request ID	BC_MATCH_BROKER_TRADE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_match_btradeT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 150
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Request Name	XONTRO Match All Broker Trades
Request ID	BC_MATCH_ALL_BROKER_TRADES_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_request_headerT + bc_request_match_all_btradesT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_response_headerT

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 151
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.14.1 XONTRO Enter Broker Trade

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Broker Trade** dient dem Makler zur Einstellung von Aufgaben.

Bei erfolgreicher Einstellung einer Aufgabe erfolgt lediglich eine formale Quittung über die Annahme des Auftrags. Es werden keine inhaltlichen Informationen wie z.B. eine Aufgabennummer zurückgeliefert.

Tritt bei der Einstellung der Aufgabe auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird zusätzlich der Broadcast BCFE_ENTER_BTRADE oder BCFE_ENTER_BTRADE_2 generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat kann entscheiden, ob sie die Response verarbeitet oder ignoriert. Im zweiten Fall muss der Broadcast ausgewertet werden.

qsamRequestId → BC_ENTER_BROKER_TRADE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_ent_btradeT	bkrNo ^m buyCod ^m ctpyNo ^m tradMtchPrc ^m tradMtchQty ^m currExcRat ^o valueDatCod ^o valueDat ^o acrIntDay ^o acrIntDayCod ^o bonusRat ^o acctTypCodXontro ^o matchFlag ^o iwOrdCod ^o isinCod ^m

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 152
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

		feeFlag ° fee ° textTrad ° tradBegDat ° tradContTim ^m tradContDat ^r trdTypXontro ° repExchangeld ° shortSellCod °
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 153
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.14.2 XONTRO Delete Broker Trade

Beschreibung Der Request **XONTRO Delete Broker Trade** dient dem Makler zum Löschen von Aufgaben, die nicht mehr stornierbar sind. Das einzige Identifikationskriterium der Aufgabe ist die Aufgabennummer (btradeNo).

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene Aufgabennummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB_BC_BTRADE_ERROR.

In der Response ist nur der Header belegt.

Tritt bei der Löschung der Aufgabe auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests erhält die MISS eine positive Response, in der nur der Header belegt ist.

Zusätzlich wird ein Broadcast generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, kann entscheiden, ob sie die Response verarbeitet oder ignoriert. Im zweiten Fall muss der Broadcast ausgewertet werden. Dabei wird die inSeqNo dieses Request im Feld inSeqNoRef des Broadcasts zurückgegeben.

qsamRequestId → BC_DELETE_BROKER_TRADE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_del_btradeT	btradeNo ^m isinCod ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 154
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

tranTim
execTranDat
execTranTim
errFieldRef
inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 155
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.14.3 XONTRO Match Broker Trade

Beschreibung Der Request **XONTRO Match Broker Trade** dient dem Makler zum Schließen von Aufgaben. Dabei können Aufgaben sowohl gegeneinander als auch gegen halbe Geschäfte geschlossen werden. Eine Aufgabe wird dabei durch die Aufgabennummer (btradeNoAsk oder btradeNoBid) identifiziert.

Durch die Belegung des Feldes settlementFlag mit dem Wert „KM“ (keine Meldesatzgenerierung) kann bei der Schließung von zwei vorläufigen Aufgaben die Meldesatzgenerierung unterdrückt werden. Das Feld wird auf Vorrat eingerichtet, nähere Erläuterungen erfolgen zu einem späteren Zeitpunkt durch die BrainTrade.

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene Aufgabennummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB_BC_BTRADE_ERROR.

In der Response ist nur der Header belegt.

Tritt beim Schließen der Aufgabe auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der lediglich eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests erhält die MISS eine positive Response, in der nur der Header belegt ist.

Bei erfolgreicher Durchführung der Folgeverarbeitung auf dem Back End wird zusätzlich ein Broadcast generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, muss den Broadcast auswerten, da aus einer positiven Response nicht auf eine erfolgreiche Durchführung der asynchron ablaufenden Folgeverarbeitung auf dem Back End geschlossen werden kann. Dabei wird die inSeqNo dieses Request im Feld inSeqNoRef des Broadcasts zurückgegeben.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 156
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_MATCH_BROKER_TRADE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_match_btradeT	btradeNoAsk ^o btradeNoBid ^o ctpyNo ^o tradMtchPrc ^o redQty ^m isinCod ^m feeFlag ^o fee ^o currExcRat ^o acctTypCodXontro ^o tradBegDat ^o tradContTim ^m tradContDat ^o trdTypXontro ^o repExchangeld ^o customerldClass ^o customerld ^o commissionAgentFlag ^o settlementFlag ^o textTrad ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 157
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.14.4 XONTRO Match All Broker Trades

Beschreibung Der Request **XONTRO Match All Broker Trades** dient dem Makler dazu, das Back End zum Schließen aller möglichen Aufgaben einer ISIN gegeneinander zu veranlassen. Diese Funktion ist auf der Ebene ISIN/bkrUserNo nur exklusiv verwendbar.

Erkennt das Back End, dass diese Funktion bereits für die gleiche Kombination ISIN/bkrUserNo in Benutzung ist, dann erhält das Front End den Completion Codes (qsamComplCode) ELB_BC_NOT_AVAILABLE.

In der Response ist nur der Header belegt.

Tritt bei der Durchführung der Anforderung ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests erhält die MISS eine positive Response, in der nur der Header belegt ist. Bei erfolgreicher Durchführung der Folgeverarbeitung auf dem Back End wird zusätzlich ein Broadcast generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, muss den Broadcast zur Ermittlung der durchgeführten Schließungen auswerten, da aus einer positiven Response nicht auf eine erfolgreiche Durchführung der asynchron ablaufenden Folgeverarbeitung auf dem Back End geschlossen werden kann. Jede Aufgabenschließung wird über diesen Broadcast mitgeteilt. Dabei wird die inSeqNo dieses Request im Feld inSeqNoRef des Broadcasts zurückgegeben.

Die Anzahl der Aufgaben, welche mit diesem Request geschlossen werden können, ist wegen technischer Restriktionen beschränkt. Liegt die Anzahl der zu schließenden Aufgaben unter 403, können sie mit einem Request geschlossen werden. Bis zu einer Anzahl von 700 können sie mit zwei Requests geschlossen werden. Eine Schließung von mehr als 700 Aufgaben ist nicht möglich.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 158
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_MATCH_ALL_BROKER_TRADES_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_match_all_btradesT	isinCod ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 159
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.15 Bestandsinformationen Aufgaben

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsstrukturen:

qsamStreamId	BC_INQUIRE_BROKER_TRADES_STREAM_TYPE
qsamMsgType	I = Bestandstransfer (Initialbestand)
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	bKeyInq
Bestandstransfer Queue	XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_btradeT) oder bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_btrade_2T)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 160
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.15.1 XONTRO Inquire Broker Trades

Beschreibung Der Stream **BC_INQUIRE_BROKER_TRADES_STREAM_TYPE** liefert dem Front End den verbindlichen Aufgabenbestand zum Zeitpunkt des Abschlusses des vorherigen Börsentags. Dieser Aufgabenbestand ist gleichzeitig der Initialbestand des aktuellen Börsentages. Die dezentralen Bestände des Maklersystems können mit den Bestandsdaten abgeglichen werden, um so zu Beginn eines neuen Börsentages die Konsistenz der dezentralen Bestände sicherzustellen.

Es werden zwei unterschiedliche Datenformate zu Verfügung gestellt. Welches der beiden Formate ein Anwender erhält, wird über das Profiling gesteuert. Die Struktur **bc_btrade_2T** kann nicht von allen Teilnehmern angefordert werden. Die Teilnehmer sind selbst dafür verantwortlich, dass in ihren Applikationen die jeweils korrekte Struktur benutzt wird.

Der Stream liefert mehrere Aufgaben in einer Nachricht. Die tatsächliche Länge kann über das Längensfeld der Antwort (MQ Layer) ermittelt werden. Die erste Nachricht wird mit **bKeyInq = 1** geliefert. Alle Folgenachrichten enthalten eine lückenlos aufsteigende Sequenz-Nummer.

Sind noch keine Bestandsdaten vorhanden, dann erhält die Applikation den Zugriffsfehler des MQ Layers. Die Applikation kann den Lesezugriff zu einem späteren Zeitpunkt wiederholen.

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType **BCBE_BTRADES_END** feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn für eine KV-Nummer keine Aufgaben vorliegen. Im Standardfall ist subType mit **BCBE_BTRADE** bzw. **BCBE_BTRADE_2** belegt.

qsamStreamId →	BC_INQUIRE_BROKER_TRADES_STREAM_TYPE	Format 1
Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_key_inquireT	bKeyInq
	mehrfach bc_subTypeT	subType*
	bc_btradeT	btradeNo* bkrNo* bkrSubNo*

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 161
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

exchangeld*
 buyCod*
 ctpyNo*
 ctpySubNo*
 ctpyExchangeld*
 ctpyLei*
 tranExchangeld*
 btradeCod*
 tradMtchPrc*
 tradMtchQty*
 ordrQty*
 clearingCurrTypCod*
 currExcRat*
 valueDatCod*
 valueDat*
 acrIntDay*
 acrIntDayCod*
 bonusRat*
 tradMtchPrcNo*
 acctTypCodXontro *
 iwOrdCod*
 isinCod*
 isinCodSrs*
 tradBegDat*
 tradContTim*
 tradContTimFraction*
 tradContDat*
 repExchangeld*
 trdTypXontro*
 tvTic*
 venueMic*
 shortSellCod*
 otcPostTradInd*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 162
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

qsamStreamId →	BC_INQUIRE_BROKER_TRADES_STRE AM_TYPE	Format 2
Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_key_inquireT	bKeyInq ^m
	mehrfach	
	bc_subTypeT	subType*
	bc_btrade_2T	btradeNo* bkrNo* bkrSubNo* exchangeld* buyCod* ctpyNo* ctpySubNo* ctpyExchangeld* ctpyLei* tranExchangeld* btradeCod* tradMtchPrc* tradMtchQty* ordrQty* clearingCurrTypCod* currExcRat* valueDatCod* valueDat* acrIntDay* acrIntDayCod* bonusRat* tradMtchPrcNo* acctTypCodXontro * iwOrdCod* isinCod* isinCodSrs* tradBegDat* tradContTim*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 163
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

*Diese Struktur wird auf der folgenden
Seite fortgesetzt*

tradContTimFraction*
tradContDat*
repExchangeld*
feeFlag*
fee*
textTrad*
ctpyTradMtchPrc*
trdTypXontro*
tvTic*
venueMic*
shortSellCod*
otcPostTradInd*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 164
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16 Aktualisierung des Aufgabenbestands

Die folgenden Tabellen beschreiben die Subtypes und Datenstrukturen der Broadcasts.

qsamStreamId	BC_PRIVATE_BROKER_TRADE_UPDATE_STREAM_TYPE
qsamMsgId	B = Broadcast
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	outSeqNo
Broadcast Queue	XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Response Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + (eine der Strukturen vom Typ bc_brd_ent_temp_btradeT, bc_brd_mod_temp_btradeT, bc_brd_del_temp_btradeT, bc_brd_ent_btradeT, bc_brd_ent_btrade_2T, bc_brd_ent_btrade_feT, bc_brd_ent_btrade_fe_2T, bc_brd_can_btradeT, bc_brd_del_btradeT, bc_brd_can_btrade_feT, bc_brd_del_btrade_feT, bc_brd_match_btradeT, bc_brd_mod_btradeT, bc_brd_match_btrade_feT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 165
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.16.1 XONTRO Broker Trade Update

Beschreibung Der Stream XONTRO Broker Trade Update versorgt das Front End mit allen auf dem Back End durchgeführten Änderungen des Aufgabenbestands. Folgende Subtypes werden hierfür¹⁸ angeliefert:

Subtype	Verwendung
BCBE_ENTER_TEMP_BTRADE	Erzeugung einer temporären Aufgabe (Seitenüberhang)
BCBE_MODIFY_TEMP_BTRADE	Änderung einer temporären Aufgabe
BCBE_DELETE_TEMP_BTRADE	Löschung einer temporären Aufgabe
BCBE_ENTER_BTRADE	Erzeugung einer neuen Aufgabe am Back End
BCBE_ENTER_BTRADE_2	Erzeugung einer neuen Aufgabe am Back End (Format 2)
BCFE_ENTER_BTRADE	Erzeugung einer neuen Aufgabe am Front End
BCFE_ENTER_BTRADE_2	Erzeugung einer neuen Aufgabe am Front End (Format 2)
BCBE_DELETE_BTRADE	Löschung einer neuen Aufgabe am Back End
BCBE_CANCEL_BTRADE	Stornierung einer neuen Aufgabe am Back End
BCFE_DELETE_BTRADE	Löschung einer neuen Aufgabe am Front End
BCFE_CANCEL_BTRADE	Stornierung einer neuen Aufgabe am Front End
BCBE_MATCH_BTRADE	Schließung von Aufgaben am Back End
BCFE_MATCH_BTRADE	Schließung von Aufgaben am Front End
BCBE_MODIFY_BTRADE	Änderung einer Aufgabe am Back End

¹⁸ Über diesen Stream werden auch die Broadcastnachrichten für den Handel unter Maklern (HUM) verschickt. Diese Subtypes und ihre Strukturen werden im Abschnitt **Informationen zum Handel unter Maklern (HUM)** beschrieben.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 166
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.1 Erzeugung einer temporären Aufgabe

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_ENTER_TEMP_BTRADE** werden dem Front End auf dem Back End erzeugte temporäre Aufgaben (Seitenüberhänge die direkt bei der Kursfeststellung entstehen) zugestellt:

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_ent_temp_btradeT	buyCod tradMtchPrc tradMtchQty tradMtchPrcNo isinCod isinCodSrs tradEnterDat

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 167
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.2 Änderung einer temporären Aufgabe

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_MODIFY_TEMP_BTRADE** werden dem Front End die auf dem Back End erzeugten Änderungen temporärer Aufgaben zugestellt:

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_mod_temp_btradeT	buyCod changeQty tradMtchPrcNo isinCod

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 168
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.3 Löschung einer temporären Aufgabe

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_DELETE_TEMP_BTRADE** werden dem Front End die auf dem Back End durchgeführten Löschungen temporärer Aufgaben zugestellt:

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_del_temp_btradeT	buyCod changeQty tradMtchPrcNo isinCod

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 169
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.16.1.4 Erzeugung einer Aufgabe am Back End

Beschreibung Abhängig von den Einstellungen des Profilings werden dem Front End die auf dem Back End neu erzeugte Aufgaben (vorläufig oder endgültig) über einen der beiden Subtypes **BCBE_ENTER_BTRADE** oder **BCBE_ENTER_BTRADE_2** zugestellt. Zu beachten ist, dass für den Subtype **BCBE_ENTER_BTRADE_2** die zusätzlichen Angaben fee, feeFlag und textTrad nur für endgültige Aufgaben geliefert werden.

Kommt ein solcher Broadcast durch die Stornierung einer Schließung zustande, dann werden die Zusatzangaben für eine wieder aktivierte, endgültige Aufgabe nur dann geliefert, wenn sie nicht früher als zwei Tage zuvor entstanden ist.

Ist dies nicht der Fall, dann werden die Zusatzangaben mit ihren Initialwerten belegt.

BCBE_ENTER_BTRADE

Format 1

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_ent_btradeT	btradeNo bkrNo bkrSubNo exchangeld buyCod ctpyNo ctpySubNo ctpyExchangeld ctpyLei tranExchangeld btradeCod tradMtchPrc tradMtchQty

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 170
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

ordQty
 clearingCurrTypCod
 currExcRat
 valueDatCod
 valueDat
 acrIntDay
 acrIntDayCod
 bonusRat
 tradMtchPrcNo
 acctTypCodXontro
 iwOrdCod
 isinCod
 isinCodSrs
 tradBegDat
 tradContTim
 tradContTimFraction
 tradContDat
 repExchangeld
 trdTypXontro
 tvTic
 venueMic
 shortSellCod
 otcPostTradInd

BCBE_ENTER_BTRADE_2

Broadcast Data bc_qsam_broadcast_headerT

Format 2

qsamId
 qsamMsgType
 qsamExchangeld
 qsamDat
 qsamBkrNo
 qsamStreamId

bc_broadcast_headerT

tranDat
 tranTim
 execTranDat
 execTranTim
 errFieldRef
 outSeqNo
 bkrUserNo
 isinCod

*Diese Struktur wird auf der
folgenden Seite fortgesetzt*

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).



BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 171
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

bc_brd_ent_btrade_2T

subType
btradeNo
bkrNo
bkrSubNo
exchangeld
buyCod
ctpyNo
ctpySubNo
ctpyExchangeld
ctpyLei
tranExchangeld
btradeCod
tradMtchPrc
tradMtchQty
ordrQty
clearingCurrTypCod
currExcRat
valueDatCod
valueDat
acrIntDay
acrIntDayCod
bonusRat
tradMtchPrcNo
acctTypCodXontro
iwOrdCod
isinCod
isinCodSrs
tradBegDat
tradContTim
tradContTimFraction
tradContDat
repExchangeld
feeFlag
fee
textTrad
ctpyTradMtchPrc
trdTypXontro
tvTic
venueMic
shortSellCod
otcPostTradInd

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 172
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.5 Erzeugung einer neuen Aufgabe am Front End

Beschreibung Abhängig von den Einstellungen des Profilings werden dem Front End die auf dem Front End neu erzeugte Aufgaben (vorläufig oder endgültig) über einen der beiden Subtypes **BCFE_ENTER_BTRADE** oder **BCFE_ENTER_BTRADE_2** zugestellt.

Kommt ein solcher Broadcast durch die Stornierung einer Schließung zustande, dann werden die Zusatzangaben für eine wieder aktivierte, endgültige Aufgabe nur dann geliefert, wenn sie nicht früher als zwei Tage zuvor entstanden ist.

Ist dies nicht der Fall, dann werden die Zusatzangaben mit ihren Initialwerten belegt.

BCFE_ENTER_BTRADE

Format 1

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_ent_btrade_feT	btradeNo bkrNo bkrSubNo exchangeld buyCod ctpyNo ctpySubNo ctpyExchangeld ctpyLei tranExchangeld btradeCod tradMtchPrc tradMtchQty ordrQty

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind gelb hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 173
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

clearingCurrTypCod
currExcRat
valueDatCod
valueDat
acrIntDay
acrIntDayCod
bonusRat
tradMchPrcNo
acctTypCodXontro
iwOrdCod
isinCod
isinCodSrs
tradBegDat
tradContTim
tradContTimFraction
tradContDat
repExchangeld
inSeqNoRef
trdTypXontro
tvTic
venueMic
shortSellCod
otcPostTradInd

BCFE_ENTER_BTRADE_2

Broadcast Data bc_qsam_broadcast_headerT

Format 2

qsamId
qsamMsgType
qsamExchangeld
qsamDat
qsamBkrNo
qsamStreamId

bc_broadcast_headerT

tranDat
tranTim
execTranDat
execTranTim
errFieldRef
outSeqNo
bkrUserNo
isinCod
subType

*Diese Struktur wird auf der
folgenden Seite fortgesetzt*

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).



BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 174
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

bc_brd_ent_btrade_fe_2T

btradeNo
 bkrNo
 bkrSubNo
 exchangeld
 buyCod
 ctpyNo
 ctpySubNo
 ctpyExchangeld
 ctpyLei
 tranExchangeld
 btradeCod
 tradMtchPrc
 tradMtchQty
 ordrQty
 clearingCurrTypCod
 currExcRat
 valueDatCod
 valueDat
 acrlntDay
 acrlntDayCod
 bonusRat
 tradMtchPrcNo
 acctTypCodXontro
 iwOrdCod
 isinCod
 isinCodSrs
 tradBegDat
 tradContTim
 tradContTimFraction
 tradContDat
 repExchangeld
 feeFlag
 fee
 textTrad
 inSeqNoRef
 ctpyTradMtchPrc
 trdTypXontro
 tvTic
 venueMic
 shortSellCod
 otcPostTradInd

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 175
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.6 Löschung einer Aufgabe am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_DELETE_BTRADE** werden am Back End durchgeführte Löschungen von Aufgaben zugestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_del_btradeT	btradeNo isinCod

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 176
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.7 Stornierung einer Aufgabe am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_CANCEL_BTRADE** werden am Back End durchgeführte Stornierungen von Aufgaben zugestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_can_btradeT	btradeNo isinCod

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 177
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.8 Löschung einer Aufgabe am Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_DELETE_BTRADE** werden am Front End durchgeführte Löschungen von Aufgaben zugestellt:

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_del_btrade_feT	btradeNo isinCod inSeqNoRef

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 178
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.9 Stornierung einer Aufgabe am Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_CANCEL_BTRADE** werden am Front End durchgeführte Stornierungen von Aufgaben zugestellt:

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_can_btrade_feT	btradeNo isinCod inSeqNoRef

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 179
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.10 Schließung von Aufgaben am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_MATCH_BTRADE** werden am Back End durchgeführte Schließungen von Aufgaben zugestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_match_btradeT	btradeNo changeQty isinCod

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 180
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.11 Schließung von Aufgaben am Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE_MATCH_BTRADE** werden am Front End durchgeführte Schließungen von Aufgaben zugestellt:

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_match_btrade_feT	btradeNo changeQty isinCod inSeqNoRef

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 181
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.16.1.12 Änderung einer Aufgabe am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_MODIFY_BTRADE** werden am Back End durchgeführte Änderungen von Aufgaben zugestellt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_mod_btradeT	btradeNo changeQty isinCod

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 182
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.16.2 XONTRO Request Broker Trade Update Retransmission

Beschreibung Stellt eine Applikation über die Kontrolle der Output Sequence Number fest, dass Nachrichten des Streams verloren wurde, kann sie diese Nachrichten mit dem Request **XONTRO Request Broker Trade Update Retransmission** vom XONTRO Back End nachfordern.

Voraussetzung hierfür ist die korrekte Verwaltung der Output Sequence Number in der Teilnehmerapplikation.

Die Wiederholung einer Übertragung ist nur für den Notfall vorgesehen. Aufgrund eines Fehlers der Teilnehmerapplikation wurden eventuell Nachrichten verloren.

Die Synchronisierung mit dem Empfang des Broadcast Streams ist ebenfalls Sache der Teilnehmerapplikation.

Der Request fordert Nachrichten (Sequenz-Nummern-Bereiche) vom Back End an und erhält eine Bestätigung per Response.

Die angeforderten Nachrichten werden vom Xontro Back End in der Bestandstransfer-Queue mit dem Wert „T“ im Feld **qsamMsgType** bereitgestellt. Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmerapplikation, die nachgeforderten Broadcasts gesondert zu verarbeiten.

Es können maximal 100 Sequenz-Nummern (von/bis) mit einem Retransmission Request angefordert werden. Es ist Sache der Anwendung, zu entscheiden, ob ein Folgerequest erforderlich ist.

Sind zu einem Request bzw. zu einer Sequenz-Nummer keine Daten vorhanden, dann erhält die Applikation den Completion Code „28060“ (qsamComplCode) in der Response.

qsamRequestId → BC_RET_BROKER_TRADE_UPDATE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^o
	bc_request_retransT	startStmSeqNo ^m stopStmSeqNo ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 183
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
qsamStreamId →	BC_RET_BROKER_TRADE_ UPDATE_STREAM_TYPE	
	mehrere Nachrichten: jeweils ein Broadcast Header und eine der aufgeführten Strukturen	
Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat* tranTim* execTranDat* execTranTim* errFieldRef* outSeqNo* bkrUserNo* isinCod* subType*
	(bc_brd_ent_temp_btradeT, bc_brd_mod_temp_btradeT, bc_brd_del_temp_btradeT, bc_brd_ent_btradeT, bc_brd_ent_btrade_2T, bc_brd_ent_btrade_feT, bc_brd_ent_btrade_fe_2T, bc_brd_can_btradeT, bc_brd_del_btradeT, bc_brd_can_btrade_feT, bc_brd_del_btrade_feT, bc_brd_match_btradeT, bc_brd_mod_btradeT, bc_brd_match_btrade_feT)	

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 184
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.17 Informationen zum Handel unter Maklern (HUM)

Die folgenden Tabellen beschreiben die Subtypes und Datenstrukturen der Broadcasts.

qsamStreamId	BC_PRIVATE_BROKER_TRADE_UPDATE_STREAM_TYPE
qsamMsgId	B = Broadcast
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	outSeqNo
Broadcast Queue	XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Response Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + bc_brd_mod_humT

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 185
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.17.1 XONTRO Broker Trade Update (HUM)

Beschreibung Der Stream **XONTRO Broker Trade Update** versorgt das Front End – neben den zahlreichen Nachrichten zur Aktualisierung der Aufgabensituation – auch mit allen erforderlichen Informationen zum Handel unter Maklern. Übermittelt werden zwei Subtypes BCBE_MODIFY_HUM und BCFE_MODIFY_HUM – abhängig davon, ob das auslösende Ereignis auf dem Back End oder dem Front End auftrat. Die Informationsinhalte der Nachrichten sind für beide Subtypes identisch.

Ein Teilnehmer erhält immer dann eine Nachricht, wenn er neu in die Position des Endkontrahenten einer HUM-Kette eintritt oder diese verlässt und sofern es sich bei dieser Position nicht um eine Aufgabe handelt. Dabei bleibt die eigentliche Kette anonym, die Information wird lediglich über die Schlüsselwerte

isinCod, buyCod, ctpyNo, tradMtchPrc identifiziert.

Mit diesen Informationen kann er eine Positionsführung seiner HUM-Geschäfte aufbauen.

Neben der reinen Informationsfunktion erhält der Teilnehmer die Möglichkeit, über das XONTRO VALUES API Gegeneingaben einzustellen und damit seine eigenen HUM-Positionen zu reduzieren.

Hierzu kann er die bestehenden Requests XONTRO Enter Single Trade oder XONTRO Enter Broker Trade nutzen.

Folgende Subtypes (subType) werden hierfür¹⁹ angeliefert:

Subtype	Verwendung
BCBE_MODIFY_HUM	Änderung einer HUM-Position durch das Back End
BCFE_MODIFY_HUM	Änderung einer HUM-Position durch das Front End

¹⁹ über diesen Stream werden auch die Broadcastnachrichten für die Aktualisierung des Aufgabenbestands verschickt. Diese Subtypes sowie ihre Strukturen werden in **2.1.14 Aktualisierung des Aufgabenbestands** beschrieben

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 186
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamStreamId → BC_PRIVATE_BROKER_TRADE_UPDATE_STREAM_TYPE

Broadcast Data bc_qsam_broadcast_headerT qsamId
 qsamMsgType
 qsamExchangeld
 qsamDat
 qsamBkrNo
 qsamStreamId

bc_broadcast_headerT tranDat
 tranTim
 execTranDat
 execTranTim
 errFieldRef
 outSeqNo
 bkrUserNo
 isinCod
 subType

bc_brd_mod_humT ctpyNo
 buyCod
 tradMtchPrc
 changeQty
 tradBegDat
 tradContTim
 currExcRat
 acrIntDay
 acrIntDayCod
 valueDatCod
 valueDat
 repExchangeld
 textTrad

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 187
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.17.2 XONTRO Request Broker Trade Update Retransmission (HUM)

Beschreibung Stellt eine Applikation über die Kontrolle der Output Sequence Number fest, dass eine Nachricht des Streams verloren wurde, kann sie diese Nachricht mit dem Request **XONTRO Request Broker Trade Update Retransmission** vom XONTRO Back End nachfordern.

Voraussetzung hierfür ist die korrekte Verwaltung der Output Sequence Number in der Teilnehmerapplikation.

Die Wiederholung einer Übertragung ist nur für den Notfall vorgesehen. Aufgrund eines Fehlers der Teilnehmerapplikation wurden eventuell Nachrichten verloren.

Die Synchronisierung mit dem Empfang des Broadcast Streams ist ebenfalls Sache der Teilnehmerapplikation.

Der Request fordert Nachrichten (Sequenz-Nummern-Bereiche) vom Back End an und erhält eine Bestätigung per Response.

Die angeforderten Nachrichten werden vom Xontro Back End in der Bestandstransfer-Queue mit dem Wert „T“ im Feld **qsamMsgType** bereitgestellt. Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmerapplikation, die nachgeforderten Broadcasts gesondert zu verarbeiten.

Es können maximal 100 Sequenz-Nummern (von/bis) mit einem Retransmission Request angefordert werden. Es ist Sache der Anwendung, zu entscheiden, ob ein Folgerequest erforderlich ist.

Sind zu einem Request bzw. zu einer Sequenz-Nummer keine Daten vorhanden, dann erhält die Applikation den Completion Code „28060“ (qsamComplCode) in der Response.

qsamRequestId → BC_RET_BROKER_TRADE_UPDATE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^o
Data	bc_request_retransT	startStmSeqNo ^m stopStmSeqNo ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 188
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

	<i>bc_response_headerT</i>	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
qsamStreamId →	BC_RET_BROKER_TRADE_ UPDATE_STREAM_TYPE	
	mehrere Nachrichten: jeweils ein Broadcast Header und eine der aufgeführten Strukturen	
Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	mehrere Nachrichten: jeweils ein Broadcast Header und eine Struk- tur vom Typ bc_brd_mod_humT	
	bc_broadcast_headerT	tranDat* tranTim* execTranDat* execTranTim* errFieldRef* outSeqNo* bkrUserNo* isinCod* subType*
	bc_brd_mod_humT	

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 189
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.18 Geschäftseingabe über das Front End (allgemein)

Die folgende Tabelle beschreibt die Requests sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Enter Single Trade
Request ID	BC_ENTER_SINGLE_TRADE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_enter_single_tradeT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 190
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.18.1 XONTRO Enter Single Trade

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Single Trade** dient dem Makler zur Einstellung von Geschäften.

Bei erfolgreicher Einstellung eines Geschäfts erfolgt lediglich eine formale Quittung über die Annahme des Auftrags. Es werden keine inhaltlichen Informationen zurückgeliefert.

Tritt bei der Annahme des Auftrags auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der lediglich eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Falls es sich bei der übermittelten Nachricht um eine Aufgabe handelt, wird bei erfolgreicher Durchführung des Requests ein Broadcast generiert.

Er enthält alle für diese Aufgabe vom Back End zusätzlich erzeugten Daten. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, muss den Broadcast auswerten. Hierzu ist der Stream **XONTRO Broker Trade Update** zu verwenden.

Dieser Broadcast wird nach der endgültigen Ermittlung der Aufgabennummer im Rahmen der Geschäftsabwicklung erzeugt.

qsamRequestId → BC_ENTER_SINGLE_TRADE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_enter_single_tradeT	isinCod ^m tradMtchPrc ^m bkrNo ^m tradMtchQty ^m tradBegDat ^o tradContTim ^m tradContDat ^o currExcRat ^o acrIntDay ^o acrIntDayCod ^o bonusRat ^o

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 191
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

*Diese Struktur wird auf der folgenden
Seite fortgesetzt*

valueDatCod °
valueDat °
trdTypXontro °
settlementFlag °
shortSellCod °
venueSegMic °
ctpyNoAsk ^m
btradeNoAsk °
matchFlagAsk °
acctTypCodXontroAsk °
iwOrdCodAsk °
tradMtchPrcAsk °
feeFlagAsk °
feeAsk °
tranFeeFlagAsk °
tranFeeAsk °
repExchangeldAsk °
textTradAsk °
ctpyNoBid ^m
btradeNoBid °
matchFlagBid °
acctTypCodXontroBid °
iwOrdCodBid °
tradMtchPrcBid °
feeFlagBid °
feeBid °
tranFeeFlagBid °
tranFeeBid °
repExchangeldBid °
textTradBid °

Response Data bc_qsam_response_headerT

qsamId
qsamMsgType
qsamRequestId
qsamExchangeld
qsamUserId
qsamComplCode

bc_response_headerT

tranDat
tranTim
execTranDat
execTranTim
errFieldRef
inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 192
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.19 Geschäftseingabe über das Front End (MAX-ONE)



Die folgende Tabelle beschreibt die Requests sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden:

Request Name	XONTRO Enter Exchange Trade
Request ID	BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_header_moT + bc_request_enter_exchange_tradeT + bc_request_enter_exchange_orderT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT + bc_response_header_moT

Request Name	XONTRO Enter Exchange Trade Reference
Request ID	BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_REF_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_header_moT + bc_request_enter_exchange_orderT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT + bc_response_header_moT

Ein in MAX-ONE entstandenes Geschäft kann zusätzlich zu den für ein Geschäft fest definierten Informationsinhalten Referenzdaten zu jeder Order enthalten, welche in das Geschäft eingeflossen ist. Die Anzahl der Orders ist nicht beschränkt; damit gibt es auch keinen Grenzwert für die Länge einer solchen Nachricht. Für die Übermittlung eines MAX-ONE Geschäfts an XONTRO müssen die Daten in der MAX-ONE Applikation in mehrere Nachrichten aufgeteilt werden. Das XONTRO Values API stellt hierzu zwei Requests zur Verfügung:

Einen Request **XONTRO Enter Exchange Trade**, welcher alle Basisdaten des Geschäfts und optional Orderreferenzen und einen Request **XONTRO Enter Exchange Trade Reference**, welcher ausschließlich Orderreferenzen überträgt. Die einzelnen Teilnachrichten werden in XONTRO wieder zusammengesetzt und als ein Geschäft weiter verarbeitet. Dies gilt nur, wenn alle Teilnachrichten fehlerfrei waren. Bei Fehlern wird – ebenso wie bei einem nicht vorhandenen Request **XONTRO Enter Exchange Trade** – die gesamte Kette der Teilnachrichten verworfen.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 193
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Die Reihenfolge der Requests ist nicht beliebig: Zunächst sind alle Teilnachrichten zu versenden, welche nur Orderreferenzen enthalten (**XONTRO Enter Exchange Trade Reference**), dann die abschließende Teilnachricht (**XONTRO Enter Exchange Trade**), welche auch die Basisdaten enthält.

Besondere Bedeutung hat die erste Teilnachricht. Ihre Input Sequence Number muss in allen Folge-requests als Referenzschlüssel mitgegeben werden. Mit Hilfe dieses Schlüssels können die Teilnachrichten vom Back End wieder zusammengesetzt werden.

Können alle Orderreferenzen in der Nachrichtenstruktur des Request **XONTRO Enter Exchange Trade** untergebracht werden, dann genügt ein Aufruf dieses Requests zur Übertragung aller Daten des Geschäfts.

Der Teilnehmer ist selbst dafür verantwortlich, dass die in den Requests angegebenen Nominalsummen der Orders und die Gesamtnominalen des Geschäfts übereinstimmen. Die Aufteilung der Orderreferenzen auf Einzelnachrichten kann aber prinzipiell beliebig vorgenommen werden.

Werden bei der Verarbeitung des Geschäfts in XONTRO Trade Aufgaben oder Eigengeschäfte festgestellt, dann werden die entsprechenden Broadcaststreams bedient.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 194
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.19.1 XONTRO Enter Exchange Trade

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Exchange Trade** dient zur Übermittlung der „Basisdaten“ eines in MAX-ONE zustande gekommenen Geschäfts an XONTRO. Optional können Orderreferenzen mitgegeben werden.



Wird die Übermittlung in mehrere Teilnachrichten aufgespalten, dann muss der Request der letzte in der Kette der Teilnachrichten sein. In diesem Fall ist im Feld inSeqNoRef die Input Sequence Number der ersten Teilnachricht mitzugeben. Ein Wert 0 im Feld inSeqNo wird nicht akzeptiert.

Es ist unbedingt darauf zu achten, dass der Request nur dann benutzt wird, wenn alle vorangegangenen Requests des Typs **XONTRO Exchange Trade Reference** vom Back End positiv quittiert wurden, s. **2.2.4** Programmierhinweise für MAX-ONE. **Hierfür ist der Teilnehmer selbst verantwortlich.**

Bei erfolgreicher Einstellung eines Geschäfts (das gegebenenfalls in mehreren fehlerfreien Teilnachrichten übermittelt wurde) erfolgt lediglich eine formale Quittung über die Annahme des Auftrags. Es werden keine inhaltlichen Informationen zurückgeliefert.

Tritt bei der Annahme des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlnachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Liegt ein feldspezifischer Fehler in einer Wiederholgruppe vor, dann enthält das Feld occurrence die Nummer der Wiederholgruppe (Zählung ab 1), sonst 0.

Die Prüfung der Nachricht wird beim ersten Fehler beendet.

Trat bei einer der vorangegangenen Teilnachrichten ein formaler oder logischer Fehler auf, dann erhält das Front End ebenfalls einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Falls es sich bei dem übermittelten Geschäft um eine Aufgabe oder ein Eigen-geschäft handelt, wird bei erfolgreicher Durchführung des Requests ein Broadcast generiert.

Dieser Broadcast wird nach der endgültigen Ermittlung der Aufgabennummer im Rahmen der Geschäftsabwicklung erzeugt.

Er enthält alle für diese Aufgabe vom Back End zusätzlich erzeugten Daten. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, muss den Broadcast auswerten. Hierzu ist der Stream **XONTRO Broker Trade Update** oder der Stream **XONTRO Own Trade Update** zu verwenden.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 195
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

qsamRequestId → BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_header_moT	inSeqNoRef ^o
	bc_request_enter_exchange_tradeT	isinCod ^m tradMtchPrc ^m bkrNo ^m tradMtchQty ^m tradBegDat ^o tradContTim ^m tradContTimFraction ^m tradContDat ^o currExcRat ^o acrIntDay ^o acrIntDayCod ^o bonusRat ^o valueDatCod ^o valueDat ^o trdTypXontro ^o tvTic ^m otcPostTradInd ^o shortSellCod ^o venueSegMic ^o ctpyNoAsk ^m btradeNoAsk ^o matchFlagAsk ^o acctTypCodXontroAsk ^o iwOrdCodAsk ^o tradMtchPrcAsk ^o feeFlagAsk ^o feeAsk ^o repExchangeIdAsk ^o textTradAsk ^o

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 196
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

		onBehalfCtpyNoAsk ^r
		comCodAsk ^r
		comAmtAsk ^r
		comRateAsk ^r
		chargesAsk ^r
		ctpyNoBid ^m
		btradeNoBid ^o
		matchFlagBid ^o
		acctTypCodXontroBid ^o
		iwOrdCodBid ^o
		tradMtchPrcBid ^o
		feeFlagBid ^o
		feeBid ^o
		repExchangeldBid ^o
		textTradBid ^o
		onBehalfCtpyNoBid ^r
		comCodBid ^r
		comAmtBid ^r
		comRateBid ^r
		chargesBid ^r
	<i>bis zu 60-mal</i>	
	bc_request_enter_exchange_orderT	buyCod ^o
		tradMtchQty ^o
		origOrdQty ^o
		userOrdNum ^o
		exchangeOrdNum ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId
		qsamMsgType
		qsamRequestld
		qsamExchangeld
		qsamUserId
		qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat
		tranTim
		execTranDat
		execTranTim
		errFieldRef
		inSeqNo
	bc_response_header_moT	occurrence

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 197
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.19.2 XONTRO Enter Exchange Trade Reference

Beschreibung Der Request **XONTRO Enter Exchange Trade Reference** dient zur Übermittlung zusätzlicher Orderreferenzen eines in MAX-ONE zustande gekommenen Geschäfts an XONTRO.



Alle Requests dieses Typs müssen vor dem Basisrequest XONTRO Enter Exchange Trade geschickt werden.

Im ersten Request des Typs ist das Feld inSeqNo mit einer gültigen Input Sequence Number > 0 zu belegen. Das Feld inSeqNoRef muss mit 0 belegt werden.

Die folgenden Requests des Typs müssen das Feld inSeqNo ebenfalls mit einer gültigen Input Sequence Number > 0 belegen. Das Feld inSeqNoRef muss mit der Input Sequence Number des ersten Requests belegt werden.

Tritt bei der Annahme des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlernachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt. Liegt ein feldspezifischer Fehler in einer Wiederholgruppe vor, dann enthält das Feld occurrence die Nummer der Wiederholgruppe (Zählung ab 1), sonst 0.

Die Prüfung der Nachricht wird beim ersten Fehler beendet.

Tritt bei einer der Teilnachrichten ein formaler oder logischer Fehler auf, dann wird die gesamte Nachrichtenkette verworfen. Ein folgender Basisrequest erhält einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 198
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

qsamRequestId →	BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_REF_ RID	
Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeId ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_header_moT	inSeqNoRef ^m
	<i>bis zu 60-mal</i>	
	bc_request_enter_exchange_orderT	buyCod ^o tradMtchQty ^o origOrdrQty ^o userOrdNum ^o exchangeOrdNum ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeId qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
	bc_response_header_moT	occurrence

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 199
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.20 Stornierung von Aufgaben und Geschäften über das Front End

Die folgende Tabelle beschreibt die Requests sowie die Datenstrukturen für Request und Response. Die Correlation ID des MQMD muss mit dem numerischen Börsenplatz belegt werden.

Request Name	XONTRO Cancel Trade
Request ID	BC_CANCEL_TRADE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT + bc_request_can_tradeT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 200
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.20.1 XONTRO Cancel Trade

Beschreibung Der Request **XONTRO Cancel Trade** dient dem Makler zum Stornieren von Aufgaben und Geschäften.

Das Identifikationskriterium für das **Stornieren von Geschäften** ist die Geschäftsnummer (tradNo) und die ISIN (isinCod). Die Eingabe der Geschäftsart (buyCod) und des Kontrahenten (ctpyNo) wird erforderlich, wenn der Makler in einer HUM-Kette der Eingaber für die Kauf- und Verkaufseite ist und jeweils auf beiden Seiten eine Bank als Kontrahent benannt ist.

Das Identifikationskriterium für das **Stornieren von Aufgaben** ist die Aufgabennummer (anzugeben im Feld tradNo) und die ISIN (isinCod). Es können sowohl vorläufige wie auch endgültige Aufgaben storniert werden.

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene Aufgaben- oder Geschäftsnummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB_BC_BTRADE_ERROR.

Tritt bei der Stornierung auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlnachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests erhält das Front End eine positive Response, in der nur der Header belegt ist. Zusätzlich können folgende Broadcasts generiert werden:

Bei der **Stornierung von Geschäften** wird der Broadcast BCBE_BROKER_DIARY verschickt.

Bei der **Stornierung von Aufgaben** wird im Broadcast BCFE_CANCEL_BTRADE die inSeqNo des Requests im Feld inSeqNoRef des Broadcasts zurückgegeben. Zusätzlich wird ein Broadcast BCBE_BROKER_DIARY verschickt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 201
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_CANCEL_TRADE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_can_tradeT	tradNo ^m isinCod ^m buyCod ^o ctpyNo ^o
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 202
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.21 Aktualisierung der Eigengeschäfte und des Maklertagebuchbestands

Die folgende Tabelle beschreibt die Subtypes und Datenstrukturen der Broadcasts.

qsamStreamId	BC_PRIVATE_OWN_TRADE_UPDATE_STREAM_TYPE
qsamMsgId	B = Broadcast
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	outSeqNo
Broadcast Queue	XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Response Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + (eine der Strukturen vom Typ bc_brd_own_tradeT, bc_diaryT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 203
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.21.1 XONTRO Own Trade Update

Beschreibung Der Stream **XONTRO Own Trade Update** versorgt das Front End mit allen Eigengeschäften und allen Geschäftsvorfällen im Maklertagebuch.

Folgende Subtypes (subType) werden hierfür angeliefert:

Subtype	Verwendung
BCBE_TRADE	Erzeugung eines Eigengeschäfts
BCBE_BROKER_DIARY	Erzeugung eines Geschäftsvorfalles im Maklertagebuch

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 204
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.21.2 Erzeugung eines Eigengeschäfts

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_TRADE** werden dem Front End alle erzeugten Eigengeschäfte zugestellt. Es werden lediglich gekennzeichnete Eigengeschäfte übermittelt.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDa tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_own_tradeT	tradCod isinCod tradMtchQty tradMtchPrc ctpyNo tradTimeStamp

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 205
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.21.3 Erzeugung eines Geschäftsvorfalles im Maklertagebuch

Beschreibung Über den Subtype **BCBE_BROKER_DIARY** werden dem Front End alle für den Makler relevanten Geschäftsvorfälle im Maklertagebuch übermittelt.

Die Art des Geschäftsvorfalles ist im Feld tradCICod aufgeschlüsselt (siehe Feldbeschreibung).

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType

bc_diaryT

(Die Datenstruktur entspricht dem Xontro Inquire Broker Diary)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 206
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.21.4 XONTRO Request Own Trade Update Retransmission

Beschreibung Stellt eine Applikation über die Kontrolle der Output Sequence Number fest, dass Nachrichten des Streams verloren wurde, kann sie diese Nachrichten mit dem Request **XONTRO Request Own Trade Update Retransmission** nachfordern.

Voraussetzung hierfür ist die korrekte Verwaltung der Output Sequence Number in der Teilnehmerapplikation.

Die Wiederholung einer Übertragung ist nur für den Notfall vorgesehen. Aufgrund eines Fehlers der Teilnehmerapplikation wurden eventuell Nachrichten verloren.

Die Synchronisierung mit dem Empfang des Broadcast Streams ist ebenfalls Sache der Teilnehmerapplikation.

Der Request fordert Nachrichten (Sequenz-Nummern-Bereiche) vom Back End an und erhält eine Bestätigung per Response.

Die angeforderten Nachrichten werden vom Xontro Back End in der Bestandstransfer-Queue mit dem Wert „T“ im Feld **qsamMsgType** bereitgestellt. Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmerapplikation, die nachgeforderten Broadcasts gesondert zu verarbeiten.

Es können maximal 100 Sequenz-Nummern (von/bis) mit einem Retransmission Request angefordert werden. Es ist Sache der Anwendung, zu entscheiden, ob ein Folgequest erforderlich ist.

Sind zu einem Request bzw. zu einer Sequenz-Nummer keine Daten vorhanden, dann erhält die Applikation den Completion Code „28060“ (qsamComplCode) in der Response.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 207
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_RET_OWN_TRADE_UPDATE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
--------------	-------------------------	---

	bc_request_headerT	inSeqNo ^o
--	--------------------	----------------------

	bc_request_retransT	startStmSeqNo ^m stopStmSeqNo ^m
--	---------------------	---

Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
---------------	--------------------------	---

	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
--	---------------------	--

qsamStreamId → BC_RET_OWN_TRADE_UPDATE_STREAM_TYPE

mehrere Nachrichten: jeweils ein Broadcast Header und eine der aufgeführten Strukturen

Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
------	---------------------------	---

	bc_broadcast_headerT	tranDat* tranTim*
--	----------------------	----------------------

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 208
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

execTranDat*
execTranTim*
errFieldRef*
outSeqNo*
bkrUserNo*
isinCod*
subType*

(bc_brd_own_tradeT,
bc_diaryT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 209
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.22 Bestandsinformationen Maklertagebuch

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsinformationen.

qsamStreamId	BC_INQUIRE_BROKER_DIARY_STREAM_TYPE
qsamMsgType	I = Bestandstransfer (Initialbestand)
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	bKeyInq
Bestandstransfer Queue	XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_diaryT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 210
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.22.1 XONTRO Inquire Broker Diary

Beschreibung Der Stream **BC_INQUIRE_BROKER_DIARY_STREAM_TYPE** liefert dem Front End die Daten des Maklertagebuchs zum Zeitpunkt des Abschlusses des vorherigen Börsentags.

Der Stream liefert mehrere Einträge in einer Nachricht. Die tatsächliche Länge der Antwort (MQ Layer) ermittelt werden. Die Nachricht muss von der Anwendung in einzelne Aufgaben aufgeteilt werden. Die erste Nachricht wird mit bKeyInq = 1 geliefert. Alle Folgenachrichten enthalten eine lückenlos aufsteigende Sequenz-Nummer.

Sind noch keine Bestandsdaten vorhanden, dann erhält die Applikation den Zugriffsfehler des MQ Layers. Die Applikation kann den Lesezugriff zu einem späteren Zeitpunkt wiederholen.

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType BCBE_DIARY_END feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn für eine KV-Nummer keine Einträge für das Maklertagebuch vorliegen. Im Standardfall ist subType mit BCBE_DIARY belegt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 211
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

qsamStreamId → BC_INQUIRE_BROKER_DIARY_
STREAM_TYPE

Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_key_inquireT	bKeyInq
	mehrfach bc_subTypeT	subType*
	bc_diaryT	acctTypCodXontroAsk* acctTypCodXontroBid* acrIntDay* acrIntDayCod* bkrDiaryNo* bkrSubNo* bkrUserNo* bonusDifAmtAsk* bonusDifAmtBid* bonusRat* bonusRatAsk* bonusRatBid* btradeCodAsk* btradeCodBid* btradeEnfCod* btradeTextAsk* btradeTextBid* busDat* clearingCurrTypCod* ctpyNoAsk* ctpyLeiAsk* ctpyNoBid* ctpyLeiBid* currExcRat* currExcRatAsk* currExcRatBid* eccpCod* exchangeldAsk*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 212
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

exchangeldBid*
 feeAsk*
 feeBid*
 feeFlagAsk*
 feeFlagBid*
 tranFeeAsk*
 tranFeeBid*
 tranFeeFlagAsk*
 tranFeeFlagBid*
 humNo*
 isinCod*
 iwOrdCodAsk*
 iwOrdCodBid*
 textTradAsk*
 textTradBid*
 tradBegDat*
 tradCICod*
 tradClearingPrc*
 tradDifAmtAsk*
 tradDifAmtBid*
 tradMtchPrc*
 tradMtchPrcAsk*
 tradMtchPrcBid*
 tradMtchPrcNoAsk*
 tradMtchPrcNoBid*
 tradMtchPrcType*
 tradMtchQty*
 tradNo*
 tradNoAsk*
 tradNoBid*
 tradNoOld*
 tradTim*
 tranContDatAsk*
 tranContDatBid*
 tranContTimAsk*
 tranContTimFractionAsk*
 tranContTimBid*
 tranContTimFractionBid*
 tranExchangeld*
 trdTypXontroAsk*
 trdTypXontroBid*
 userNo*
 valueDat*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 213
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

valueDatCod*
xontroOdrCodAsk*
xontroOdrCodBid*
repExchangeldAsk*
repExchangeldBid*
customerldClassAsk*
customerldClassBid*
customerldAsk*
customerldBid*
commissionAgentFlagAsk*
commissionAgentFlagBid*
settlementFlag*
tvTicAsk*
tvTicBid*
venueMic*
shortSellCod*
otcPostTradIndAsk*
otcPostTradIndBid*
venueSegMic*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 214
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.23 Supportfunktionen zur Behandlung von Mistrades

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für Request und Response.

Request Name	XONTRO Reset Price
qsamRequestId	BC_RESET_PRICE_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_response_headerT + bc_request_headerT + bc_request_reset_priceT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT

Request Name	XONTRO Reset Price Info
qsamRequestId	BC_RESET_PRICE_INFO_RID
Correlation ID	qsamExchangeld
Request Queue	XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>
Request Data	bc_qsam_response_headerT + bc_request_headerT + bc_request_reset_price_infoT
Response Queue	XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>
Response Data	bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT

qsamStreamId	BC_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE
qsamMsgType	B = Broadcast
Correlation ID	qsamDate + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	outSeqNo
Bestandstransfer Queue	XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT (+ eine Struktur vom Typ bc_brd_reset_priceT oder bc_brd_reset_order_skmT oder bc_brd_reset_order_fmT)

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 215
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 216
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.23.1 XONTRO Reset Price

Beschreibung Mit Hilfe des Requests **XONTRO Reset Price** kann ein skontroführender Makler eine bestimmte Kursfeststellung annullieren oder korrigieren²⁰.

Ist das Feld tradMtchPrc = ‚Zero‘ und das Feld tradMtchCod = ‚blank‘, so wird eine Kurslöschung durchgeführt.

Im Feld refTim ist die Kursbestätigungszeit des Kurses (execTranTim oder tradMtchPrcTim) aus den Broadcasts

BCBE_ENTER_PRICE,
BCFE_ENTER_PRICE,
BCBE_ENTER_PRICE_TAB,
BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_TAB,
BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE
mitzugeben.

Für die Kursänderung und -löschung gelten folgende Restriktionen:

- es können nur Kursfeststellungen vom aktuellen Börsentag geändert bzw. gelöscht werden
- manuell **eingefügte** Kurse können weder geändert noch gelöscht werden
- der erste Kurs und der Kassakurs können nicht gelöscht werden
- ist der erste Kurs als „abweichender variabler Kurs“ durch einen Kassakurs generiert, kann dieser nicht geändert werden
- bei Änderung bzw. Löschung eines Kurses muss die Auszeichnung aller betroffenen Orders abgeschlossen sein

Nach erfolgreicher Durchführung erhält der skontroführende Makler eine Nachricht vom Subtype BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_MAN auf dem Stream BC_PRIVATE_ORDER_UPDATE_STREAM_TYPE.

Weiterhin werden dem skontroführenden Makler alle von der Kursfeststellung betroffenen, an ihn gerichteten Orders im Stream der Private Status News in einer oder mehreren Nachrichten des Subtypes BCFE_RESET_ORDER_SKM übermittelt. Alle weiteren Verarbeitungsschritte – Stornierung der Geschäfte etc. – müssen vom skontroführenden Makler getrennt angestoßen werden.

Nach erfolgreicher Durchführung wird außerdem eine Nachricht hierüber an jeden Freimakler des betroffenen Börsenplatzes geschickt. Verwendet werden hierzu der Stream der Private Status News und der Subtype BCFE_RESET_PRICE.

Tritt bei der Annahme des Requests auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationsspezifischen Completion Code (qsamCompIcode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlermeldung, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

²⁰ eine Neueingabe eines Kurses ist mit diesem Request nicht möglich

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 217
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_RESET_PRICE_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_reset_priceT	isinCod ^m tradMtchCod ^o tradMtchPrc ^m tradMtchPrcNo ^m ordrBkExeQty ^o refTim ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 218
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.23.2 XONTRO Reset Price Info

Beschreibung Hat ein skontroführender Makler eine bestimmte Kursfeststellung annulliert oder korrigiert, dann kann jeder Freimakler des betroffenen Börsenplatzes mit Hilfe des Requests **XONTRO Reset Price Info** alle von der Kursfeststellung betroffenen Orders ermitteln, in denen er Empfänger oder Aufgeber war.

Zur Versorgung des Requests sind die Daten zu verwenden, die dem Freimakler über den Stream der Private Status News im Subtype BCFE_RESET_PRICE mitgeteilt wurden.

Bei erfolgreicher Durchführung werden dem Freimakler alle von der Kursfeststellung betroffenen Orders im Stream der Private Status News in einer oder mehreren Nachrichten des Subtypes BCFE_RESET_ORDER_FM übermittelt.

Der Request wird nicht akzeptiert, wenn für die betroffene Kursfeststellung kein Request **XONTRO Reset Price** durchgeführt wurde.

Tritt bei der Annahme des Auftrags auf dem Back End ein formaler oder logischer Fehler auf, der lediglich eine Ablehnung dieses speziellen Requests zur Folge hat, dann erhält das Front End einen situationspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Handelt es sich um eine feldspezifische Fehlnachricht, dann ist das Headerfeld errFieldRef belegt und kann vom Front End ausgewertet werden.

In der Response ist nur der Header belegt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 219
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamRequestId → BC_RESET_PRICE_INFO_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^m
	bc_request_reset_price_infoT	isinCod ^m tradMchPrcNo ^m refTim ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode
	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 220
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.23.3 XONTRO Subscribe Private Status News

Beschreibung Im Stream **BC_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE** erhält ein skontroführender Makler über den Subtype **BCFE_RESET_ORDER_SKM** alle eigenen Orders zu Kursfeststellungen, die er mit Hilfe des Requests **XONTRO Reset Price** annulliert oder geändert hat.

Ein Freimakler erhält in diesem Stream über den Subtype **BCFE_RESET_PRICE** zunächst nur die Information, dass ein bestimmter Kurs annulliert oder geändert wurde. Er kann die übermittelten Daten dazu verwenden mit einem Request **XONTRO Reset Price Info** alle eigenen Orders anzufordern die betroffen waren. Diese werden im gleichen Stream mit dem Subtype **BCFE_RESET_ORDER_FM** zugestellt.

Die Nachrichten vom Subtype **BCFE_RESET_ORDER_SKM** bzw. **BCFE_RESET_ORDER_FM** enthalten mehrere Orders pro Nachricht. Folgt keine weitere Nachricht, dann werden die Subtypes **BCFE_RESET_ORDER_SKM_END** bzw. **BCFE_RESET_ORDER_FM_END** geliefert.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 221
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.23.3.1 Kursanullierung/Kursänderung

Beschreibung Der Subtype BCFE_RESET_PRICE liefert folgende Daten:

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_reset_priceT	tradMtchPrcNo refTim

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 222
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.23.3.2 Orderinformation für den skontroführenden Makler

Beschreibung Die Subtypes BCFE_RESET_ORDER_SKM bzw. BCFE_RESET_ORDER_SKM_END liefern die unten aufgeführten Daten. Es ist möglich, dass in einer letzten Nachricht (BCFE_RESET_ORDER_SKM_END) keine Orderdaten vorhanden sind. Dann enthält bc_counterT den Wert 0. Die Nachricht ist dennoch notwendig um dem Teilnehmer das Ende der Übertragung für diese Kursfeststellung zu signalisieren.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_reset_priceT	tradMtchPrcNo refTim
	bc_counterT	counter
	<i>bis zu 30 Einträge</i>	
	bc_brd_reset_order_skmT	buyCod ctpyNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrResCod trdResTypCod userOrdNum

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 223
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.23.3.3 Orderinformation für den Freimakler

Beschreibung Die Subtypes BCFE_RESET_ORDER_FM bzw. BCFE_RESET_ORDER_FM_END liefern die unten aufgeführten Daten. Es ist möglich, dass in einer letzten Nachricht (BCFE_RESET_ORDER_FM_END) keine Orderdaten vorhanden sind. Dann enthält bc_counterT den Wert 0. Die Nachricht ist dennoch notwendig um dem Teilnehmer das Ende der Übertragung für diese Kursfeststellung zu signalisieren.

Broadcast Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
Response Data	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
	bc_brd_reset_priceT	tradMtchPrcNo refTim
	bc_counterT	counter
	<i>bis zu 30 Einträge</i>	
	bc_brd_reset_order_fmT	buyCod bkrNo ctpyNo ordrExePrc ordrExpDat ordrNo ordrQty ordrResCod trdResTypCod userOrdNum

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 224
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.23.4 XONTRO Request Private Status News Retransmission

Beschreibung Stellt eine Applikation über die Kontrolle der Output Sequence Number fest, dass Nachrichten des Streams verloren wurden, kann sie diese Nachrichten mit dem Request **XONTRO Request Private Status News Retransmission** vom Back End nachfordern.

Voraussetzung hierfür ist die korrekte Verwaltung der Output Sequence Number in der Teilnehmerapplikation.

Die Wiederholung einer Übertragung ist nur für den Notfall vorgesehen. Aufgrund eines Fehlers der Teilnehmerapplikation wurden eventuell Nachrichten verloren.

Die Synchronisierung mit dem Empfang des Broadcast Streams ist ebenfalls Sache der Teilnehmerapplikation.

Der Request fordert Nachrichten (Sequenz-Nummern-Bereiche) vom Back End an und erhält eine Bestätigung per Response.

Die angeforderten Nachrichten werden vom Xontro Back End in der Bestandstransfer-Queue mit dem Wert „T“ im Feld **qsamMsgType** bereitgestellt. Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmerapplikation, die nachgeforderten Broadcasts gesondert zu verarbeiten.

Es können maximal 100 Sequenz-Nummern (von/bis) mit einem Retransmission Request angefordert werden. Es ist Sache der Anwendung, zu entscheiden, ob ein Folgerequest erforderlich ist.

Sind zu einem Request bzw. zu einer Sequenz-Nummer keine Daten vorhanden, dann erhält die Applikation den Completion Code „28060“ (qsamComplCode) in der Response.

qsamRequestId → BC_RET_PRIVATE_STATUS_NEWS_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^o
	bc_request_retransT	startStmSeqNo ^m stopStmSeqNo ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 225
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
qsamStreamId →	BC_RET_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE	
	mehrere Nachrichten: jeweils ein Broadcast Header und eine der aufgeführten Strukturen	
Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat* tranTim* execTranDat* execTranTim* errFieldRef* outSeqNo* bkrUserNo* isinCod* subType*
	bc_brd_reset_priceT	
	<u>oder</u>	
	bc_brd_reset_priceT + bc_counterT + bc_brd_reset_order_skmT	
	<u>oder</u>	
	bc_brd_reset_priceT + bc_counterT + bc_brd_reset_order_fmT	

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 226
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.24 Bestandsinformationen Nebenrechte

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsinformationen:

qsamStreamId	BC_INQUIRE_SP_RIGHTS_STREAM_TYPE
qsamMsgType	I = Bestandstransfer (Initialbestand)
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	bKeyInq
Bestandstransfer Queue	XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_sp_rightT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 227
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.24.1 XONTRO Inquire Special Rights



Beschreibung Der Stream **BC_INQUIRE_SP_RIGHTS_STREAM_TYPE** liefert dem Front End den Nebenrechtsbestand zum Zeitpunkt des Abschlusses des vorherigen Börsentags. Nebenrechte des aktuellen Börsentages werden über die Subtypes **BCBE_ENTER_SP_RIGHT** und **BCFE_ENTER_SP_RIGHT** des **BC_PUBLIC_SYSTEM_STATUS_STREAM_TYPE** verteilt.

Der Stream liefert mehrere Nebenrechte in einer Nachricht. Die tatsächliche Länge kann über das Längenfeld der Antwort (MQ Layer) ermittelt werden. Die Nachricht muss von der Anwendung in einzelne Nachrichten aufgeteilt werden. Die erste Nachricht wird mit **bKeyInq = 1** geliefert. Alle Folgenachrichten enthalten eine lückenlos aufsteigende Sequenz-Nummer.

Sind noch keine Bestandsdaten vorhanden, dann erhält die Applikation den Zugriffsfehler des MQ Layers. Die Applikation kann den Lesezugriff zu einem späteren Zeitpunkt wiederholen.

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType **BCBE_BT_END** feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn keine Nebenrechte vorliegen. Im Standardfall ist subType mit **BCBE_BT** belegt.

qsamStreamId → BC_INQUIRE_SP_RIGHTS_STREAM_TYPE

Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_key_inquireT	bKeyInq
	mehrfach	
	bc_subTypeT	subType*
	bc_sp_rightT	nrCod* isinCod* isinCodNew* ordrExePrcMod* nrDat*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 228
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.25 Bestandsinformationen Stammdaten

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsinformationen:

qsamStreamId	BC_INQUIRE_SKONTRO_DATA_STREAM_TYPE
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
qsamMsgType	I = Bestandstransfer (Initialbestand)
Message ID	bKeyInq
Bestandstransfer Queue	XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Response Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_skontro_dataT)

qsamStreamId	BC_INQUIRE_SKONTRO_ISIN_STREAM_TYPE
qsamMsgType	I = Bestandstransfer (Initialbestand)
Correlation ID	qsamDate + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	bKeyInq
Bestandstransfer Queue	XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Response Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_skontro_isinT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 229
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.25.1 XONTRO Inquire Skontro Data

Beschreibung Der Stream **BC_INQUIRE_SKONTRO_DATA_STREAM_TYPE** liefert einem Teilnehmer Stammdaten zu den ISINs, in welchen er skontroführender Makler ist. Dabei werden sowohl aktive als auch historische ISINs geliefert. Historische Notierungen sind am Inhalt des Feldes **instHistCod (= 2)** zu erkennen.

Das Feld **deactCod** enthält die Information, ob eine Gattung (ISIN) kursausgesetzt ist oder nicht.

In den Feldern **tradMtchPrc** und **tradMtchCod** wird der jeweils letzte Kurs des vorhergehenden Börsentages übermittelt. Hat es an dem vorhergehenden Börsentag keinen (letzten) Kurs gegeben, so werden die Felder initialisiert übertragen.

Mit Hilfe der Depotwährung kann festgestellt werden, ob bei einer Gattung die Eingabe eines Devisenkurses notwendig ist. Dies ist dann der Fall, wenn die Gattung %-notiert (vgl. **untOfTrad**) ist und die Depotwährung nicht auf Euro lautet (Ausnahme: bei ehemaligen Währungen der Euro-Länder ist der fixe Devisenkurs im System hinterlegt).

Der Stream liefert mehrere ISINs in einer Nachricht. Die tatsächliche Länge kann über das Längelfeld der Antwort (MQ Layer) ermittelt werden. Die Nachricht muss von der Anwendung in einzelne Nachrichten aufgeteilt werden. Die erste Nachricht wird mit **bKeyInq = 1** geliefert. Alle Folgenachrichten enthalten eine lückenlos aufsteigende Sequenz-Nummer.

Sind noch keine Bestandsdaten vorhanden, dann erhält die Applikation den Zugriffsfehler des MQ Layers. Die Applikation kann den Lesezugriff zu einem späteren Zeitpunkt wiederholen.

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType **BCBE_SKONTRO_END** feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn keine Stammdaten vorliegen. Im Standardfall ist subType mit **BCBE_SKONTRO_DATA** belegt.

qsamStreamId → BC_INQUIRE_SKONTRO_DATA_STREAM_TYPE

Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_key_inquireT	bKeyInq

mehrfach

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 230
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

bc_subTypeT

subType*

bc_skontro_dataT

isinCod*
instMnem*
instShtNam*
instAlphaCod*
instSecCod*
instSubSecCod*
instStrtTradDat*
instStpTradDat*
instLastRedemptDat*
instXontroStrtTradDat*
instHistCod*
instRondLotInc*
instRondLotQty*
instRondLotMinQty*
emiCod*
currTypCod*
ordrResCodInd*
untOfTrad*
midAuctInd*
auctRondLotInc*
auctRondLotQty*
auctRondLotMinQty*
contAuctInd*
contAuctRondLotInc*
contAuctRondLotQty*
contAuctRondLotMinQty*
deactCod*
tradMtchPrc*
tradMtchCod*
tickSizeXontro*
cutoffTim*
fwdPricingDays*
fwdPricingInd*
strtSubscrptDat*
endSubscrptDat*
currTypCodDep*
custodyTypCod*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 231
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.25.2 XONTRO Inquire Skontro ISIN

Beschreibung Der Stream **BC_INQUIRE_SKONTRO_ISIN_STREAM_TYPE** liefert einem Teilnehmer die Information, in welchen Gattungen er skontroführender Makler ist.

Das Feld deactCod enthält die Information, ob eine Gattung (ISIN) kursausgesetzt ist oder nicht.

In den Feldern tradMtchPrc und tradMtchCod wird der jeweils letzte Kurs des vorhergehenden Börsentages übermittelt. Hat es an dem vorhergehenden Börsentag keinen (letzten) Kurs gegeben, so werden die Felder initialisiert übertragen.

Der Stream liefert mehrere ISINs in einer Nachricht. Die tatsächliche Länge kann über das Längenfild der Antwort (MQ Layer) ermittelt werden. Die Nachricht muss von der Anwendung in einzelne Nachrichten aufgeteilt werden. Die erste Nachricht wird mit bKeyInq = 1 geliefert. Alle Folgenachrichten enthalten eine lückenlos aufsteigende Sequenz-Nummer.

Sind noch keine Bestandsdaten vorhanden, dann erhält die Applikation den Zugriffsfehler des MQ Layers. Die Applikation kann den Lesezugriff zu einem späteren Zeitpunkt wiederholen.

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType BCBE_SKONTRO_END feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn keine Stammdaten vorliegen. Im Standardfall ist subType mit BCBE_SKONTRO_ISIN belegt.

qsamStreamId →	BC_INQUIRE_SKONTRO_ISIN_STREAM_TYPE	
Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_key_inquireT	bKeyInq
	mehrfach	
	bc_subTypeT	subType*
	bc_skontro_isinT	isinCod* deactCod* tradMtchPrc* tradMtchCod*

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 232
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.26 Administration

Die folgenden Tabellen beschreiben die Subtypes und Datenstrukturen der Broadcasts:

qsamStreamId	BC_PUBLIC_SYSTEM_STATUS_STREAM_TYPE
qsamMsgId	B = Broadcast
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	outSeqNo
Broadcast Queue	XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT (+ gegebenenfalls eine Struktur vom Typ bc_brd_dea_pricingT oder bc_sp_rightT)

qsamStreamId	BC_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE
qsamMsgId	B = Broadcast
Correlation ID	qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId
Message ID	outSeqNo
Broadcast Queue	XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>
Response Data	bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT (+ gegebenenfalls eine Struktur vom Typ bc_brd_pw_expiration_datT oder bc_brd_exchange_quote_volume_infoT oder bc_brd_bypass_quote_volume_infoT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 233
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.26.1 XONTRO System Status News

Beschreibung Der Stream **XONTRO System Status News** erhält vom Back End alle relevanten Änderungen des Systemstatus der Back End Applikation und des Back End. Außerdem werden über diesen Stream alle eingegebenen Nebenrechte übermittelt.

Es wird eine der Nachrichten

BCBE_BUS_START	(Start Buchungsschnitt)
BCBE_BUS_END	(Ende Buchungsschnitt)
BCBE_ENDOFDAY_START	(Start Tagesendeverarbeitung)
BCBE_DEACTIVATE_PRICING	(Kursaussetzung Back End)
BCFE_DEACTIVATE_PRICING	(Kursaussetzung Front End)
BCFE_DEACTIVATE_PRICING_BLOCK	(geblockte Kursaussetzungen Front End)
BCBE_REACTIVATE_PRICING	(Wiederaufnahme nach Kursaussetzung Back End)
BCFE_REACTIVATE_PRICING_BLOCK	(geblockte Rücknahmen Kursaussetzungen Front End)
BCFE_REACTIVATE_PRICING	(Wiederaufnahme nach Kursaussetzung Front End)
BCBE_DEACTIVATE_ANY_PRICING	(Unterbrechung der Kursfeststellung)
BCBE_REACTIVATE_ANY_PRICING	(Wiederaufnahme nach Unterbrechung der Kursfeststellung ²¹)
BCBE_STOP_TRADE	(Unterbrechung der Börsenversammlung)
BCBE_START_TRADE	(Wiederaufnahme der Börsenversammlung)
BCBE_ENTER_SP_RIGHT	(Nebenrecht Back End)
BCFE_ENTER_SP_RIGHT	(Nebenrecht Front End)

im Feld subType geliefert. Belegt ist nur der Broadcast Header (außer bei Kursaussetzung, Wiederaufnahme nach Kursaussetzung und Nebenrecht, s.u.).

²¹ Eine Wiederaufnahme der Kursfeststellung impliziert die Wiederaufnahme der Börsenversammlung. Der Broadcast BCBE_START_TRADE wird in diesem Fall nicht verschickt.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 234
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

qsamStreamId → BC_PUBLIC_SYSTEM_STATUS_STREAM_TYPE

Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType

Ein abweichendes Format besitzen die Broadcasts

BCBE_DEACTIVATE_PRICING,
BCFE_DEACTIVATE_PRICING,
BCBE_REACTIVATE_PRICING und
BCFE_REACTIVATE_PRICING.

Zusätzlich zum Broadcast Header wird die folgende Struktur geliefert:

bc_brd_dea_pricingT	deactFromDat deactToDat
---------------------	----------------------------

Ein abweichendes Format besitzen die Broadcasts

BCFE_DEACTIVATE_PRICING_BLOCK und
BCFE_REACTIVATE_PRICING_BLOCK.

Zusätzlich zum Broadcast Header werden die folgenden Strukturen geliefert:

bc_counterT	counter
bc_brd_pricing_blockT	isinCod deactFromDat deactToDat

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 235
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Ein abweichendes Format besitzen die Broadcasts

BCBE_ENTER_SP_RIGHT und
BCFE_ENTER_SP_RIGHT.

Zusätzlich zum Broadcast Header wird die folgende Struktur geliefert:

bc_sp_rightT	nrCod*
	isinCod*
	isinCodNew*
	ordrExePrcMod*
	nrDat*



**Wir weisen darauf hin, dass für alle Subtypes bkrUserNo und qsamBkrNo mit „0000“ belegt ist.
Der Stream hat kein Subject.**

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 236
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.26.2 XONTRO Request System Status News Retransmission

Beschreibung Stellt eine Applikation über die Kontrolle der Output Sequence Number fest, dass Nachrichten des Streams verloren wurde, kann sie diese Nachrichten mit dem Request **XONTRO Request System Status News Retransmission** vom XONTRO Back End nachfordern.

Voraussetzung hierfür ist die korrekte Verwaltung der Output Sequence Number in der Teilnehmerapplikation.

Die Wiederholung einer Übertragung ist nur für den Notfall vorgesehen. Aufgrund eines Fehlers der Teilnehmerapplikation wurden eventuell Nachrichten verloren.

Die Synchronisierung mit dem Empfang des Broadcast Streams ist ebenfalls Sache der Teilnehmerapplikation.

Der Request fordert Nachrichten (Sequenz-Nummern-Bereiche) vom Back End an und erhält eine Bestätigung per Response.

Die angeforderten Nachrichten werden vom Xontro Back End in der Bestandstransfer-Queue mit dem Wert „T“ im Feld **qsamMsgType** bereitgestellt. Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmerapplikation, die nachgeforderten Broadcasts gesondert zu verarbeiten.

Es können maximal 100 Sequenz-Nummern (von/bis) mit einem Retransmission Request angefordert werden. Es ist Sache der Anwendung, zu entscheiden, ob ein Folgerequest erforderlich ist.

Sind zu einem Request bzw. zu einer Sequenz-Nummer keine Daten vorhanden, dann erhält die Applikation den Completion Code „28060“ (qsamComplCode) in der Response.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 238
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

bc_broadcast_headerT

tranDat*
tranTim*
execTranDat*
execTranTim*
errFieldRef*
outSeqNo*
bkrUserNo*
isinCod*
subType*

(bc_brd_dea_pricingT,
bc_sp_rightT)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 239
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.1.26.3 XONTRO Private Status News

2.1.26.3.1 Standardnachrichten (Format 1)

Beschreibung Der Stream **XONTRO Private Status News** erhält vom Back End alle relevanten Änderungen des Status einer KV-Nummer.

Es wird eine der Nachrichten

BCBE_START_QUOTE	(Anforderung Start Quote Machine)
BCBE_STOP_QUOTE	(Anforderung Stop Quote Machine)
BCBE_EXCHANGE_QUOTE_VOLUME_INFO	(Status-Information über den Quote-Verbrauch des Börsen-Kontingents)
BCBE_BYPASS_QUOTE_VOLUME_INFO	(Status-Information über den Quote-Verbrauch des Bypass-Kontingents)
BCBE_NOTIFY_PW_EXPIRATION_DATE	(Restgültigkeit Passwort)

im Feld subType geliefert.

qsamStreamId → BC_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE

Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
------	---------------------------	---

	bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
--	----------------------	--

(bc_brd_pw_expiration_datT oder
bc_brd_exchange_quote_volume_infoT oder
bc_brd_bypass_quote_volume_infoT)

In **errFieldRef** wird eine nähere Information für einen BCBE_STOP_QUOTE bzw. BCBE_START_QUOTE mitgeliefert:

BC_ON_REQUEST	(auf manuelle Anforderung)
BC_VOLUME_OVERFLOW	(Stopp wegen Überschreitung des Makler-Kontingentes oder Start nach Überschreitung des Makler-Kontingentes)
BC_EXCHANGE_VOLUME_OVERFLOW	(Stopp wegen Überschreitung des Börsen-

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 240
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Kontingentes oder Start nach Überschreitung des Börsen-Kontingentes)

Für den Broadcast BCBE_NOTIFY_PW_EXPIRATION_DATE wird zusätzlich zum Broadcast Header folgende Struktur geliefert:

```
bc_brd_pw_expiration_datT      userNo
                                pwExpirationDat
```

Das gelieferte Datum ist in jedem Fall ein gültiges Kalenderdatum. Es muss jedoch kein Börsentag sein.

Für den Broadcast BCBE_EXCHANGE_QUOTE_VOLUME_INFO wird zusätzlich zum Broadcast Header folgende Struktur geliefert:

```
bc_brd_exchange_quote_       exchangeQuoteVolRate
volume_infoT                  exchangeQuoteVolMax
```

Für den Broadcast BCBE_BYPASS_QUOTE_VOLUME_INFO wird zusätzlich zum Broadcast Header folgende Struktur geliefert:

```
bc_brd_bypass_quote_         bypassQuoteVolAct
volume_infoT                  bypassQuoteVolMax
```


BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 241
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.26.3.2 Versand fehlgeschlagener Broadcasts (Format 2)

Beschreibung In seltenen Fällen kann bei spezifischen Fehlerkonstellationen des Back Ends der Versand von Broadcastnachrichten fehlschlagen. Die Reihenfolge der Sequenznummern des betroffenen Streams ist dennoch lückenlos. Eine Front End Applikation kann die Fehlersituation also nicht erkennen. Die Datenbestände von Back End und Front End können im Extremfall auseinanderlaufen.

Der Stream BC_PRIVATE_ORDER_UPDATE_STREAM_TYPE ist davon ausgenommen. Hier wird immer eine korrekte Übermittlung sichergestellt.

Mit folgendem Verfahren werden dem Teilnehmer die fehlenden Nachrichten zugestellt:

Die betroffenen Nachrichten werden ermittelt und mit dem Subtype **BCBE_LOST_MESSAGE** über den Stream der PRIVATE STATUS NEWS an alle betroffenen MISSen verschickt. Der Datenteil dieses Broadcasts besteht aus der vollständigen fehlenden Nachricht. Im Broadcastheader der fehlenden Nachricht (2. Broadcastheader) ist die Output Sequence Number mit dem Wert versorgt, den die nächste tatsächlich versendete Nachricht erhalten hat.

Damit wird dem Front End die Möglichkeit gegeben, die korrekte Position der Nachricht zu bestimmen. Fehlen zwischen zwei übermittelten Broadcasts mehrere Nachrichten, dann werden sie bei einer Wiederholung der Übertragung in der Reihenfolge übertragen, in der sie ursprünglich erzeugt wurden.

qsamStreamId → BC_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE

Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
------	---------------------------	---

Geliefert wird ein Broadcastheader und die vollständige ursprüngliche Nachricht

bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef outSeqNo bkrUserNo isinCod subType
----------------------	--

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

bc_broadcast_headerT	tranDat tranTim
----------------------	--------------------

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 242
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

execTranDat
execTranTim
errFieldRef
outSeqNo
bkrUserNo
isinCod
subType

und irgendeine der im System definierten Broadcast-Datenstrukturen

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 243
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.1.26.4 XONTRO Request Private Status News Retransmission

Beschreibung Stellt eine Applikation über die Kontrolle der Output Sequence Number fest, dass Nachrichten des Streams verloren wurden, kann sie diese Nachrichten mit dem Request **XONTRO Request Private Status News Retransmission** nachfordern.

Voraussetzung hierfür ist die korrekte Verwaltung der Output Sequence Number in der Teilnehmerapplikation.

Die Wiederholung einer Übertragung ist nur für den Notfall vorgesehen. Aufgrund eines Fehlers der Teilnehmerapplikation wurden eventuell Nachrichten verloren.

Die Synchronisierung mit dem Empfang des Broadcast Streams ist ebenfalls Sache der Teilnehmerapplikation.

Der Request fordert Nachrichten (Sequenz-Nummern-Bereiche) vom Back End an und erhält eine Bestätigung per Response.

Die angeforderten Nachrichten werden vom Xontro Back End in der Bestandstransfer-Queue mit dem Wert „T“ im Feld qsamMsgType bereitgestellt. Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmerapplikation, die nachgeforderten Broadcasts gesondert zu verarbeiten.

Es können maximal 100 Sequenz-Nummern (von/bis) mit einem Retransmission Request angefordert werden. Es ist Sache der Anwendung, zu entscheiden, ob ein Folgerequest erforderlich ist.

Sind zu einem Request bzw. zu einer Sequenz-Nummer keine Daten vorhanden, dann erhält die Applikation den Completion Code „28060“ (qsamComplCode) in der Response.

qsamRequestId → BC_RET_PRIVATE_STATUS_NEWS_RID

Request Data	bc_qsam_request_headerT	qsamId ^m qsamMsgType ^m qsamRequestId ^m qsamExchangeld ^m qsamUserId ^m
	bc_request_headerT	inSeqNo ^o
	bc_request_retransT	startStmSeqNo ^m stopStmSeqNo ^m
Response Data	bc_qsam_response_headerT	qsamId qsamMsgType qsamRequestId qsamExchangeld qsamUserId qsamComplCode

Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 244
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

	bc_response_headerT	tranDat tranTim execTranDat execTranTim errFieldRef inSeqNo
qsamStreamId →	BC_RET_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE	
	mehrere Nachrichten bestehend aus: jeweils ein Broadcast Header und gegebenenfalls die aufgeführte Struktur (Format 1) oder jeweils einem Broadcastheader und einer vollständigen Broadcastnachricht (Lost Message).	
Data	bc_qsam_broadcast_headerT	qsamId qsamMsgType qsamExchangeld qsamDat qsamBkrNo qsamStreamId
Format 1	bc_broadcast_headerT	tranDat* tranTim* execTranDat* execTranTim* errFieldRef* outSeqNo* bkrUserNo* isinCod* subType*
	(bc_brd_pw_expiration_datT oder bc_brd_exchange_quote_volume_infoT oder bc_brd_bypass_quote_volume_infoT)	
Format 2	bc_broadcast_headerT bc_broadcast_headerT	
	und irgendeine der im System definierten Broadcast-Datenstrukturen	

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 245
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.2 Programmierhinweise

2.2.1 Behandlung von Inquire-Streams

Alle Inquire-Streams liefern Datenblöcke, die mehrere Nachrichten enthalten können.

Diese Blöcke sollten wie folgt ausgewertet werden:

Die erste Struktur eines Blocks enthält grundsätzlich Headerinformationen, die bei einem Folgezugriff als Aufsetzpunkt verwendet werden können.

Dann folgen n Einzelnachrichten, die jeweils aus einem Subtype und der eigentlichen Datenstruktur bestehen. Der Subtype ist entweder mit einem für den jeweiligen Inquire-Stream spezifischen Defaultwert oder mit einem End-Code belegt.

Findet man einen End-Code, dann folgen keine weiteren Daten für diesen Stream.

Ist dies nicht der Fall, dann kann die auf den Subtype folgende Nachrichtenstruktur extrahiert und verarbeitet werden, und danach mit der Prüfung des nächsten Subtypes die Verarbeitung fortgesetzt werden.

Die Ausprägungen des Subtypes können der Beschreibung der einzelnen Inquire-Streams entnommen werden.

Aufbau eines Standardblocks:

	Nachricht 1		Nachricht 2			Nachricht n	
Header	X	Daten	X	Daten		X	Daten

Aufbau des letzten Blocks:

	Nachricht 1			Nachricht n
Header	X	Daten		End-Code

Dabei steht „X“ für den Subtype.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 246
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.2.2 Synchronisation von Quotes

Wird über den Stream **XONTRO Subscribe Order Update** einer der Subtypes **BCBE_ENTER_PRICE, BCFE_ENTER_PRICE, BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE, BCBE_ENTER_QUOTE, BCBE_DEACTIVATE_QUOTE**²² empfangen, dann ist zu beachten, dass das Back End auf dem Front End generierte Quotes in der betroffenen ISIN solange nicht mehr entgegennimmt, bis das Front End den Empfang dieser Nachrichten in dem Felde **confirmTim** quittiert hat. Aus Sicht der Anwendungsprogrammierung kann dies durch entsprechende Einträge im Request **XONTRO Enter Quote oder XONTRO Enter Mass Quote** erreicht werden²³.

Es ist Sache einer Quote Machine geeignet zu reagieren: Zunächst sollte die Generierung auf die geänderte Situation des Back End angepasst werden, dann sollte gegebenenfalls ein neuer Quote abgesetzt werden.

²² es sei denn das Back End liefert den Werte BC_DO_NOT_CONFIRM im Feld confirmTim

²³ siehe Beschreibung des Requests XONTRO Enter Quote

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 247
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

2.2.3 Blockierung von Applikation mit hohem Fehlerraten

Versendet eine Applikation fehlerhafte Requests mit hoher Frequenz, kann dieses zu ernsthaften Performanceproblemen und vorübergehenden Blockaden der gesamten Teilnehmerinstallation führen.

Um zu verhindern, dass sich das Fehlverhalten eines Einzelnen auf alle Nutzer negativ auswirkt, wird XONTRO in Zukunft alle Applikationen überwachen und bei Überschreitung einer bestimmten Fehlerquote geeignete Maßnahmen ergreifen:

Die Überwachung geschieht auf Ebene der QSAM-Id. Die Überschreitung einer definierten Fehleranzahl innerhalb eines definierten Zeitintervalls kann zu einem vorübergehenden Stopp des Teilnehmer-Channels führen.

Ein Teilnehmer sollte beim ersten Auftreten einer Sperre sofort mit geeigneten Maßnahmen reagieren, da auch für ihn selbst kein sinnvolles Weiterarbeiten mehr möglich ist.

Es können sowohl Datenmodifikationen (z.B. eine Passwortänderung) als auch Änderungen der betroffenen Applikation erforderlich sein.

Die in Simulation bzw. Produktion konkret verwendeten Werte für Sperrzeiten etc. werden den Teilnehmern im Rahmen der Release Notes mitgeteilt.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 248
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

2.2.4 Programmierhinweise für MAX-ONE

Kann ein in MAX-ONE zustande gekommenes Geschäft in einer Nachricht verschickt werden, dann existieren keine wesentlichen Besonderheiten der Programmierung. Grundsätzlich bestehen dann keine Unterschiede zu einem Request XONTRO Enter Single Trade.

Die Behandlung von Geschäften, die in mehreren Teilnachrichten versendet werden, wird an folgendem Beispiel erläutert; dabei bezeichnen der Begriff Basisrequest den Request **XONTRO Enter Exchange Trade** und der Begriff Referenzrequest den Request **XONTRO Enter Exchange Trade Reference**.



Dann sollte z. B folgende Programmiersequenz eingehalten werden²⁴:

Ermitteln der Anzahl der Teilnachrichten und der Input Sequence Numbers
Versenden des ersten Referenzrequests
Abwarten der Response; bei Fehler Abbruch der Verarbeitung

Versenden der restlichen Referenzrequests
Abwarten aller Responses; Abbruch der Verarbeitung, falls Fehler aufgetreten sind

Versenden des Basisrequests
Prüfen der Response

Auf die erste Response sollte gewartet werden, da bei einer negativen Quittung keine weiteren Teilnachrichten eingestellt werden können.

Der Basisrequest kann erst dann sinnvoll abgesetzt werden, wenn die Responses aller Reference Requests bekannt sind. Tritt nämlich bei einer Response ein Fehler auf, dann ist die gesamte Nachrichtenkette ungültig. Wird in dieser Situation trotzdem der Basisrequest abgesetzt, dann wird er mit einem Fehlercode 29370 abgewiesen.

Auf die folgende Sondersituation sollte der Anwendungsprogrammierer dabei unbedingt achten:

- Der erste Referenzrequest wurde vom Back End akzeptiert.
- Genau einer der folgenden Referenzrequests ist fehlerhaft
- Der Fehler im Request lässt keine Zuordnung zum ersten Referenzrequest zu (z. B. falsche Request-Id, Formatfehler in inSeqNoRef, etc.)

In diesem Fall kann das Back End zwar die einzelne Teilnachricht verwerfen, aber keine korrekte Zuordnung zur gesamten Kette der Nachrichten vornehmen. Trifft jetzt ein gültiger Basisrequest ein, dann wird das Geschäft – weil formal korrekt – verarbeitet. Es ist aber logisch falsch.

²⁴ das Abhören der Broadcasts ist nicht berücksichtigt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 249
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Aus diesem Grund muss die Applikation bei Auftreten der ersten negativen Response für eine Teilnachricht die Nachrichtenübertragung für dieses Geschäft abbrechen.

Natürlich kann auch voll synchron gearbeitet werden. Erforderlich ist dies jedoch nicht.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 250
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

3 Anhang

3.1 Datenformate und Initialwerte

Name	Beschreibung	Initialwerte
[n]	Länge des Feldes	
[n,m]	Länge des Feldes (n), Anzahl Nachkommastellen (m)	
char[n]	alle Zeichen (printable)	Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Spaces über die gesamte Feldlänge.
charboss[n]	zugelassener Zeichenvorrat: 1.) Spaces 2.) A – Z, a - z 3.) 0 - 9 4.) Sonderzeichen: / - ? : () . , ' +	Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Spaces über die gesamte Feldlänge.
num[n,m] num[n]	Ziffern 0 - 9, ohne Vorzeichen	Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.
Snum[n,m] Snum[n]	Ziffern 0 - 9, 1. Stelle Vorzeichen	Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge und „+“ in der ersten Stelle.
amountboss	Snum[16,2], Betrag mit Länge 15 und Genauigkeit 2 mit Vorzeichen	Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge und „+“ in der ersten Stelle.
dateboss	num[8], Datum CCYYMMDD	Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.
limitboss	num[10,4], Betrag mit Länge 10 und Genauigkeit 4 ohne Vorzeichen	Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.
priceboss	num[10,4], Betrag mit Länge 10 und Genauigkeit 4 ohne Vorzeichen	Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.
timeboss	num[8], Zeit HHMMSSCC	Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.
volumeboss	num[13,3], Betrag mit Länge 13 und Genauigkeit 3 ohne Vorzeichen	Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.

Bei einem numerischen Feld der Länge 10 sagt die Angabe num[10,4] aus, dass es sich um ein Feld mit 4 Nachkommastellen handelt. Ein Dezimalpunkt bzw. ein Dezimalkomma ist nicht explizit in den Daten vorhanden.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 251
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

3.2 Felddescription

Feldname	Definition	Bemerkung
acctTypCodXontro	char[2]	<p><u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Eigengeschäft</p> <p><u>Feldinhalt:</u> Bei Requests und Broadcasts, welche Orders betreffen: 'blank' = kein Eigengeschäft</p> <p>Bei Requests und Broadcasts, welche Aufgaben oder Geschäfte betreffen: 'blank' = kein Eigengeschäft 'EE' = Eigengeschäft</p> <p>Im Request XONTRO Exchange Trade Reference sind auch die Ausprägungen 'A' = Kundengeschäft und 'P' = Eigengeschäft zulässig.</p>
acctTypCodXontroAsk	char[2]	<p><u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Eigengeschäft Verkauf</p> <p><u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [acctTypCodXontro]</p>
acctTypCodXontroBid	char[2]	<p><u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Eigengeschäft Kauf</p> <p><u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [acctTypCodXontro]</p>
acrIntDay	Snum[4]	<p><u>Erläuterung:</u> Angabe der Zinstage, für welche die Stückzinsberechnung erfolgt</p>
acrIntDayCod	char[2]	<p><u>Wichtiger Hinweis:</u> Dieses Feld wird in XONTRO nicht mehr unterstützt. Bei nicht initialer Belegung wird die Nachricht abgelehnt.</p>
algoFlag	char[1]	<p><u>Erläuterung:</u> Kennzeichen „Algorithmic Order“</p> <p><u>Feldinhalt:</u> 'blank' = keine Algo-Order J = Algo-Order</p>
allotCapQty	num [13,3]	<p><u>Erläuterung:</u> Nominalobergrenze (für zukünftige Verwendung reserviert)</p>
allotType	char [2]	<p><u>Erläuterung:</u> Auslosungsvariante (für zukünftige Verwendung reserviert)</p>
auctRondLotInc	num[3]	<p><u>Erläuterung:</u> Inkrement der Einheitsnotierung</p> <p><u>Feldinhalt:</u> 1 = Vielfaches von [instRondLotMinQty] 2 = Mindestbetrag und danach Vielfaches von [auctRondLotQty]</p>
auctRondLotMinQty	volumeboss num[13,3]	<p><u>Erläuterung:</u> Mindestbetrag bei der Einheitsnotierung; handelbare Nominalen dürfen nicht kleiner als der Mindestbetrag sein; Beträge darüber hinaus folgen den Regeln von [auctRondLotInc] und [auctRondLotQty]</p>

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 252
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
auctRondLotQty	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Kleinste handelbare Einheit bei der Einheitsnotierung; bei [auctRondLotInc] = 1 sind Vielfache vom Mindestbetrag [auctRondLotMinQty] handelbar bei [auctRondLotInc] = 2 gibt dieses Feld an, in welchen Schritten über dem Mindestbetrag [auctRondLotMinQty] gehandelt werden kann.
bcNewPwd	char[8]	<u>Erläuterung:</u> Neues SECU-Passwort bei Passwortänderung
bcOldPwd	char[8]	<u>Erläuterung:</u> Altes SECU-Passwort bei Passwortänderung
bcPwd	char[8]	<u>Erläuterung:</u> SECU-Passwort
bKeyInq	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Schlüssel zum Aufsetzen in einem Bestand <u>Prüfung:</u> Der Wert 0 ist nicht zulässig
bKeyOrdr	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Schlüssel zum Aufsetzen in einem Orderbestand Feldinhalt: Zahl <u>Prüfung:</u> Der Wert 0 ist nicht zulässig
bkrDiaryNo	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Laufende Nummer des Maklertagebuches
bkrNo	num[4]	<u>Erläuterung:</u> KV-Nummer eines Teilnehmers am Systemanschluss Makler. Feldinhalt: 4-stellige Makler KV-Nummer <u>Prüfung:</u> Der Orderempfänger muss Börsenteilnehmer (Makler) am jeweiligen BPL sein.
bkrQuoteVolRemain	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Verbleibendes Quote-Kontingent in der KV-Nummer des Maklers am aktuellen Börsentag.
bkrSubNo	num[2]	<u>Erläuterung:</u> Makler-Sub-Nummer Die Makler-Sub-Nummer ist die Nummer des Mitarbeiters eines Maklers. Sie wird aus den letzten beiden Stellen der Anwenderidentifikation [userNo] gebildet.
bkrUserNo	num[4]	<u>Erläuterung:</u> KV-Nummer des Systemteilnehmers/Maklers, der Sender bzw. Empfänger der Nachrichtendatensätze ist. <u>Prüfung:</u> Der Systemteilnehmer muss Börsenteilnehmer (Makler) am jeweiligen Börsenplatz sein.
bonusDifAmtAsk	Snum[10,2]	<u>Erläuterung:</u> Boni-Differenz auf der Verkaufseite
bonusDifAmtBid	Snum[10,2]	<u>Erläuterung:</u> Boni-Differenz auf der Kaufseite

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 253
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
bonusRat	Snum[6,3]	<u>Erläuterung:</u> Bonifikationssatz (mit Vorzeichen!) In diesem Feld wird bei Neuemissionen die prozentuale Ermäßigung (bzw. Erhöhung) des Kurswertes hinterlegt.
bonusRatAsk	Snum[6,3]	<u>Erläuterung:</u> Bonifikationssatz (mit Vorzeichen!) auf der Verkaufseite
bonusRatBid	Snum[6,3]	<u>Erläuterung:</u> Bonifikationssatz (mit Vorzeichen!) auf der Kaufseite
btradeCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Aufgabenstatus In diesem Feld wird dem Teilnehmer übermittelt, ob es sich um eine endgültige oder eine Zwangsaufgabe handelt. Feldinhalt: E = endgültige Aufgabe V = vorläufige Aufgabe Z = Zwangsaufgabe
btradeCodAsk	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen einer endgültigen Aufgabe auf der Verkaufseite Feldinhalt: 'blank' oder 0 = Keine Aufgabe 1 = Aufgabe 3 = Aufgabenschließung 4 = Aufgabenweitergabe
btradeCodBid	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen einer endgültigen Aufgabe auf der Kaufseite Feldinhalt: siehe Feld [btradeCodAsk]
btradeEnfCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Zwangsaufgabe oder Zwangsschließung Feldinhalt: A = Zwangsaufgabe S = Zwangsschließung * 'blank' = default *nur in CCP-Gattungen am Börsenplatz Frankfurt
btradeNo	num[13]	<u>Erläuterung:</u> Aufgaben-Nummer Die Aufgaben-Nummer wird automatisch durch XONTRO vergeben. Sie ist zusammen mit dem Börsenplatz [tranExchangeld] eindeutig und kann als Identifizierungskennzeichen verwendet werden. Eine vorläufige Aufgabe besitzt eine (XONTRO-interne) Aufgaben-Nummer, bei einer endgültigen Aufgabe ist das Feld mit einer Geschäftsnummer belegt
btradeNoAsk	num[13]	<u>Erläuterung:</u> Aufgaben-Nummer der Verkaufseite
btradeNoBid	num[13]	<u>Erläuterung:</u> Aufgaben-Nummer der Kaufseite
btradeTextAsk	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Information über Schließung einer vorläufigen Aufgabe auf der Verkaufseite. Feld wird nur bei vorläufigen Aufgaben gefüllt. Feldinhalt: TSL = Manuelle Aufgabenschließung ISL = Interne Aufgabenschließung

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 254
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
btradeTextBid	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Information über Schließung einer vorläufigen Aufgabe auf der Kaufseite. Feld wird nur bei vorläufigen Aufgaben gefüllt. Feldinhalt: siehe Feld [btradeTextAsk]
busDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Börsentag
buyCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Geschäftsart der Order/des Geschäfts/der Aufgabe Feldinhalt: K = Kauf V = Verkauf
bypassQuoteVolAct	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Quote Bypass: Aktuell verbrauchtes Kontingent der KV-Nummer
bypassQuoteVolMax	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Quote Bypass: Maximales Kontingent der KV-Nummer
changeQty	Snum[14,3]	<u>Erläuterung:</u> Nominaländerung einer Aufgabenposition (mit Vorzeichen!)
chargesAsk	Snum[12,2]	<u>Erläuterung:</u> Spesen auf der Verkaufseite (inkl. Vorzeichen) Feldinhalt: Spesen in EUR
chargesBid	Snum[12,2]	<u>Erläuterung:</u> Spesen auf der Kaufseite (inkl. Vorzeichen) Feldinhalt: Spesen in EUR
checkExePrcAsk	limitboss num[10,4]	<u>Erläuterung:</u> Bestes Limit auf der Verkaufseite (nach „bestens“)
checkExePrcBid	limitboss num[10,4]	<u>Erläuterung:</u> Bestes Limit auf der Kaufseite (nach „billigst“)
checkExeQtyAsk	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Kumulierte ausführbare Nominale auf der Verkaufseite
checkExeQtyBid	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Kumulierte ausführbare Nominale auf der Kaufseite
clearingCurrTypCod	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Abrechnungswährung (ISO-Bezeichner)
clientCod	char[20]	<u>Erläuterung:</u> Client Identification Code (MiFID II)
clientInd	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Indikator für den Inhalt des Feldes „clientCod“ Feldinhalt: 'blank' = keine Angabe 1 = Shortcode 4 = User-Shortcode (User-Identifikation in Xontro) L = LEI (Legal Entity Identifier) A = AGGR P = PNAL
comAmtAsk	Snum[12,2]	<u>Erläuterung:</u> Provisionsbetrag auf der Verkaufseite (inkl. Vorzeichen) Feldinhalt: Enthält die Provision in EUR, die die orderaufgebende Bank von der Wegen-Bank erhält.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 255
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
comAmtBid	Snum[12,2]	<u>Erläuterung:</u> Provisionsbetrag auf der Kaufseite (inkl. Vorzeichen) <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [comAmtAsk]
comCodAsk	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Provisionskennzeichen auf der Verkaufseite <u>Feldinhalt:</u> 'blank' = keine Provision PD = Provisionsbetrag in EUR PM = Provisionsatz in Promille
comCodBid	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Provisionskennzeichen auf der Kaufseite <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [comCodAsk]
commissionAgentFlag	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen, ob ein Freimakler als Kommissionär handelt. <u>Feldinhalt:</u> 'blank', 'N' = nein 'J' = ja
commissionAgentFlagAsk	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Verkaufseite, ob ein Freimakler als Kommissionär handelt. <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [commissionAgentFlag]
commissionAgentFlagBid	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Kaufseite, ob ein Freimakler als Kommissionär handelt. <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [commissionAgentFlag]
comRateAsk	Snum[6,3]	<u>Erläuterung:</u> Provisionsatz auf der Verkaufseite (inkl. Vorzeichen) <u>Feldinhalt:</u> Enthält den Provisionsatz in Promille.
comRateBid	Snum[6,3]	<u>Erläuterung:</u> Provisionsatz auf der Kaufseite (inkl. Vorzeichen) <u>Feldinhalt:</u> Enthält den Provisionsatz in Promille.
confirmTim	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Zeitstempel, der im Request XONTRO Enter Quote mitzugeben ist. Liefert eine Broadcastnachricht den Wert BC_DO_NOT_CONFIRM, dann ist keine Quittierung erforderlich. Stellt ein Request XONTRO Enter Quote den Wert BC_DO_NOT_CHECK_CONFIRM_TIM ein, dann prüft das BE nicht, ob in dieser ISIN ein Ereignis vorliegt, das eine Quittung verlangt.
confirmTimBypass	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Vom Backend vergebener Zeitstempel, der im Request XONTRO Enter Quote via Bypass im Feld confirmTim mitzugeben ist.
confirmTimCurrent	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Zeitstempel des letzten akzeptierten FE Quotes für eine ISIN

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 256
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
contAuctInd	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen fortlaufende Notierung Das Kennzeichen gibt an, ob ein Wertpapier zur fortlaufenden Notierung zugelassen ist. <u>Feldinhalt:</u> J = variable Notierung N = keine variable Notierung
contAuctRondLotInc	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Inkrement der fortlaufenden Notierung <u>Feldinhalt:</u> 1 = Vielfaches von [contAuctRondLotMinQty] 2 = Mindestbetrag und danach Vielfaches von [contAuctRondLotQty]
contAuctRondLotQty	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Kleinste übertragbare Einheit bei variablen Notierung; bei [contAuctRondLotInc] = 1 sind Vielfache vom Mindestbetrag [contAuctRondLotMinQty] handelbar; bei [contAuctRondLotInc] = 2 gibt dieses Feld an, in welchen Schritten über dem Mindestbetrag [contAuctRondLotMinQty] gehandelt werden kann.
contAuctRondLotMinQty	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Mindestbetrag bei der fortlaufenden Notierung; handelbare Nominalen dürfen nicht kleiner als der Mindestbetrag sein; Beträge darüber hinaus folgen den Regeln von [contAuctRondLotInc] und [contAuctRondLotQty]
counter	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Neutraler Zähler zur beliebigen Verwendung
ctpyExchangeld	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Börsenplatz des Kontrahenten <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [exchangeld]
ctpyLei	char[20]	<u>Erläuterung:</u> LEI (Legal Entity Identifier) des Börsenteilnehmers, der als Kontrahent bei Aufgaben/halben Geschäften/Geschäften benannt wird.
ctpyLeiAsk	char[20]	<u>Erläuterung:</u> LEI des Kontrahenten auf der Verkaufseite
ctpyLeiBid	char[20]	<u>Erläuterung:</u> LEI des Kontrahenten auf der Kaufseite
ctpyNo	num[4]	<u>Erläuterung:</u> KV-Nummer des Börsenteilnehmers, der als Aufgeber der Order benannt wird, bzw. Kontrahent bei Aufgaben/halben Geschäften/Geschäften, bzw. Eingeber bei Request XONTRO Enter MiFID Posttrade Report <u>Prüfung:</u> Die KV-Nummer muss als Börsenteilnehmer (Bank oder Makler) am jeweiligen Börsenplatz eingetragen sein.
ctpyNoAsk	num[4]	<u>Erläuterung:</u> Kontrahent auf der Verkaufseite
ctpyNoBid	num[4]	<u>Erläuterung:</u> Kontrahent auf der Kaufseite
ctpySubNo	num[2]	<u>Erläuterung:</u> Makler-Sub-Nummer des Kontrahenten
ctpyTradMtchPrc	priceboss num[10,4]	<u>Erläuterung:</u> Von einem Kopfkurs abweichender Kurs des jeweiligen Kontrahenten

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind gelb hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 257
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Feldname	Definition	Bemerkung
currExcRat	num[10,5]	<u>Erläuterung:</u> Devisenkurs
currExcRatAsk	num[10,5]	<u>Erläuterung:</u> Devisenkurs auf der Verkaufseite
currExcRatBid	num[10,5]	<u>Erläuterung:</u> Devisenkurs auf der Kaufseite
currTypCod	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Währung der Notierung
currTypCodDep	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Depotwährung eines Wertpapiers/Instruments
custodyTypCod	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Verwahrart entsprechend WM Feld GD400
customerId	char[8]	<u>Erläuterung:</u> Kundenkennung, der Inhalt hängt vom Wert des Feldes [customerIdClass] ab <u>Prüfung (1. Angabe: Inhalt von [customerIdClass], 2. Angabe: Prüfung)</u> B numerisch 8 Stellen D numerisch 8 Stellen F alphanumerisch 8 Stellen K numerisch 4 Stellen M alpha 5 Stellen R alphanumerisch 8 Stellen S alphanumerisch 8 Stellen U alphanumerisch 8 Stellen V alphanumerisch 8 Stellen
customerIdAsk	char[8]	<u>Erläuterung:</u> Kundenkennung Verkaufseite, der Inhalt hängt vom Wert des Feldes [customerIdClass] ab Feldinhalt: siehe Feld [customerId]
customerIdBid	char[8]	<u>Erläuterung:</u> Kundenkennung Kaufseite, der Inhalt hängt vom Wert des Feldes [customerIdClass] ab Feldinhalt: siehe Feld [customerId]
customerIdClass	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen, nach welcher Schlüsselssystematik ein Kunde identifiziert wird Feldinhalt: B Bankleitzahl D DWZ-interne Nummer F Fonds K Kassenvereinsnummer M Member-Id R Depot-Ident Nr. S Depot-Ident Nr. U Kunden-Ident Nr. V Kunden-Ident Nr.
customerIdClassAsk	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen, nach welcher Schlüsselssystematik ein Kunde identifiziert wird (Verkaufseite) Feldinhalt: siehe Feld [customerIdClass]

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 258
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
customerIdClassBid	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen, nach welcher Schlüsselssystematik ein Kunde identifiziert wird (Kaufseite) Feldinhalt: siehe Feld [customerIdClass]
cutoffTim	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Uhrzeit des Annahmeschlusses; siehe WM Feld XD153
deactCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Kursaussetzung Feldinhalt: J = die Gattung (ISIN) ist kursausgesetzt 'blank' = keine Kursaussetzung
deactComment	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Zusatz bei Kursaussetzung für Rentenpapiere Feldinhalt: _Z = gestrichen Ziehung PO = Public Offering (Zeichnungssperre) 'blank' = kein Kurszusatz
deactFromDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum Beginn einer Kursaussetzung
deactText	char[35]	<u>Erläuterung:</u> Freitextfeld bei Kursaussetzung/Rücknahme
deactToDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum Ende einer Kursaussetzung bzw. Rücknahmedatum einer Kursaussetzung
deaFlag	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen für die Übermittlung als „Direct Electronic Access“ (MiFID II) Feldinhalt: 'blank' = kein DEA J = DEA
eccpCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen ECCP-Geschäft Feldinhalt: J = ECCP-Geschäft 'blank' = kein ECCP-Geschäft
endSubscrptDat	Dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum des Zeichnungsendes; siehe WM Feld XD384
enterTim	Timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Eingabezeit Feldinhalt: Manuell vorgegebene Zeit bei Kurseingabe manuell bzw. Kursänderung manuell
emiCod	num[7]	<u>Erläuterung:</u> Emittentennummer
errCod	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Fehlercode. Das Feld wird verwendet, wenn mehrere Fehler in einer Nachricht an eine Applikation zurückgemeldet werden müssen Feldinhalt: Entspricht dem Completion Code
errFieldRef	num[3]	<u>Format 1:</u> Referenznummer des Feldes, bei dessen Überprüfung der erste Fehler festgestellt wurde.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 259
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
		<p>Feldinhalt: Die Feldinhalte werden in 3.4. erläutert.</p> <p>Format 2: Zusätzliche Information für die Subtypes BCBE_START_QUOTE und BCBE_STOP_QUOTE.</p> <p>Feldinhalt: BC_ON_REQUEST (auf Anforderung) BC_VOLUME_OVERFLOW (Makler-Kontingent überschritten) BC_EXCHANGE_VOLUME_OVERFLOW (Börsen-Kontingent überschritten)</p>
exchangeId	num[3]	<p>Erläuterung: Börsenplatz</p> <p>Feldinhalt: 100 = Berlin 120 = Düsseldorf 130 = Frankfurt 140 = Hamburg 150 = Hannover 160 = München 170 = Stuttgart</p>
exchangeIdAsk	num[3]	<p>Erläuterung: Börsenplatz der Verkaufseite</p> <p>Feldinhalt: siehe Feld [exchangeId]</p>
exchangeIdBid	num[3]	<p>Erläuterung: Börsenplatz der Kaufseite</p> <p>Feldinhalt: siehe Feld [exchangeId]</p>
exchangeOrdNum	char[13]	<p>Erläuterung: Von einem externen Börsenhandelssystem vergebene Ordnernummer</p> <p>Feldinhalt: Ordnernummer des MAX-ONE Systems</p>
exchangeQuoteVolRate	num[3]	<p>Erläuterung: Prozentsatz der verbrauchten Quotes vom maximalen Börsen-Kontingent</p> <p>Feldinhalt: Enthält den aktuellen Kontingent-Verbrauch in Prozent</p>
exchangeQuoteVolMax	num[9]	<p>Erläuterung: Maximales Börsen-Kontingent für die Quote-Verarbeitung</p>
execConfType	num[3]	<p>Erläuterung: Art der Auszeichnung</p> <p>Feldinhalt: BC_FV_EXEC_CONF_DISP = dispositive Auszeichnung BC_FV_EXEC_CONF_FINAL = endgültige Auszeichnung</p>
execTranDat	dateboss num[8]	<p>Erläuterung: Datum der Durchführung einer Aktion auf dem Back End.</p>
execTranTim	timeboss num[8]	<p>Erläuterung: Zeitpunkt der Durchführung einer Aktion auf dem Back End.</p>
executionCod	char[20]	<p>Erläuterung: Execution Within Firm (MiFID II)</p>

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 260
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
executionInd	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Indikator für den Inhalt des Feldes "executionCod" <u>Feldinhalt:</u> 1 = Shortcode 2 = Algo 3 = NORE 4 = User-Shortcode (User-Identifikation in Xontro)
fee	Snum[10,2]	<u>Erläuterung:</u> Courtage (mit Vorzeichen!)
feeAsk	Snum[10,2]	<u>Erläuterung:</u> Courtage der Verkaufseite (mit Vorzeichen!)
feeBid	Snum[10,2]	<u>Erläuterung:</u> Courtage der Kaufseite (mit Vorzeichen!)
feeFlag	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Courtagekennzeichen <u>Feldinhalt:</u> FC = Franco Courtage AC = Abweichende Courtage HC = Halbe Courtage FR = Franco alles PC = Prozentcourtage
feeFlagAsk	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Courtagekennzeichen Verkaufseite <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [feeFlag]
feeFlagBid	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Courtagekennzeichen Kaufseite <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [feeFlag]
fwdOrdrCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Bei Einstellung einer Order über das FE wird das Feld ignoriert und die Order immer automatisch an den Skontroführer weitergeleitet. Beim Request XONTRO Enter Order SKM ist nur die Ausprägung 'blank' erlaubt.
fwdOrdrNo	num[13]	<u>Erläuterung:</u> Referenznummer der Ursprungsorder. Im Rahmen der automatischen und manuellen Orderweiterleitung wird auf Basis der Ursprungsorder ein eigenständiger Orderdatensatz durch das System generiert. Dieser Datensatz für die weitergeleitete Order enthält als Referenz in diesem Feld die DWZ-Ordernummer [ordrNo] der Ursprungsorder.
fwdPricingDays	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Anzahl der Tage Forward Pricing entsprechend WM Feld XD151
fwdPricingInd	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Forward Pricing entsprechend WM Feld XD149. <u>Feldinhalt:</u> J = Forward Pricing, wenn Feld instSubSecCod mit entsprechendem WM-Schlüssel gefüllt N = kein Forward Pricing

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 261
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
humNo	num[4]	<u>Erläuterung:</u> Nummer des Kettenglieds in einer HUM-Verkettung <u>Feldinhalt:</u> Beginnend auf der Kaufseite sind die Kettenglieder der Hum-Kette aufsteigend nummeriert. Somit erhält das Kettenglied mit dem Bankkontrahenten auf der Kaufseite den Wert 1. Das Kettenglied mit dem Bankkontrahenten auf der Verkaufseite erhält den Wert n (n = Anzahl der Kettenglieder).
inSeqNo	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Input-Sequence-Number. Dient der eindeutigen Kennzeichnung eines Requests. <u>Prüfung:</u> Die Input-Sequence-Number wird vom BE auf ihre Eindeutigkeit hin überprüft. Die Nummer muss pro KV-Nummer und Stream für einen technischen Verarbeitungsabschnitt (Zeitpunkt des Abschlusses der Tagesendeverarbeitung bis zum gleichen Zeitpunkt des nächsten Tags) eindeutig sein Es wird nicht überprüft, ob die [inSeqNo] in lückenloser Folge eingegeben wurden.
inSeqNoCurrent	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Input-Sequence-Number des letzten verarbeiteten Quote Requests einer ISIN
inSeqNoRef	num[9]	<u>Erläuterung:</u> A. Referenzierung der Input-Sequence-Number des zugehörigen ersten Requests einer Nachrichtenkette. Dient dem Zusammensetzen der Geschäftsnachrichten von MAX-ONE. Referenzierung der FE Requests bei Aufgaben <u>Prüfung:</u> Bei Folge-Requests muss ein erster Request mit der angegebenen inSeqNo vorhanden sein. Der Wert 0 ist nicht zulässig. Bei einem ersten Request ist nur der Wert 0 zulässig. B. Referenzierung des FE Requests bei Aufgabenbroadcasts. <u>Prüfung:</u> Der Wert 0 ist nicht zulässig.
instAlphaCod	char[6]	<u>Erläuterung:</u> Alpha-Wertpapierkennnummer
instCcplnd	char[1]	<u>Erläuterung:</u> ECCP Indikator Der Indikator zeigt an, ob ein Wertpapier/Instrument gegen den ECCP gehandelt werden kann. <u>Feldinhalt:</u> J = ECCP fähig N = nicht ECCP fähig
instGrpCodXontro	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Wertpapiergruppe (gemäß Wertpapiermitteilungen) eines Wertpapiers/Instruments <u>Feldinhalt:</u> (WSS Tabelle TAB-G06, WM Feld GD190)
instGrpCodXontroBums	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Wertpapiergruppe (gemäß Börsenumsatzstatistik) eines Wertpapiers/Instruments <u>Feldinhalt:</u> (WSS Tabelle WSS-T94)

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind gelb hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 262
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Feldname	Definition	Bemerkung
instHistCod	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen historische Notierung <u>Feldinhalt:</u> 1 = Nein 2 = Ja
instLastRedemptDat	dateboss	<u>Erläuterung:</u> Datum des letzten Tilgungstermines (WM-Feld GD910)
instMnem	char[5]	<u>Erläuterung:</u> Börsenkürzel eines Wertpapiers/Instruments
instRondLotInc	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Inkrement Gattungsbezogen <u>Feldinhalt:</u> 1 = Vielfache von [instRondLotMinQty] 2 = Mindestbetrag und danach in Vielfachen von [instRondLotQty]
instRondLotQty	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Kleinste übertragbare Einheit gattungsbezogen; bei [instRondLotInc] = 1 sind Vielfache vom Mindestbetrag [instRondLotMinQty] handelbar; bei [instRondLotInc] = 2 gibt dieses Feld an, in welchen Schritten über dem Mindestbetrag [instRondLotMinQty] gehandelt werden kann.
instRondLotMinQty	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Mindestbetrag gattungsbezogen; Geschäftsnominalen dürfen nicht kleiner als der Mindestbetrag sein; Beträge darüber hinaus folgen den Regeln von [instRondLotInc] und [instRondLotQty]
instSecCod	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Name des Marktsegmentes eines Wertpapiers/Instruments <u>Feldinhalt:</u> (WSS Tabelle TAB-F38)
instShtNam	char[25]	<u>Erläuterung:</u> Name eines Wertpapiers/Instruments
instStpTradDat	num[8]	<u>Erläuterung:</u> Letzter Handelstag
instStrtTradDat	num[8]	<u>Erläuterung:</u> Tag der Erstnotierung
instSubSecCod	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Submarktsegment <u>Feldinhalt:</u> (WSS Tabelle TAB-X03, WM Feld XD080)
instTypCodXontro	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Wertpapierart (gemäß Wertpapiermitteilungen) eines Wertpapiers/Instruments <u>Feldinhalt:</u> (WSS Tabelle TAB-G51, WM Feld GD195)
instXontroOrdDat	num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum der Zulassung eines Wertpapiers/Instruments für den Handel in Xontro Order
instXontroStrtTradDat	num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum der Notierungsaufnahme eines Wertpapiers/Instruments in Xontro Order
investmentCod	char[20]	<u>Erläuterung:</u> Investment Decision Within Firm (MiFID II)
investmentInd	char[1]	<u>Erläuterung:</u>

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 263
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Feldname	Definition	Bemerkung
		Indikator für den Inhalt des Feldes „investmentCod“ Feldinhalt: 'blank' = keine Angabe 1 = Shortcode 2 = Algo 4 = User-Shortcode (User-Identifikation in Xontro)
isinCod	char[12]	Erläuterung: ISIN (Internationale Wertpapierkennnummer) der Gattung Prüfung: Die Gattung muss zum Handel in einem Marktsegment des jeweiligen Börsenplatzes zugelassen sein.
isinCodNew	char[12]	Erläuterung: Neue ISIN (Internationale Wertpapierkennnummer). Bestehende Orders für die Gattung der ISIN "isinCod" sind auf diese ISIN zu übertragen Prüfung: Die Gattung muss zum Handel in einem Marktsegment des jeweiligen Börsenplatzes zugelassen sein
isinCodSrs	char[12]	Erläuterung: ISIN der Serien-Gattung
iwOrdCod	char[2]	Erläuterung: Kennzeichen interessewahrendes Geschäft Feldinhalt: IW = interessewahrendes Geschäft
iwOrdCodAsk	char[2]	Erläuterung: Kennzeichen interessewahrendes Geschäft Verkaufseite Feldinhalt: siehe Feld [iwOrdCod]
iwOrdCodBid	char[2]	Erläuterung: Kennzeichen interessewahrendes Geschäft Kaufseite Feldinhalt: siehe Feld [iwOrdCod]
killFlag	char[1]	Erläuterung: Kennzeichnung einer Orderlöschung durch „Kill“-Funktionalität. Eine so gekennzeichnete Löschung wird bei Auswertungen für RTS 9 (MiFID II) nicht gezählt. Feldinhalt: 'blank' = normale Löschung J = Löschung durch „Kill“-Funktionalität
liquidityProvFlag	char[1]	Erläuterung: Kennzeichnung einer Order mit der Liquidität bereitgestellt wird (MiFID II) Feldinhalt: 'blank' = keine Bereitstellung von Liquidität J = Bereitstellung von Liquidität
lockFlag	char[1]	Erläuterung: Kennzeichen Eingang während Sperre Feldinhalt: 'blank' = Default J = Status „während Sperre“
lockTim	timeboss num[8]	Erläuterung: Zeitstempel Sperre (Zeitpunkt des Setzens der Orderbuchsperr)

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 264
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung																																																
matchFlag	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen keine automatische Aufgabenschließung In diesem Kennzeichen wird hinterlegt, ob eine Aufgabenposition von der automatischen Schließung ausgenommen werden soll. <u>Feldinhalt:</u> AO = Aufgabe nicht automatisch schließbar																																																
matchFlagAsk	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen keine automatische Aufgabenschließung Verkaufseite In diesem Kennzeichen wird hinterlegt, ob eine Aufgabenposition von der automatischen Schließung ausgenommen werden soll. <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [matchFlag]																																																
matchFlagBid	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen keine automatische Aufgabenschließung Kaufseite In diesem Kennzeichen wird hinterlegt, ob eine Aufgabenposition von der automatischen Schließung ausgenommen werden soll. <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [matchFlag]																																																
maxNoPrc	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Maximale Anzahl Kurse in einer Blocknachricht <u>Prüfung:</u> Der Wert 0 ist nicht zulässig																																																
midAuctInd	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Einheitsnotierung (Kassakursfeststellung) Das Kennzeichen gibt an, ob ein Wertpapier zur Einheitsnotierung zugelassen ist und somit ein Kassakurs festgestellt werden kann. <u>Feldinhalt:</u> J = Einheitsnotierung N = keine Einheitsnotierung																																																
netTypCodXontro	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Netting Kennzeichen Xontro (für zukünftige Verwendung reserviert)																																																
nrCod	char[4]	<u>Erläuterung:</u> Nebenrechtsschlüssel <u>Feldinhalt:</u> <u>Nebenrechte aus Maklereingaben (Broadcast)</u> <table border="0"> <tr> <td>AUSG</td> <td>Kursaussetzung</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>_Z</td> <td>Kursaussetzung gestrichen Ziehung</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>POLO</td> <td>Public Offering Lock (Zeichnungssperre)</td> <td>keine Aktion</td> </tr> <tr> <td>POUL</td> <td>Public Offering Unlock (Rückn. Zeichnungssp.)</td> <td>keine Aktion</td> </tr> <tr> <td>EREO</td> <td>ex Redenominierung wegen Euro</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>EXAR</td> <td>ex Ausschüttung bei Renten</td> <td>keine Aktion</td> </tr> <tr> <td>EXBR</td> <td>ex Bezugsrecht</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>EXBA</td> <td>ex Berichtigungsaktien</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>EXAG</td> <td>ex Ausschüttung –Genussscheine-</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>EXDI</td> <td>ex Dividende -Inlandsaktien-</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>EXDA</td> <td>ex Dividende -Auslandsaktien-</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>EXZS</td> <td>ex Zinsen -Anleihen-</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>EXAZ</td> <td>ex Ausgleichszahlung -Aktien-</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>EXBO</td> <td>ex Bonusrecht -Aktien-</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> <tr> <td>H</td> <td>Hinweis</td> <td>keine Aktion</td> </tr> <tr> <td>HL</td> <td>Hinweis Löschung</td> <td>Orderlöschung</td> </tr> </table>	AUSG	Kursaussetzung	Orderlöschung	_Z	Kursaussetzung gestrichen Ziehung	Orderlöschung	POLO	Public Offering Lock (Zeichnungssperre)	keine Aktion	POUL	Public Offering Unlock (Rückn. Zeichnungssp.)	keine Aktion	EREO	ex Redenominierung wegen Euro	Orderlöschung	EXAR	ex Ausschüttung bei Renten	keine Aktion	EXBR	ex Bezugsrecht	Orderlöschung	EXBA	ex Berichtigungsaktien	Orderlöschung	EXAG	ex Ausschüttung –Genussscheine-	Orderlöschung	EXDI	ex Dividende -Inlandsaktien-	Orderlöschung	EXDA	ex Dividende -Auslandsaktien-	Orderlöschung	EXZS	ex Zinsen -Anleihen-	Orderlöschung	EXAZ	ex Ausgleichszahlung -Aktien-	Orderlöschung	EXBO	ex Bonusrecht -Aktien-	Orderlöschung	H	Hinweis	keine Aktion	HL	Hinweis Löschung	Orderlöschung
AUSG	Kursaussetzung	Orderlöschung																																																
_Z	Kursaussetzung gestrichen Ziehung	Orderlöschung																																																
POLO	Public Offering Lock (Zeichnungssperre)	keine Aktion																																																
POUL	Public Offering Unlock (Rückn. Zeichnungssp.)	keine Aktion																																																
EREO	ex Redenominierung wegen Euro	Orderlöschung																																																
EXAR	ex Ausschüttung bei Renten	keine Aktion																																																
EXBR	ex Bezugsrecht	Orderlöschung																																																
EXBA	ex Berichtigungsaktien	Orderlöschung																																																
EXAG	ex Ausschüttung –Genussscheine-	Orderlöschung																																																
EXDI	ex Dividende -Inlandsaktien-	Orderlöschung																																																
EXDA	ex Dividende -Auslandsaktien-	Orderlöschung																																																
EXZS	ex Zinsen -Anleihen-	Orderlöschung																																																
EXAZ	ex Ausgleichszahlung -Aktien-	Orderlöschung																																																
EXBO	ex Bonusrecht -Aktien-	Orderlöschung																																																
H	Hinweis	keine Aktion																																																
HL	Hinweis Löschung	Orderlöschung																																																

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 265
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
		HA Hinweis Abschlag Limitabschlag
		EABC ex verschiedene Rechte Orderlöschung
		EXSP Teilung (Split) Orderlöschung
		WKNA Wertpapierkennnummeränderung WKN-Änderung
		ENOT Einstellen der Notierung Orderlöschung
		<u>Nebenrechte aus Stammdatenveränderungen (Broadcast)</u>
		LHBR Ende des Bezugsrechtshandels limitierter Orders Orderlöschung
		SBSL Änderung Kennzeichen SB-/SL-Order Orderlöschung
		MSEG Für XONTRO ungültiges Marktsegment Orderlöschung
		MBKS Änderung Kennzeichen Einheitsnotierung, kleinste handelbare Einheit, Mindestbetrag, Inkrement Mindestbetrag Einheitskurs oder Inkrement auf Gattungsebene Orderlöschung bzw. Orderänderung
		MBVA Änderung Kennzeichen variabler Handel, kleinste handelbare Einheit, Mindestbetrag oder Inkrement Mindestbetrag variabler Handel Orderlöschung bzw. Orderänderung
		KSVA Wechsel von Einheitsnotierung in variablen Handel ohne Einheitsnotierung Orderlöschung bzw. Orderänderung
		KSKH Wechsel von Einheitsnotierung in kein Handel Orderlöschung
		VAKS Wechsel von variablen Handel ohne Einheitsnotierung in Einheitsnotierung Orderlöschung bzw. Orderänderung
		VAKH Wechsel von variablen Handel ohne Einheitsnotierung in kein Handel Orderlöschung
		VKKS Wechsel von variablen Handel mit Einheitsnotierung in Einheitsnotierung Orderlöschung bzw. Orderänderung
		VKVA Wechsel von variablen Handel mit Einheitsnotierung in variablen Handel ohne Einheitsnotierung Orderlöschung bzw. Orderänderung
		VKKH Wechsel von variablen Handel mit Einheitsnotierung in kein Handel Orderlöschung
		<u>Nebenrechte aus Maklereingaben (Request)</u>
		EXBR ex Bezugsrecht Orderlöschung
		EXBA ex Berichtigungsaktien Orderlöschung
		EXAG ex Ausschüttung –Genussscheine- Orderlöschung
		EXAR ex Ausschüttung bei Rentenwerten keine Aktion
		EXDI ex Dividende –Inlandsaktien– Orderlöschung
		EXDA ex Dividende –Auslandsaktien– Orderlöschung
		EXZS ex Zinsen –Anleihen– Orderlöschung
		EXAZ ex Ausgleichszahlung –Aktien– Orderlöschung
		EXBO ex Bonusrecht –Aktien– Orderlöschung
		H Hinweis keine Aktion
		HL Hinweis Löschung Orderlöschung
		HA Hinweis Abschlag Limitabschlag

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 266
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
		EABC ex verschiedene Rechte EXSP Teilung (Split) WKNA Wertpapierkennnummeränderung Orderlöschung Orderlöschung WKN-Änderung
nrDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Stichtag des Nebenrechts
occurrence	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Nummer der Wiederholgruppe <u>Feldinhalt:</u> 0 (keine Wiederholgruppe), 1,2,...
onBehalfCtpyNoAsk	num[4]	<u>Erläuterung:</u> Kontrahent des Wegen-Geschäftes auf der Verkaufseite <u>Feldinhalt:</u> KV-Nummer der Wegen-Bank. Xontro Trade erzeugt ein Bankdirektgeschäft zwischen der orderaufgebenden Bank [ctpyNoAsk] und der Wegen-Bank [onBehalfCtpyNoAsk]
onBehalfCtpyNoBid	num[4]	<u>Erläuterung:</u> Kontrahent des Wegen-Geschäftes auf der Kaufseite <u>Feldinhalt:</u> KV-Nummer der Wegen-Bank. Xontro Trade erzeugt ein Bankdirektgeschäft zwischen der orderaufgebenden Bank [ctpyNoBid] und der Wegen-Bank [onBehalfCtpyNoBid]
optOutFlag	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen für die Prüfung auf den maximal zulässigen Kurswert des jeweiligen Börsenplatzes <u>Feldinhalt:</u> 'blank' = Kurswertprüfung (default) N = keine Kurswertprüfung
ordrBegDatCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Beginn der Ordergültigkeit Folgetagorders wegen Annahmeschluss sind frühestens am nächsten Börsentag gültig, können aber auch erst zu einem noch späteren Börsentag gültig werden. Alle anderen Folgetagorders sind immer ab dem nächsten Börsentag gültig. EG-Orders sind ab Aktivierung durch den QLP gültig. Zeichnungsaufträge (Orders während Zeichnungsfrist) sind sofort gültig. <u>Feldinhalt:</u> 'blank' = Order ist sofort gültig K = Folgetagorder (automatisch erzeugt) B = Folgetagorder (manuell durch KI eingegeben) E = EG-Order (Ereignis-Gesteuerte-Order) Z = Order während Zeichnungsfrist Die folgenden Feldinhalte sind ausschließlich bei Gattungen mit Marktsegment „Fondssegment Hannover“ (DE6) relevant: H = Keine Folgetagorder, aber maschinelle Anpassung der Gültigkeit-Bis X = Folgetagorder (manuell durch KI eingegeben) und maschinelle Anpassung der Gültigkeit-Bis Y = Folgetagorder (automatisch erzeugt) und maschinelle Anpassung der Gültigkeit-Bis O = Folgetagorder wegen Annahmeschluss
ordrBkExeQty	Snum[16,3]	<u>Erläuterung:</u>

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 267
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
		Umsatz der Kursfeststellung: Es wird der berechnete oder die durch den Makler noch vorgenommene Korrektur des berechneten Werts übermittelt.
ordrEntNo	num[4]	<u>Erläuterung:</u> KV-Nummer des Ordereingebers <u>Prüfung:</u> Der Ordereingebener muss Börsenteilnehmer (Bank oder Makler) am jeweiligen Börsenplatz sein.
ordrExePrc	limitboss num[10,4]	<u>Erläuterung:</u> Limit der Order Feldinhalt: Bei der Übergabe des initialisierten Feldes, werden Kauforders mit Limit <i>billigst</i> und Verkauforders mit Limit <i>bestens</i> eingestellt. <u>Prüfung:</u> Billigst/bestens ist bei SB/SL-Orders nicht möglich. Hinsichtlich der Limitsprünge siehe XONTRO-Handbuch, Anhang C, Tick-Sizes
ordrExePrcAsk	limitboss num[10,4]	<u>Erläuterung:</u> Preis eines Quote (Taxe/Spanne); Verkaufseite
ordrExePrcBid	limitboss num[10,4]	<u>Erläuterung:</u> Preis eines Quote (Taxe/Spanne); Kaufseite
ordrExePrcMod	Snum[11,4]	<u>Erläuterung:</u> Limitabschlag, Limitaufschlag, Kursabschlag oder Kursaufschlag
ordrExpDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum der Gültigkeit (bis) einer Order. Bis zu diesem Datum kann die Order maximal gehandelt werden. Feldinhalt: Das Datum muss größer oder gleich dem aktuellen Börsentag sein. Das System akzeptiert auch Orders, die über den 31.12. hinaus gültig sind. Sollten solche Orders an diesem Stichtage noch ausführbar sein, so erfolgt entsprechend den Geschäftsbedingungen der jeweiligen Börsen die automatische Löschung.
ordrNo	num[13]	<u>Erläuterung:</u> DWZ-Ordernummer. Die DWZ-Ordernummer wird automatisch durch XONTRO bei der Ordereinstellung vergeben. Die DWZ-Ordernummer ist eindeutig und kann als Identifizierungskennzeichen verwendet werden.
ordrQty	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> A. Bei orderrelevanten Requests, Broadcasts und Beständen Nominale, Stückzahl der Order B. Bei aufgabenrelevanten Broadcasts und Beständen Ursprüngliche Nominale der Aufgabe
ordrQtyAsk	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Nominale oder Stückzahl eines Quote (Taxe/Spanne); Verkaufseite
ordrQtyBid	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Nominale oder Stückzahl eines Quote (Taxe/Spanne); Kaufseite
ordrResCod	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Limitzusatz der Order Feldinhalt: SL = stop loss SB = stop buy EG = EG-Order (Ereignis-Gesteuerte-Order) <u>Prüfung:</u> Die Eingabe ist nur möglich bei entsprechend zugelassenen Gattungen.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 268
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
		Weiterhin wird bei der Eingabe die Angabe der Geschäftsart (V bei SL und K bei SB) und die Vergabe eines Limits [ordrExePrc] überprüft.
ordrResCodInd	char[1]	<p><u>Erläuterung:</u> Limitzusatzindikator Indikator für die Eingebbarkeit von SL/SB-Orders eines Wertpapiers/Instruments in Xontro Order</p> <p><u>Feldinhalt:</u> J = SL/SB Order sind zugelassen N = SL/SB Order sind nicht zugelassen</p>
ordrStatCod	char[1]	<p><u>Erläuterung:</u> Kennzeichen für die Statusänderung einer EG-Order (Ereignis-Gesteuerte-Order).</p> <p><u>Feldinhalt bei Request:</u> XONTRO Delete Order SKM [0-9; A-T] = EG-Order abgelehnt; Regelprüfung nicht erfolgreich</p> <p>XONTRO Modify Order SKM X = Zurücksetzen einer aktivierten EG-Order Y = EG-Order akzeptiert; Regelprüfung erfolgreich Z = Aktivierung der EG-Order</p> <p><u>Feldinhalt bei Broadcast:</u> BCBE_DELETE_ORDER BCBE_DELETE_ORDER_SKM [0-9; A-T] = EG-Order abgelehnt; Regelprüfung nicht erfolgreich</p> <p>BCBE_MODIFY_ORDER BCBE_MODIFY_ORDER_SKM Y = EG-Order akzeptiert; Regelprüfung erfolgreich Z = Aktivierung der EG-Order</p> <p><u>Feldausprägungen:</u> 0 = Nicht definierter EG-Order Regelfehler 1 = Instruktion der EG-Order kann nicht interpretiert werden 2 = Ungültiger Trailing Abstand 3 = EG-Ordertyp ungültig 4 = Ungültiges Stop-Limit 5 = Wert nach dem Komma entspricht nicht der Regel 6 = Anzahl der Stellen nach dem Komma ist zu hoch 7 = Anzahl der Stellen vor dem Komma ist zu hoch 8 = Limit ungültig 9 = Feld muss numerisch sein A = Feld muss gültigen Schlüsselwert enthalten Y = EG-Order akzeptiert; Regelprüfung erfolgreich Z = Aktivierung der EG-Order</p>
ordrStopLim	limitboss num[10,4]	<p><u>Wichtiger Hinweis:</u> Dieses Feld wird derzeit noch nicht von XONTRO unterstützt. Eine Prüfung der Feldinhalte erfolgt derzeit noch nicht.</p> <p><u>Erläuterung:</u> Stop-Limit der Order</p> <p><u>Prüfung:</u> Die Eingabe ist nur zulässig bei entsprechend definierten Gattungen. Die Eingabe ist nur in Verbindung mit der Eingabe eines Limitzusatzes [ordrResCod] zulässig. Weiterhin wird bei der Eingabe die Angabe der Geschäftsart (V bei SL und K bei SB) und die Vergabe eines Limits [ordrExePrc] überprüft.</p>

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 269
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
ordrVolAsk	num[10]	<u>Wichtiger Hinweis:</u> Dieses Feld wird derzeit noch nicht von XONTRO unterstützt <u>Erläuterung:</u> Volumen (Kurswert) eines Quote (Taxe/Spanne); Verkaufseite. Die Angabe des Volumens erfolgt in Euro.
ordrVolBid	num[10]	<u>Wichtiger Hinweis:</u> Dieses Feld wird derzeit noch nicht von XONTRO unterstützt <u>Erläuterung:</u> Volumen (Kurswert) eines Quote (Taxe/Spanne); Kaufseite Die Angabe des Volumens erfolgt in Euro.
origOrdrQty	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Ursprüngliche Nominale, Stückzahl der Order
otcPostTradInd	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen „OTC-post-trade Indicator“ (MiFID II) <u>Feldinhalt:</u> 'blank' = keine Angabe 001 = ACTX (Kompensation) 002 = CANC (Storno) 101 = ACTX CANC (Kompensation und Storno)
otcPostTradIndAsk	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen „OTC post-trade Indicator“ (MiFID II) auf der Verkaufseite
otcPostTradIndBid	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen „OTC post-trade Indicator“ (MiFID II) auf der Kaufseite
outSeqNo	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Die Output-Sequence-Number wird eindeutig und lückenlos aufsteigend vergeben. Die Nummer ist vom Zeitpunkt des Abschluss der Tagesendeverarbeitung bis zum gleichen Zeitpunkt des nächsten Tags pro KV-Nummer und Stream eindeutig.
pendFlag	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen Orderänderung/Löschung vorläufig <u>Feldinhalt:</u> 'blank' = Status endgültig (Default) J = Status vorläufig
possLockFlag	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen, ob das Orderbuch gesperrt werden soll, wenn die im Request gelieferten Prüffelder nicht mit der Orderlage am Back End übereinstimmen <u>Feldinhalt:</u> 'blank' = Orderbuch wird nicht gesperrt (Default) J = Orderbuch wird gesperrt
postProcFlag	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen automatische Nachbearbeitung bei Kurseingabe Front End <u>Feldinhalt bei Request:</u> A = automatische Nachbearbeitung durch das Xontro Back End E = explizite Nachbearbeitung durch den Makler am Front End; der Request Xontro Finish Pricing ist zum Abschluss der Nachbearbeitung zwingend erforderlich <u>Feldinhalt bei Broadcast:</u> A = die Nachbearbeitung wird für diesen Kurs automatisch durch das Xontro Back End abgeschlossen E = für diesen Kurs ist eine explizite Nachbearbeitung erforderlich

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 270
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
processingCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen, ob beim Request XONTRO Reactivate Pricing Block zusätzlich zur Rücknahme der Kursaussetzung auch ein umsatzloser Kurs oder sowohl ein umsatzloser Kurs als auch eine erneute Kursaussetzung mitgeschickt wurde. <u>Feldinhalt:</u> 'blank' = Rücknahme der Kursaussetzung (Default) 1 = Rücknahme, umsatzloser Kurs sowie erneute Kursaussetzung 2 = Rücknahme der Kursaussetzung und umsatzloser Kurs
pwExpirationDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Letzter Gültigkeitstag des Passworts der [userNo]
qsamId	num[4]	<u>Erläuterung:</u> Server Identifikation (z.B. 0200 und 0201) Die Nummer wird von BrainTrade für jeden QSAM-Teilnehmer vergeben.
qsamMsgType	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Typ einer Nachricht <u>Feldinhalt:</u> Q = Request R = Response B = Broadcast I = Bestandstransfer (Initialbestand) T = Retransmission
qsamRequestId	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Request Identifikation <u>Feldinhalt:</u> siehe Header-File („bclayouts_qsam.h“)
qsamExchangeld	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Börsenplatz der Nachricht <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [exchangeld]
qsamUserId	num[10] [nnnnxxxxxx]	<u>Erläuterung:</u> Identifizierungskennzeichen (Login-User) <u>Feldinhalt:</u> nnnn = KV-Nummer des Eingebers xxxxxx = Individuelle Mitarbeiterkennung des Eingebers
qsamComplCode	num[5]	<u>Erläuterung:</u> Completion Code (Fehlercode) <u>Feldinhalt:</u> siehe Header-File („XONTROmsg_qsam.dat“)
qsamDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Aktueller Börsentag
qsamBkrNo	num[4]	<u>Erläuterung:</u> KV-Nummer des Systemteilnehmers/Maklers, der Empfänger des Nachrichtendatensatzes ist.
qsamStreamId	num[2]	<u>Erläuterung:</u> Stream Identifikation <u>Feldinhalt:</u> siehe Header-File („bclayouts_qsam.h“)

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 271
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
quoteReturnCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Returncode für eine ISIN die über den Request XONTRO Enter Mass Quote übermittelt wurde. <u>Feldinhalt:</u> Y = Quote wurde erfolgreich verarbeitet F = ConfirmTim nicht korrekt V = Kontingentüberschreitung L = Keine Berechtigung oder noch kein Login erfolgt S = Sequenz-Nummer nicht aufsteigend X = Syntax-Fehler
quoteSeqNo	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Numerisch aufsteigende Sequenz-Nummer (pro ISIN) für den Request XONTRO Enter Mass Quote
quoteStatus	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Status eines Quote (Taxe/Spanne). In diesem Feld wird übermittelt, ob der Quote durch den Teilnehmer über die System- bzw. Dialogschnittstelle gelöscht werden kann. <u>Feldinhalt:</u> L = löschar N = nicht löschar
quoteTimeStamp	num[12] [HHMMSSCCnnnn]	<u>Erläuterung:</u> Zeitstempel der Einstellung bzw. Löschung einer Quote
quoteType	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Typ eines Quote (Taxe/Spanne). In diesem Feld wird übermittelt, ob es sich bei einem Quote um eine Taxe oder eine Spanne handelt. <u>Feldinhalt:</u> T = Taxe S = Spanne
redQty	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Reduktionsvolumen (Stückzahl/Nominale) einer Aufgabenpositionen bei der Schließung
refTim	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Referenzzeit
regulatoryID	num [10]	<u>Erläuterung:</u> Wird nicht mehr verwendet Dieses Feld enthält bei Broadcasts immer den Initalwert.
repExchangeld	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Börsenplatz Meldewesen <u>Feldinhalt:</u> Zurzeit nur: 124 (Quotrix) Ist der Defaultwert eingetragen (000), wird die [exchangeld] als Börsenplatz Meldewesen verwendet
repExchangeldAsk	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Börsenplatz Meldewesen Verkauf <u>Feldinhalt:</u> Zurzeit nur: 124 (Quotrix) Ist der Defaultwert eingetragen (000), wird die [exchangeld] als Börsenplatz Meldewesen verwendet

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 273
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
----------	------------	-----------

		BCBE_DELETE_ORDER BCBE_DELETE_ORDER_N BCBE_ENTER_ORDER	Orderlöschung (BE) Orderlöschung wegen Nebenrecht Ordereinstellung Skontroführer (BE)
		BCBE_ENTER_ORDER_FM BCBE_ENTER_PRICE BCBE_ENTER_PRICE_MAN BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_MAN BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_TAB	Ordereinstellung Freimakler (BE) Kursfeststellung (BE) Kurseingabe manuell Kursänderung manuell Kursfeststellung
		BCBE_ENTER_PRICE_TAB BCBE_ENTER_QUOTE BCBE_ADD_POSITION	Kursfeststellung Eingabe eines Quote (BE) Eingabe eines halben Geschäftes (BE)
		BCBE_MODIFY_EXECUTION BCBE_FINISH_PRICING BCBE_LOCK_ORDERS BCBE_MODIFY_ORDER BCBE_MODIFY_ORDER_N BCBE_MODIFY_SBSL BCBE_PEND_DELETE_ORDER BCBE_PEND_ENTER_ORDER	Teilausführung einer Order (BE) Ende Nachbearbeitung (Back End) Sperrern (BE) Orderänderung (BE) Orderänderung wegen Nebenrecht Umsetzung einer Stop-Order vorläufige Orderlöschung (BE) Ordereinstellung während Sperre (BE)
		BCBE_PEND_MODIFY_ORDER BCBE_REJ_ENTER_ORDER	vorläufige Orderänderung (BE) Ablehnung Ordereinstellung während Sperre (BE)
		BCBE_UNLOCK_ORDERS BCFE_DEACTIVATE_QUOTE BCFE_DELETE_ORDER	Entsperrern (BE) Deaktivierung/Löschung eines Quote (FE) erfolgreiche Orderlöschung nach Sperre
		BCFE_DELETE_ORDER_DIR BCFE_DELETE_ORDER_SKM BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE BCFE_ENTER_ORDER	direkte Orderlöschung(FE) Orderlöschung Skontroführer (FE) umsatzlose Kurseingabe (FE) erfolgreiche Ordereinstellung nach Sperre
		BCFE_ENTER_ORDER_DIR BCFE_ENTER_ORDER_SKM	direkte Ordereinstellung (FE) Ordereinstellung Skontroführer (FE)
		BCFE_ENTER_PRICE BCFE_ENTER_QUOTE BCFE_ADD_POSITION	Kursfeststellung (FE) Eingabe eines Quote (FE) Eingabe eines halben Geschäftes (FE)
		BCFE_MODIFY_EXECUTION BCFE_FINISH_PRICING BCFE_LOCK_ORDERS BCFE_MODIFY_ORDER	Teilausführung einer Order (FE) Ende Nachbearbeitung (FE) Sperrern (FE) erfolgreiche Orderänderung nach Sperre
		BCFE_MODIFY_ORDER_DIR BCFE_MODIFY_ORDER_SKM BCFE_REJ_DELETE_ORDER BCFE_REJ_ENTER_ORDER BCFE_REJ_MODIFY_ORDER	direkte Orderänderung (FE) Orderänderung Skontroführer (FE) abgelehnte Orderlöschung (FE) abgelehnte Ordereinstellung (FE) abgelehnte Orderänderung (FE)

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 274
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
----------	------------	-----------

		BCFE_UNLOCK_ORDERS Entsperrn (FE)
		<u>D) XONTRO Subscribe Quote Updates (MISS2MISS)</u>
		BCFE_ENTER_QUOTE Eingabe eines Quote (FE)
		BCFE_DEACTIVATE_QUOTE Deaktivierung/Löschung eines Quote (FE)
		<u>E) XONTRO Subscribe Execution Confirmation Updates</u>
		BCBE_EXECUTION_SKM Orderauszeichnung durch den Skontrofürher, Nachricht für den Skontrofürher
		BCBE_END_EXECUTION Abschluss Ausführungen, Nachricht für den Skontrofürher
		BCBE_EXECUTION_SKM_TO_FM Orderauszeichnung durch den Skontrofürher, Nachricht für den Freimakler
		<u>F) XONTRO Inquire Broker Trades</u>
		BCBE_BTRADE Übertragung einer Aufgabe
		BCBE_BTRADE_2 Übertragung einer Aufgabe
		BCBE_BTRADES_END Ende Übertragung Aufgaben
		<u>G) XONTRO Subscribe Broker Trade Updates</u>
		BCBE_ENTER_TEMP_BTRADE Erzeugung einer neuen temporären Aufgabe (Seitenüberhang)
		BCBE_MODIFY_TEMP_BTRADE Änderung einer temporären Aufgabe
		BCBE_DELETE_TEMP_BTRADE Löschung einer temporären Aufgabe
		BCBE_ENTER_BTRADE Erzeugung einer Aufgabe (BE)
		BCBE_ENTER_BTRADE_2 Erzeugung einer Aufgabe (BE)
		BCFE_ENTER_BTRADE Erzeugung einer Aufgabe (FE)
		BCFE_ENTER_BTRADE_2 Erzeugung einer Aufgabe (FE)
		BCBE_DELETE_BTRADE Löschung einer Aufgabe (BE)
		BCBE_CANCEL_BTRADE Stornierung einer Aufgabe (BE)
		BCFE_DELETE_BTRADE Löschung einer Aufgabe (FE)
		BCFE_CANCEL_BTRADE Stornierung einer Aufgabe (FE)
		BCBE_MATCH_BTRADE Schließung von Aufgaben (BE)
		BCFE_MATCH_BTRADE Schließung von Aufgaben (FE)
		BCBE_MODIFY_BTRADE Änderung einer Aufgabe (BE)
		BCBE_MODIFY_HUM Änderung einer HUM-Position (BE)
		BCFE_MODIFY_HUM Änderung einer HUM-Position (FE)
		<u>H) XONTRO Subscribe Trade Updates</u>
		BCBE_TRADE Erzeugung eines Eigengeschäfts
		BCBE_BROKER_DIARY Erzeugung eines Geschäftsvorfalles im Maklertagebuch

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 275
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
		<u>I) XONTRO Inquire Broker Diary</u> BCBE_DIARY Übertragung eines MTB-Eintrags BCBE_DIARY_END Ende Übertragung eines MTB-Eintrags <u>J) XONTRO Inquire Special Rights</u> BCBE_BT Übertragung einer Bestandsnachricht BCBE_BT_END Ende der Übertragung des Bestandes <u>K) XONTRO Subscribe System Status News</u> BCBE_BUS_END Ende Buchungsschnitt BCBE_BUS_START Start Buchungsschnitt BCBE_DEACTIVATE_ANY_PRICING Unterbrechung der Kursfeststellung BCBE_DEACTIVATE_PRICING Wiederaufnahme nach Kursaussetzung BCBE_ENDOFDAY_START Start Tagesendeverarbeitung BCBE_ENTER_SP_RIGHT Eingabe eines Nebenrechts BCBE_REACTIVATE_ANY_PRICING Wiederaufnahme nach Unterbrechung der Kursfeststellung BCBE_REACTIVATE_PRICING Wiederaufnahme nach Kursaussetzung BCBE_START_TRADE Wiederaufnahme Börsenversammlung BCBE_STOP_TRADE Unterbrechung Börsenversammlung BCFE_DEACTIVATE_PRICING Kursaussetzung (FE) BCFE_DEACTIVATE_PRICING_BLOCK Kursaussetzung (FE) geblockt BCFE_ENTER_SP_RIGHT Eingabe eines Nebenrechts am Front End BCFE_REACTIVATE_PRICING Wiederaufnahme n. Kursaussetzung (FE) BCFE_REACTIVATE_PRICING_BLOCK Wiederaufnahme n. Kursaussetzung (FE) geblockt <u>L) XONTRO Subscribe Private Status News</u> BCBE_START_QUOTE Starten Quote Machine BCBE_STOP_QUOTE Stoppen Quote Machine BCBE_EXCHANGE_QUOTE_VOLUME_INFO Status-Information über den Quote-Verbrauch vom Börsen-Kontingent BCBE_BYPASS_QUOTE_VOLUME_INFO Status-Information über den Quote-Verbrauch vom Bypass-Kontingent

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 276
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
		BCBE_NOTIFY_PW_EXPIRATION_DATE Übermittlung der Restgültigkeit eines Passworts BCBE_LOST_MESSAGE nicht zugestellte Nachricht BCFE_RESET_PRICE Annullierung Preis BCFE_RESET_ORDER_SKM Von einer Annullierung betroffene Order des Skontroführers BCFE_RESET_ORDER_SKM_END Von einer Annullierung betroffene Order des Skontroführers BCFE_RESET_ORDER_FM Von einer Annullierung betroffene Order des Freimaklers BCFE_RESET_ORDER_FM_END Von einer Annullierung betroffene Order des Freimaklers <u>M) XONTRO Inquire Skontro Data</u> BCBE_SKONTRO_DATA Übertragung einer Bestandsnachricht (ISIN und Daten) BCBE_SKONTRO_END Ende der Übertragung des Bestands <u>N) XONTRO Inquire Skontro ISIN</u> BCBE_SKONTRO_ISIN Übertragung einer Bestandsnachricht (nur ISIN) BCBE_SKONTRO_END Ende der Übertragung des Bestands
text	charboss[25]	<u>Erläuterung:</u> Freies Texteingabefeld für Kreditinstitute. Dieser Text wird auf den Geschäftsunterlagen des Orderaufgebers, falls der Aufgeber ein Kreditinstitut ist, vermerkt (z.B. Schlussnote, SNO-Datensatz etc.).
textTrad	charboss[35]	<u>Erläuterung:</u> Freitextfeld bei der Aufgaben- bzw. Geschäftseingabe
textTradAsk	charboss[35]	<u>Erläuterung:</u> Freitextfeld bei der Aufgaben- bzw. Geschäftseingabe (Verkaufseite) Feldinhalt: Bei Geschäften, die in XONTRO Order entstanden sind, wird dieses Feld mit 'BOSS' gefüllt.
textTradBid	charboss[35]	<u>Erläuterung:</u> Freitextfeld bei der Aufgaben- bzw. Geschäftseingabe (Kaufseite) Feldinhalt: siehe Feld [textTradAsk]
ticket	num[9]	<u>Erläuterung:</u> Schlüssel der Reservierung zur Kursfeststellung. Vom BE vergeben, vom FE bei der dezentralen Kursfeststellung zu benutzen. Stellt ein Request XONTRO Cancel Pricing oder XONTRO Finish Pricing den Wert BC_DO_NOT_CHECK_TICKET ein, dann führt das BE den Request ohne Prüfung durch, wenn eine gültige Reservierung vorliegt.
tickSizeXontro	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichnung der Ticksizes-Regel für Xontro-Börsen Feldinhalt: siehe WM Feld XD546

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 277
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
tradCapacityCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen „Trading Capacity“ (MiFID II) <u>Feldinhalt:</u> A, 'blank' = AOTC (default) D = DEAL M = MTCH
tradContTimFraction	num[4]	<u>Erläuterung:</u> Mikrosekunden zur Abschlusszeit einer Aufgabe/eines Geschäfts (Ergänzung zu tradContTim)
tradBegDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Schlusstag einer Aufgabe/eines Geschäfts Bei Aufgaben aus Kursfeststellung wird in diesem Feld das Datum der Kursfeststellung hinterlegt. Bei manuell eingegebenen Aufgaben/Geschäften wird in diesem Feld der Schlusstag hinterlegt. Der Schlusstag ist immer ein Börsentag. Es muss nicht der aktuelle Börsentag sein. Dieses Datum ist Basis für alle Berechnungen (Zinstage etc.).
tradClCod	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen des Geschäftsvorfalles <u>Feldinhalt:</u> 'blank' = Geschäft D = Storno E = Aufgabenlöschung F = Storno Info, passives Storno H = Storno-Info, passives Storno in TSL Gruppe L = Zwangsaufgabe (Düsseldorfer Modell) M = Zwangsaufgabe (Frankfurter Modell) O = Gegeneingabe fehlt (Düsseldorfer Modell) P = Gegeneingabe fehlt (Frankfurter Modell) Q = ohne Eingabe R = Storno Zwangsaufgabe U = HUM ohne Bank V = Unzulässige Weitergabe X = HUM-Gegeneingabe ohne Bank Y = HUM-Gegeneingabe ohne Bank
tradClearingPrc	priceboss num[10,4]	<u>Erläuterung:</u> Abrechnungskurs
tradCod	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Geschäftsart bei Eigengeschäften des Maklers. <u>Feldinhalt:</u> K = Eigengeschäft Kauf KS = Eigengeschäft Kauf Storno V = Eigengeschäft Verkauf VS = Eigengeschäft Verkauf Storno
tradContDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Abweichendes Abschlussdatum <u>Feldinhalt bei Request:</u> Das Feld darf nur mit einem Nicht-Börsentag belegt werden. <u>Feldinhalt bei Broadcast und Inquire:</u> Datum der Aufgaben-/Geschäftsentstehung (Abschlussdatum bzw. abweichendes Abschlussdatum). Der Inhalt kann von tradBegDat (Schlusstag) abweichen. Das Datum ist Basis für das Meldewesen.
tradContTim	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Abschlusszeit zum Abschlussdatum einer Aufgabe/eines Geschäfts

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 278
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
tradDifAmtAsk	amountboss Snum[16,2]	<u>Erläuterung:</u> Kursdifferenz auf der Verkaufseite
tradDifAmtBid	amountboss Snum[16,2]	<u>Erläuterung:</u> Kursdifferenz auf der Kaufseite
tradEnterDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum der Geschäftseingabe
tradMtchCod	char[3]	<u>Erläuterung:</u> Kurszusatz Feldinhalt: BZ = bezahlt BG = bezahlt Geld BB = bezahlt Brief EG = etwas bezahlt Geld EB = etwas bezahlt Brief RG = rationiert Geld RB = rationiert Brief * = kleine Beträge konnten nicht gehandelt werden G = Geld B = Brief P = bezahlt Primärmarkt BGP = bezahlt Geld Primärmarkt BBP = bezahlt Brief Primärmarkt RGP = rationiert Geld Primärmarkt RBP = rationiert Brief Primärmarkt BP = Brief Primärmarkt Der Kurszusatz * ist bei allen o.g. Kurszusätzen möglich. Die Ausgabe erfolgt im Anschluss an den Kurszusatz. C = Compensation _ = gestrichen _G = gestrichen Geld _B = gestrichen Brief _T = gestrichen Taxe _GT = gestrichen Taxe Geld _BT = gestrichen Taxe Brief U = bezahlt; es sind Eigenhandelsgeschäfte des Maklers enthalten M = bezahlt; es sind Glatstellungen des Maklers enthalten TRG = bezahlt; triggert Stoporders und führt anschließend eine umgesetzteMarketorder zu diesem Kurs aus Der Kurszusatz TRG ist nur beim Request XONTRO Enter Price Plus erlaubt.
tradMtchPrc	priceboss num[10,4]	<u>Erläuterung:</u> Kurs, zu dem die Order oder eine Teilnominale der Order ausgeführt wurde, oder Preis eines Geschäfts/einer Order.
tradMtchPrcNoAsk	num[5]	<u>Erläuterung:</u> Nummer der Kursfeststellung auf der Verkaufseite
tradMtchPrcNoBid	num[5]	<u>Erläuterung:</u> Nummer der Kursfeststellung auf der Kaufseite
tradMtchPrcAsk	priceboss num[10,4]	<u>Erläuterung:</u> Preis/Kurs der Verkaufseite eines Geschäftes
tradMtchPrcBid	priceboss num[10,4]	<u>Erläuterung:</u> Preis/Kurs der Kaufseite eines Geschäftes
tradMtchPrcDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum der Kursfeststellung, ein Wert. Der Wert 0 ist zulässig.
tradMtchPrcNo	num[5]	<u>Erläuterung:</u> Nummer der Kursfeststellung (für eine ISIN und einen Börsenplatz).

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 279
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
tradMtchPrcNoAsk	num[5]	<u>Erläuterung:</u> Nummer der Kursfeststellung auf der Verkaufseite
tradMtchPrcNoBid	num[5]	<u>Erläuterung:</u> Nummer der Kursfeststellung auf der Kaufseite
tradMtchPrcTim	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Zeitpunkt der Kursfeststellung
tradMtchPrcTimFraction	num[4]	<u>Erläuterung:</u> Mikrosekunden zum Zeitpunkt der Kursfeststellung (Ergänzung zu tradMtchPrcTim)
tradMtchPrcType	char[1]	<u>Erläuterung:</u> Art der Kursfeststellung (wird zurzeit noch nicht gefüllt) <u>Feldinhalt:</u> E = eigene Kursfeststellung Z = zugespielte Kursfeststellung
tradMtchQty	volumeboss num[13,3]	<u>Erläuterung:</u> Die Im Rahmen der Kursfeststellung ausgezeichnete Nominale (Stück oder Nennwert) der Order oder die Nominale einer Aufgabe/eines Geschäfts.
tradNo	num[13]	<u>Erläuterung:</u> Geschäfts-Nummer <u>Feldinhalt:</u> Die Geschäfts-Nummer wird automatisch durch XONTRO vergeben. Die Geschäfts-Nummer ist zusammen mit dem Börsenplatz des Geschäftes [tranExchangeld] eindeutig und kann als Identifizierungskennzeichen verwendet werden.
tradNoAsk	num[13]	<u>Erläuterung:</u> Ursprüngliche Geschäfts-Nummer auf der Verkaufseite <u>Feldinhalt:</u> Ursprüngliche Geschäfts-Nummer einer endgültigen Aufgabe. Bei der Schließung der Aufgabe wird eine neue Geschäftsnummer vergeben.
tradNoBid	num[13]	<u>Erläuterung:</u> Ursprüngliche Geschäfts-Nummer auf der Kaufseite <u>Feldinhalt:</u> Ursprüngliche Geschäfts-Nummer einer endgültigen Aufgabe. Bei der Schließung der Aufgabe wird eine neue Geschäftsnummer vergeben.
tradNoOld	num[13]	<u>Erläuterung:</u> Geschäfts-Nummer des stornierten Geschäftes <u>Feldinhalt:</u> Die Geschäfts-Nummer des bei einer Eingabe in der Transaktion „Storno-Neugeschäft“ (BCEM SN) stornierten Geschäftes. Das Neugeschäft erhält eine neue Geschäfts-Nummer.
tradTim	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Eingabezeit eines Geschäftes
tradTimeStamp	num[12] [HHMMSSCCnnnn]	<u>Erläuterung:</u> Zeitstempel der Erzeugung eines Eigengeschäfts.
tranContDatAsk	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum der Geschäftsentstehung auf der Verkaufseite (Abschlussdatum bzw. abweichendes Abschlussdatum). Das Feld kann einen Nicht- Börsentag enthalten. Der Inhalt kann von [tradBegDat] (Schlusstag) abweichen. Das Datum ist Basis für das Meldewesen.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 280
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Feldname	Definition	Bemerkung
tranContDatBid	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum der Geschäftsentstehung auf der Kaufseite (Abschlussdatum bzw. abweichendes Abschlussdatum). Das Feld kann einen Nicht-Börsentag enthalten. Der Inhalt kann von [tradBegDat] (Schlusstag) abweichen. Das Datum ist Basis für das Meldewesen.
tranContTimAsk	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Abschlussuhrzeit auf der Verkaufseite
tranContTimBid	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Abschlussuhrzeit auf der Kaufseite
tranContTimFractionAsk	num[4]	<u>Erläuterung:</u> Mikrosekunden zur Abschlusszeit auf der Verkaufseite (Ergänzung zu tranContTimAsk)
tranContTimFractionBid	num[4]	<u>Erläuterung:</u> Mikrosekunden zur Abschlusszeit auf der Kaufseite (Ergänzung zu tranContTimBid)
tranDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Datum des Versands der Nachricht an die FE Applikation.
tranExchangeld	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Börsenplatz des Geschäftes Feldinhalt: siehe Feld [exchangeld]
tranFee	Snum[10,2]	<u>Erläuterung:</u> Transaktionsentgelt (mit Vorzeichen!)
tranFeeAsk	Snum[10,2]	<u>Erläuterung:</u> Transaktionsentgelt der Verkaufseite (mit Vorzeichen!)
tranFeeBid	Snum[10,2]	<u>Erläuterung:</u> Transaktionsentgelt der Kaufseite (mit Vorzeichen!)
tranFeeFlag	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Transaktionsentgelt-Kennzeichen Feldinhalt: AT = abweichendes Transaktionsentgelt HT = halbes Transaktionsentgelt KT = kein Transaktionsentgelt
tranFeeFlagAsk	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Transaktionsentgelt-Kennzeichen Verkaufseite Feldinhalt: AT = abweichendes Transaktionsentgelt HT = halbes Transaktionsentgelt KT = kein Transaktionsentgelt
tranFeeFlagBid	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Transaktionsentgelt-Kennzeichen Kaufseite Feldinhalt: AT = abweichendes Transaktionsentgelt HT = halbes Transaktionsentgelt KT = kein Transaktionsentgelt
tranTim	timeboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Zeitpunkt des Versands der Nachricht an die FE Applikation.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 281
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
trdResTypCod	char[2]	<p><u>Erläuterung:</u></p> <p>A. Handelshinweis</p> <p>Feldinhalt: EK = erster Kurs (in Stuttgart nur bei Ausführungen) KS = Kassakurs SK = Schlusskurs (nur bei Ausführungen) VA = variabler Handel 'blank' = variabler Handel</p> <p><u>Prüfung:</u> Wird das Feld bei der Ordereingabe initialisiert übergeben, überprüft das Back End ggfs., ob die Nominale ein Vielfaches des jeweiligen Mindestschlusses der Gattung ist. Ist dies der Fall, erfolgt die Einstellung der Order in den variablen Handel. Ist dies nicht der Fall, so erfolgt die Einstellung der gesamten Order zur nächsten Kassakursfeststellung. Bei der Übermittlung einer Ausführung sagt das Feld aus, zu welchem Kurs die Order ausgeführt wurde.</p> <p>B. Kursart</p> <p>Feldinhalt: EK = erster Kurs KS = Kassakurs VA = variabler Kurs SK = Schlusskurs EM = erster Kurs maschinell KM = Kassakurs maschinell VM = variabler Kurs maschinell SM = Schlusskurs maschinell</p> <p><u>Prüfung:</u> Mit den Feldinhalten „EM“, „KM“, „VM“ und „SM“ werden maschinelle dezentrale Kursfeststellungen gekennzeichnet. Die Ausprägungen sind gültig für die Requests XONTRO Start Pricing XONTRO Enter Price XONTRO Enter Block Price sowie für die Broadcasts BCFE_LOCK_ORDERS BCFE_ENTER_PRICE BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE</p> <p>In ausschließlich einheitsnotierten Gattungen sind nur „KS“ und „KM“ gültig. In ausschließlich fortlaufend notierten Gattungen sind nur „EK“, „EM“, „VA“, „VM“, „SK“ und „SM“ gültig.</p>
trdTypXontro	char[2]	<p><u>Erläuterung:</u> Kennzeichen börsliches Geschäft</p> <p>Feldinhalt: 'blank' = außerbörslich (Default) BS = börslich</p>
trdTypXontroAsk	char[2]	<p><u>Erläuterung:</u> Kennzeichen börsliches Geschäft auf der Verkaufseite</p> <p>Feldinhalt:</p>

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 282
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

Feldname	Definition	Bemerkung
		siehe Feld [trdTypXontro]
trdTypXontroBid	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen börsliches Geschäft auf der Kaufseite <u>Feldinhalt:</u> siehe Feld [trdTypXontro]
tvTic	char[52]	<u>Erläuterung:</u> Trading Venue Transaction Identification Code (MiFID II) Der Schlüsselwert wird für jede Kursfeststellung eindeutig vergeben
tvTicAsk	char[52]	<u>Erläuterung:</u> Trading Venue Transaction Identification Code (MiFID II) auf der Verkaufseite
tvTicBid	char[52]	<u>Erläuterung:</u> Trading Venue Transaction Identification Code (MiFID II) auf der Kaufseite
userNo	num[10] [nnnnxxxxxx]	<u>Erläuterung:</u> Identifizierungskennzeichen des Eingebers <u>Feldinhalt:</u> nnnn = KV-Nummer des Eingebers xxxxxx = Individuelle Mitarbeiterkennung des Eingebers
untOfTrad	num[3]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen der Notierungsart (Quantity Notation) <u>Feldinhalt:</u> 0 = keine Angabe 1 = Stück-Notiz 2 = Prozent-Notiz 3 = Promille-Notiz 4 = Notierung in Punkten 9 = Sonstiges
userOrdNum	charboss[16]	<u>Erläuterung:</u> Bankinterne Ordernummer eines Kreditinstitutes <u>Feldinhalt:</u> Es kann eine bis zu 16-stellige bankinterne Ordernummer vergeben werden. <u>Prüfung:</u> Die Eindeutigkeitsprüfung der bankinternen Ordernummer erfolgt auf Basis der von den Kreditinstituten vorgenommenen Einstellungen der Verarbeitungssteuerung (BCIN BV). Es sind keine Umlaute und Sonderzeichen zulässig (Beispiel: Ä, Ö, Ü, \$, &, etc.).
valueDat	dateboss num[8]	<u>Erläuterung:</u> Valutadatum
valueDatCod	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Valutakennzeichen <u>Feldinhalt:</u> FZ = Zug um Zug Regulierung FI = internationale Valuta (kann nicht bei Requests verwendet werden) FE = Emissionsvaluta bei Handel per Erscheinen (kann nicht bei Requests verwendet werden)
venueMic	char[4]	<u>Erläuterung:</u> MIC (Market Identifier Code) des Handelsplatzes bzw. des Handelsegmentes eines Handelsplatzes im Sinne der MiFID II Regulation.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 283
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

Feldname	Definition	Bemerkung
venueSegMic	char[4]	<u>Erläuterung:</u> MIC (Market Identifier Code) des Handelssegmentes eines Handelsplatzes im Sinne der CSDR Regulation.
xontroOdrCodAsk	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen des Ursprungs des Geschäfts auf der Verkaufseite Feldinhalt: C = Order aus XONTRO Order CW = Orderweiterleitung aus XONTRO Order
xontroOdrCodBid	char[2]	<u>Erläuterung:</u> Kennzeichen des Ursprungs des Geschäfts auf der Kaufseite Feldinhalt: siehe Feld [xontroOdrCodAsk]

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 284
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

3.3 Übersicht Feldbezeichner

Folgende Feldbezeichner sind bei Fehlermeldungen in errFieldRef eingetragen

undefiniert	BC_ERR_FIELD_UNDEFINED
acctTypCodXontro	BC_ERR_FIELD_ACCT_TYP_COD_XONTRO
acctTypCodXontroAsk	BC_ERR_FIELD_ACCT_TYP_COD_XONTRO_ASK
acctTypCodXontroBid	BC_ERR_FIELD_ACCT_TYP_COD_XONTRO_BID
acrIntDay	BC_ERR_FIELD_ACR_INT_DAY
acrIntDayCod	BC_ERR_FIELD_ACR_INT_DAY_COD
allotCapQty	BC_ERR_FIELD_ALLOT_CAP_QTY
allotType	BC_ERR_FIELD_ALLOT_TYPE
bcPwd	BC_ERR_FIELD_BC_PWD
bkrNo	BC_ERR_FIELD_BKR_NO
bkrUserNo	BC_ERR_FIELD_BKR_USER_NO
bonusRat	BC_ERR_FIELD_BONUS_RAT
btradeNo	BC_ERR_FIELD_BTRADE_NO
btradeNoAsk	BC_ERR_FIELD_BTRADE_NO_ASK
btradeNoBid	BC_ERR_FIELD_BTRADE_NO_BID
buyCod	BC_ERR_FIELD_BUY_COD
changeQty	BC_ERR_FIELD_CHANGE_QTY
chargesAsk	BC_ERR_FIELD_CHARGES_ASK
chargesBid	BC_ERR_FIELD_CHARGES_BID
clearingCurrTypCod	BC_ERR_FIELD_CLEARING_CURR_TYP_COD
clientInd	BC_ERR_FIELD_CLIENT_IND
clientCod	BC_ERR_FIELD_CLIENT_COD
comAmtAsk	BC_ERR_FIELD_COM_AMT_ASK
comAmtBid	BC_ERR_FIELD_COM_AMT_BID
comCodAsk	BC_ERR_FIELD_COM_COD_ASK
comCodBid	BC_ERR_FIELD_COM_COD_BID
commissionAgentFlag	BC_ERR_FIELD_COMMISSION_AGENT_FLAG
comRateAsk	BC_ERR_FIELD_COM_RATE_ASK
comRateBid	BC_ERR_FIELD_COM_RATE_BID
confirmTim	BC_ERR_FIELD_CONFIRM_TIM
ctpyExchangeld	BC_ERR_FIELD_CTPY_EXCHANGE_ID
ctpyNo	BC_ERR_FIELD_CTPY_NO
ctpyNoAsk	BC_ERR_FIELD_CTPY_NO_ASK
ctpyNoBid	BC_ERR_FIELD_CTPY_NO_BID
ctpySubNo	BC_ERR_FIELD_CTPY_SUB_NO
currExcRat	BC_ERR_FIELD_CURR_EXC_RAT
currTypCod	BC_ERR_FIELD_CURR_TYP_COD
customerld	BC_ERR_FIELD_CUSTOMER_ID
customerldClass	BC_ERR_FIELD_CUSTOMER_ID_CLASS
deactComment	BC_ERR_FIELD_DEACT_COMMENT
deactFromDat	BC_ERR_FIELD_DEACT_FROM_DAT
deactText	BC_ERR_FIELD_DEACT_TEXT
deactToDat	BC_ERR_FIELD_DEACT_TO_DAT
deaFlag	BC_ERR_FIELD_DEA_FLAG
exchangeld	BC_ERR_FIELD_EXCHANGE_ID
exchangeOrdNum	BC_ERR_FIELD_EXCHANGE_ORD_NUM
executionInd	BC_ERR_FIELD_EXECUTION_IND
executionCod	BC_ERR_FIELD_EXECUTION_COD

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 285
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

fee	BC_ERR_FIELD_FEE
feeAsk	BC_ERR_FIELD_FEE_ASK
feeBid	BC_ERR_FIELD_FEE_BID
feeFlag	BC_ERR_FIELD_FEE_FLAG
feeFlagAsk	BC_ERR_FIELD_FEE_FLAG_ASK
feeFlagBid	BC_ERR_FIELD_FEE_FLAG_BID
fwdOrdrCod	BC_ERR_FIELD_FWD_ORDR_COD
inSeqNo	BC_ERR_FIELD_IN_SEQ_NO
inSeqNoRef	BC_ERR_FIELD_IN_SEQ_NO_REF
investmentInd	BC_ERR_FIELD_INVESTMENT_IND
investmentCod	BC_ERR_FIELD_INVESTMENT_COD
isinCod	BC_ERR_FIELD_ISIN_COD
isinCodNew	BC_ERR_FIELD_ISIN_COD_NEW
isinCodSrs	BC_ERR_FIELD_ISIN_COD_SRS
iwOrdCod	BC_ERR_FIELD_IW_ORD_COD
iwOrdCodAsk	BC_ERR_FIELD_IW_ORD_COD_ASK
iwOrdCodBid	BC_ERR_FIELD_IW_ORD_COD_BID
killFlag	BC_ERR_FIELD_KILL_FLAG
liquidityProvFlag	BC_ERR_FIELD_LIQUIDITY_PROV_FLAG
matchFlag	BC_ERR_FIELD_MATCH_FLAG
matchFlagAsk	BC_ERR_FIELD_MATCH_FLAG_ASK
matchFlagBid	BC_ERR_FIELD_MATCH_FLAG_BID
netTypCodXontro	BC_ERR_FIELD_NET_TYP_COD_XONTRO
nrCod	BC_ERR_FIELD_NR_COD
nrDat	BC_ERR_FIELD_NR_DAT
onBehalfCtpyNoAsk	BC_ERR_FIELD_ON_BEHALF_CTPY_NO_ASK
onBehalfCtpyNoBid	BC_ERR_FIELD_ON_BEHALF_CTPY_NO_BID
optOutFlag	BC_ERR_FIELD_OPT_OUT_FLAG
ordrBegDatCod	BC_ERR_FIELD_ORDR_BEG_DAT_COD
ordrBkExeQty	BC_ERR_FIELD_ORDR_BK_EXE_QTY
ordrEntNo	BC_ERR_FIELD_ORDR_ENT_NO
ordrExePrc	BC_ERR_FIELD_ORDR_EXE_PRC
ordrExePrcAsk	BC_ERR_FIELD_ORDR_EXE_PRC_ASK
ordrExePrcBid	BC_ERR_FIELD_ORDR_EXE_PRC_BID
ordrExePrcMod	BC_ERR_FIELD_ORDR_EXE_PRC_MOD
ordrExpDat	BC_ERR_FIELD_ORDR_EXP_DAT
ordrNo	BC_ERR_FIELD_ORDR_NO
ordrQty	BC_ERR_FIELD_ORDR_QTY
ordrQtyAsk	BC_ERR_FIELD_ORDR_QTY_ASK
ordrQtyBid	BC_ERR_FIELD_ORDR_QTY_BID
ordrResCod	BC_ERR_FIELD_ORDR_RES_COD
ordrStopLim	BC_ERR_FIELD_ORDR_STOP_LIM
origOrdrQty	BC_ERR_FIELD_ORIG_ORDR_QTY
otcPostTradInd	BC_ERR_FIELD_OTC_POST_TRAD_IND
postProcFlag	BC_ERR_FIELD_POST_PROC_FLAG
processingCod	BC_ERR_FIELD_PROCESSING_COD
quoteTimeStamp	BC_ERR_FIELD_QUOTE_TIME_STAMP
redQty	BC_ERR_FIELD_RED_QTY
refTim	BC_ERR_FIELD_REF_TIM
repExchangeld	BC_ERR_FIELD_REP_EXCHANGE_ID
repExchangeldAsk	BC_ERR_FIELD_REP_EXCHANGE_ID_ASK
repExchangeldBid	BC_ERR_FIELD_REP_EXCHANGE_ID_BID
settlementFlag	BC_ERR_FIELD_SETTLEMENT_FLAG

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 286
XONTRO Values API – Planing Version	Version 02.01 05.11.2020
XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	

shortSellCod	BC_ERR_FIELD_SHORT_SELL_COD
text	BC_ERR_FIELD_TEXT
textTrad	BC_ERR_FIELD_TEXT_TRAD
textTradAsk	BC_ERR_FIELD_TEXT_TRAD_ASK
textTradBid	BC_ERR_FIELD_TEXT_TRAD_BID
ticket	BC_ERR_FIELD_TICKET
tradBegDat	BC_ERR_FIELD_TRAD_BEG_DAT
tradCapacityCod	BC_ERR_FIELD_TRAD_CAPACITY_COD
tradContDat	BC_ERR_FIELD_TRAD_CONT_DAT
tradContTim	BC_ERR_FIELD_TRAD_CONT_TIM
tradContTimFraction	BC_ERR_FIELD_TRAD_CONT_TIM_FRACTION
tradMtchCod	BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_COD
tradMtchPrc	BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_PRC
tradMtchPrcAsk	BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_PRC_ASK
tradMtchPrcBid	BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_PRC_BID
tradMtchPrcNo	BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_PRC_NO
tradMtchQty	BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_QTY
tradNo	BC_ERR_FIELD_TRAD_NO
tranExchangeld	BC_ERR_FIELD_TRAN_EXCHANGE_ID
tranFee	BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE
tranFeeAsk	BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE_ASK
tranFeeBid	BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE_BID
tranFeeFlag	BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE_FLAG
tranFeeFlagAsk	BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE_FLAG_ASK
tranFeeFlagBid	BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE_FLAG_BID
trdResTypCod	BC_ERR_FIELD_TRD_RES_TYP_COD
trdTypXontro	BC_ERR_FIELD_TRD_TYP_XONTRO
tvTic	BC_ERR_FIELD_TV_TIC
untOfTrad	BC_ERR_FIELD_UNT_OF_TRAD
userOrdNum	BC_ERR_FIELD_USER_ORD_NUM
valueDat	BC_ERR_FIELD_VALUE_DAT
valueDatCod	BC_ERR_FIELD_VALUE_DAT_COD

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 287
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

3.4 Completion Codes

Die Fehlermeldungen entnehmen Sie bitte der aktuellsten Datei XONTROmsg_qsam.dat. Diese finden Sie im Download-Bereich unter www.xontro.de.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 288
XONTRO Values API – Planing Version XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02	Version 02.01 05.11.2020

3.5 Xontro Values API Header und Completion Codes

Dieser Abschnitt beschreibt alle Dateien, die für die Programmierung der Xontro VALUES API Schnittstelle benötigt werden. Diese Dateien enthalten die Fehlertexte, Konstanten, Aufzählungen und Strukturdefinitionen.

In der nachfolgenden Tabelle sind die Dateien zusammengestellt. Sie werden als Headerfelder über die Website www.xontro.de bereitgestellt.

Datei	Beschreibung
bclayouts_qsam.h	Die Datei beinhaltet die Konstantendefinitionen in „C“ Syntax für alle Xontro Request IDs, Subtypes, errFieldRef Werte, Streamtypes, symbolisch adressierbare Completion Codes, und die in der vorliegenden Dokumentation beschriebenen, symbolisch adressierbaren Feldwerte. Sie enthält weiterhin alle Xontro-spezifischen Datenstrukturen.
XONTROmsg_qsam.dat	Die Datei beinhaltet alle Xontro spezifischen Completion Codes im Feld qsamComplCode und die zugeordneten Fehlertexte. Diese Datei kann auch zur Entschlüsselung des Feld errCod in der Xontro Enter Block Price Response verwendet werden. Das Format jeder Zeile ist: NNNNN, Fehlertext NNNNN steht für den Wert des Completion Codes