

FAGSE BT-FIX Gateway

Rules of Engagement

Dokument: v238_RoE BT-FIX Gateway.docx

Version: 2.3.8

Letzte Änderung: 27. Oktober 2020

Produktiv ab: 24. Mai 2021

Test ab: 05. April 2021

FAGSE

BT-FIX Gateway

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 2 von 139

Verwandte Dokumente

XONTRO

- [1] Kreditinstitute - Technische Anbindung, Release 5.2
- [2] Systemanschluss Makler XONTRO VALUES API, Release 30

FIX

- [3] FIX protocol limited: FIX Documentation Version 4.4 with Errata 20030618, Volumes 1-7 vom 18.6.2003
- [4] FIX protocol limited: FIX Documentation Version 4.2 with Errata 20010501 vom 1.5.2001
- [5] FIX protocol limited: Exchanges / ECN Working Group Recommended Best Practices Phase 1 January 25, 2007

Webseiten

www.xontro.de

www.deutsche-boerse.com

www.fixprotocol.org

FAGSE

BT-FIX Gateway

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 3 von 139

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung.....	6
1.1	Abkürzungen und Definitionen.....	7
2	Randbedingungen	8
2.1	Protokollversionen.....	8
2.2	Clients und OMS	8
2.3	Security.....	9
2.4	Zielsysteme.....	9
2.5	Instrumente	10
2.6	Konkurrenzen mit anderen Interfaces der Zielsysteme.....	10
2.7	Umsetzung der MiFID II Anforderungen.....	11
2.7.1	Versorgung der MiFID II Datenfelder	11
2.7.2	Shortcode-Verfahren	11
2.8	Order- bzw. Auftrags-Funktionalität	12
2.8.1	Orderidentifikation	12
2.8.2	Empfehlungen	12
2.8.3	INVESTRO / Vestima	13
2.8.4	Besonderheiten bei der Behandlung bestimmter Requests	13
2.9	Trade-Funktionalität	14
2.9.1	Unterstützte Nachrichten	14
2.9.2	Tradeidentifikation.....	14
2.10	Reject Verhalten.....	15
2.11	Verhalten bei ResendRequest	15
2.12	Inbetriebnahme	15
3	Leistungsmerkmale.....	16
3.1	Eingehende und Ausgehende Nachrichten	16
3.2	Szenarien und Nachrichten des Sessionlevels.....	17
3.2.1	Verarbeitung FIX-Requests	17
3.2.2	Systemgenerierte Nachrichten.....	17
3.3	Szenarien und Nachrichten des Applikationslevels	18
3.3.1	Verarbeitung FIX-Requests	18
3.3.2	Externe Eingaben / systemgenerierte Nachrichten.....	19
3.4	Unterschiede zwischen FIX 4.2 und FIX 4.4	20
3.4.1	Orderrouting.....	20
3.4.2	Passwortänderung	21
3.4.3	Trade-Nachrichten.....	21
4	FIX-Nachrichten, Detailbeschreibung zu Header/Trailer	22
4.1	Erläuterungen FIX Header/Trailer	22
4.2	FIX Header <standard message header>	23
4.3	FIX Trailer <standard message trailer>	24
5	FIX-Nachrichten des Sessionlevels.....	25
5.1	Erläuterungen FIX Datenteil	25
5.2	Logon / Logon mit gleichzeitiger Passwortänderung	26
5.3	Passwortänderung	28
5.4	Logout.....	29
5.5	System Shutdown	30

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 4 von 139

6	FIX-Nachrichten vom Typ Reject und Business Message Reject.....	31
7	FIX-Nachrichten des Applicationlevels	32
7.1	Erläuterungen FIX Datenteil	32
7.2	Orderfunktionalität.....	33
7.2.1	Order- bzw. Auftragseinstellung.....	33
7.2.1.1	Abläufe – Orders	33
7.2.1.2	Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)	35
7.2.1.3	Request "NewOrderSingle".....	38
7.2.1.4	Response "Execution Report" - Identifikationskriterien.....	43
7.2.1.5	Response "Execution Report" - Nachrichtendaten	44
7.2.2	Order- bzw. Auftragslöschung	49
7.2.2.1	Abläufe – Orders	49
7.2.2.2	Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)	51
7.2.2.3	Request "Order Cancel Request"	54
7.2.2.4	Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv, negativ von Vestima).....	56
7.2.2.5	Response "Order Cancel Reject" (endgültig negativ)	59
7.2.3	Order- bzw. Auftragsänderung.....	60
7.2.3.1	Abläufe – Orders	60
7.2.3.2	Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)	61
7.2.3.3	Request "Order Cancel Replace Request"	62
7.2.3.4	Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv)	65
7.2.3.5	Response "Order Cancel Reject" (endgültig negativ)	68
7.2.4	Order- bzw. Auftragsausführung	69
7.2.4.1	Abläufe – Orders	69
7.2.4.2	Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)	70
7.2.4.3	Nachricht zur Orderausführung "Execution Report"	71
7.2.5	Auslösung einer Aktion über ein anderes Interface	74
7.2.5.1	Einstellungen, Änderungen und Löschungen von Orders bzw. Aufträgen.....	74
7.2.5.2	Eingaben über die Investro-Funktion „Sammelerfassung von Aufträgen“	75
7.2.5.3	Umsetzung einer Stop Order	76
7.2.5.4	Aktivierung einer EG-Order	77
7.2.5.5	Zurücksetzen einer bereits aktivierten EG-Order auf den ursprünglichen Status "EG" ...	77
7.2.6	Systemgenerierte Orderänderungen und Löschungen	78
7.2.7	Componenten Blocks und Repeating Groups.....	80
7.2.7.1	Instrument Component Block <instrument>	80
7.2.7.2	Party Konzept <parties>	81
7.2.7.3	Trading Sessions Repeating Group <trading sessions>	84
7.2.7.4	Order Attribute Repeating Group <OrderAttributes>	85
7.2.7.5	Value Checks Repeating Group <ValueChecksGrp>	85
7.2.7.6	Regulatory TradeID Repeating Group <RegulatoryTradeIDGrp>.....	86
7.2.8	Besonderheiten der Tag Behandlung.....	86
7.3	Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima) - Besonderheiten.....	87
7.3.1	Nachrichten an den Auftragsempfänger (INVESTRO "classic").....	87
7.3.2	Auftragsrouting an INVESTRO mit Vestima-Gattungen.....	88
7.3.2.1	Direkte Ablehnung in INVESTRO	88
7.3.2.2	Übergabe an Vestima.....	88
7.4	Ereignisse	89
7.4.1	Abläufe.....	89
7.4.2	Ereignismitteilung "News"	89
7.4.3	NoLinesOfText Repeating Group <LinesOfTextGrp>	90
7.4.4	NoRelatedSym Repeating Group <InstrmtGrp>	90
7.4.5	NoRoutingIDs Repeating Group <RoutingGrp>.....	90

FAGSE

BT-FIX Gateway

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 5 von 139

7.5	Tradefunktionalität.....	91
7.5.1	Unterstützte Vorfälle.....	91
7.5.2	Abläufe.....	92
7.5.3	OTC-Geschäfte und MiFID-Reports - Requests	93
7.5.3.1	Request "TradeCaptureReport" - Identifikationskriterien	93
7.5.3.2	Request "TradeCaptureReport" - Nachrichtendaten.....	94
7.5.3.3	Instrument Component Block <instrument>	97
7.5.3.4	NoTrdRegTimestamps Repeating Group <TrdRegTimestamps>.....	97
7.5.3.5	NoTransactionCosts Repeating Group <courtage>	99
7.5.3.6	NoSides Repeating Group <TrdCaptRptSideGrp>	99
7.5.3.7	Party Konzept <parties>	102
7.5.4	OTC-Geschäfte und MiFID-Reports - Responses	103
7.5.4.1	Response "TradeCaptureReportAck" - Identifikationskriterien.....	103
7.5.4.2	Response "TradeCaptureReportAck" - Nachrichtendaten	104
7.5.4.3	Instrument Component Block <instrument>	105
7.5.5	Schlussnoten-Realtime.....	106
7.5.5.1	Geschäftsinformation "TradeCaptureReportSno"	107
7.5.5.2	Instrument Component Block <instrument>	110
7.5.5.3	NoSecAltID Repeating Group <SecAltIDGrp>.....	111
7.5.5.4	NoTrdRegTimestamps Repeating Group <TrdRegTimestamps>.....	111
7.5.5.5	NoMiscFees Repeating Group <gebühren>	111
7.5.5.6	NoTransactionCosts Repeating Group <courtage>	112
7.5.5.7	NoSides Repeating Group <SnoRealtimeSideGrp>	113
7.5.5.8	Party Konzept <parties>	116
7.5.5.9	NoPartySubIDs Repeating Group <PtysSubGrp>	117
7.5.5.10	Regulatory TradeID Repeating Group <RegulatoryTradeIDGrp>.....	117
8	Anhang A: Beispiele.....	118
9	Anhang B: Einschränkungen von Formaten und Strukturen	120
10	Anhang C: Benutzerdefinierte Tags	122
11	Anhang D: Erweiterungen des 4.2 Sprachumfangs	129
12	Anhang E: Erweiterungen des 4.4 Sprachumfangs	131
13	Anhang F: Abweichende Belegungen von Standardtags	132
14	Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart).....	138

1 Einleitung

Dieses Dokument beschreibt die Implementation des FIX Protokolls der Versionen 4.2 und 4.4 im BT-FIX Gateway für

- das Orderrouting zu den Handelssystemen XONTRO, MAX-ONE, Xetra und Xetra Ffm-2,
- die Auftragsverarbeitung in den Fonds-Abwicklungssystemen INVESTRO und Vestima,
- die Tradeverarbeitung in dem Handelssystem XONTRO.

Im vorliegenden Dokument, ist der Begriff Order(s) im Zusammenhang mit Investro / Vestima immer als Auftrag oder Aufträge zu verstehen.

Gleiches gilt für die Verwendung des Begriffs 'Handelssystem'. Dies ist im gleichen Zusammenhang immer als Abwicklungssystem zu verstehen.

Das Dokument erläutert Voraussetzungen, Randbedingungen und den Message Flow. Das Dokument richtet sich an Kunden, welche dieses Interface für Orderrouting/Auftragsverarbeitung/Tradeverarbeitung an die genannten Handelssysteme nutzen wollen.

Die folgende Darstellung erläutert den Zusammenhang zwischen den beteiligten Systemen

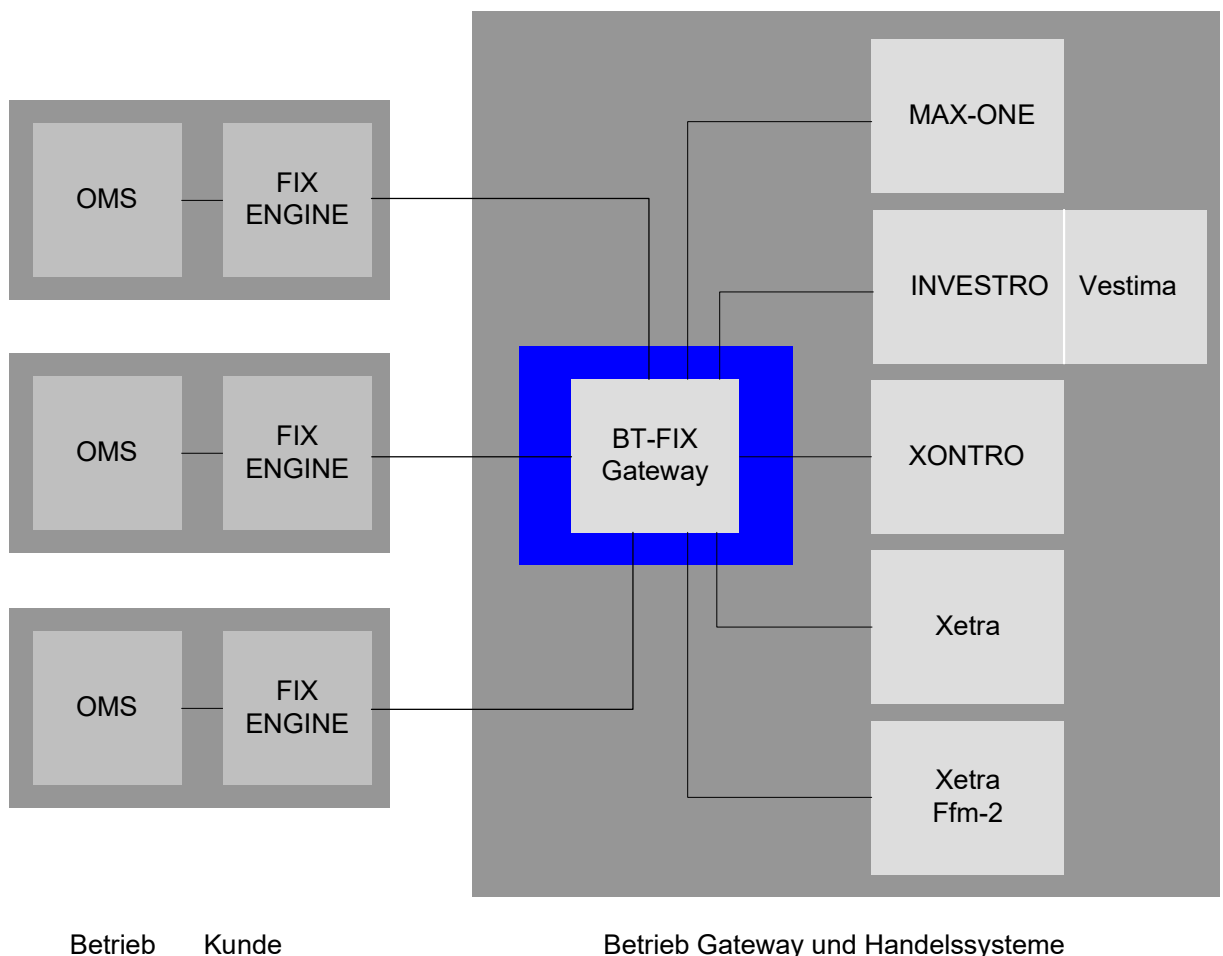


Abbildung 1-1: Systemüberblick

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 7 von 139

1.1 Abkürzungen und Definitionen

Item	Beschreibung
FAGSE	Als Produktname verwendetes Akronym für die Anwendung, die sich aus dem BT-FIX Gateway und dem BT-FIX Connector zusammensetzt. (FIX Access for German Stock Exchanges)
FIX	Das FIX-Protokoll ist ein offener Standard zum Austausch von Informationen, welcher von Banken, Brokern, Börsen und sonstigen Dienstleistern geschaffen wurde. FIX steht dabei für F inancial I nformation eX change. Durch die Verwendung eines gemeinsamen Standards wird der Austausch von Informationen zwischen den Anwendungen der verschiedenen Hersteller erheblich vereinfacht.
MAX-ONE	Das elektronische Handelssystem der Börse München.
RoE	Abkürzung für Rules of Engagement. Eine vertragliche Vereinbarung zwischen Institutionen, in denen die spezifischen Regeln für die FIX Kommunikation zwischen den FIX Anwendungen beider Partner festgelegt sind. In ihnen werden u.a. folgende Dinge geregelt: Netzwerk-Anbindung, Identifizierung der Kommunikationspartner, Nachrichtenverschlüsselung, Behandlung doppelter Nachrichten, unterstützte Nachrichtentypen.
TCP/IP	Transmission Control Protocol / Internet Protocol (TCP/IP). FIX setzt als Kommunikations-Protokoll die Verwendung von TCP/IP voraus.
OHA	Order handling agent Vestima: Order-Empfänger in Vestima.
OMS	Order Management System (Kunde).

2 Randbedingungen

2.1 Protokollversionen

Unterstützt werden die FIX Protokoll Versionen V4.2 und V4.4. Die beschriebenen Nachrichtenstrukturen enthalten zum Teil relativ umfangreiche Erweiterungen der Versionen. Zusätzlich notwendige Tags werden ebenso wie die Erweiterungen der Wertebereiche bestehender Tags soweit möglich einer der nächsten Versionen des FIX Protokolls – bis einschließlich V5.0 SP2 - entnommen¹. Ist dies nicht möglich, werden registrierte, benutzerdefinierte Tags herangezogen.

FIXML wird nicht unterstützt.

Als technische Anbindung wird die der FIX Versionen 4.x verwendet, es sind also nur Standard TCP/IP Anbindungen möglich.

2.2 Clients und OMS

Als Client (oder FIX Client) wird die FIX Engine eines Anschlussinhabers (Kunden) bezeichnet. Clients werden über CompIDs identifiziert, welche mit der BrainTrade GmbH zu vereinbaren sind.

Der Kunde kann die Rechnerkonstellation seiner FIX Engine aus Gründen der Ausfallsicherheit redundant auslegen. Dabei sind sowohl Clusterlösungen als auch stand-alone Lösungen möglich.

Der Kunde muss eine der folgenden Konfigurationsvarianten unterstützen. In allen Varianten wird auf Kundenseite nur eine SenderCompID verwendet.

1. Die FIX Engine wird redundant auf mehreren Rechnern eines Clusters betrieben. Die Implementation der FIX Engine unterstützt den Cluster Failover. Sessions werden automatisch fortgeführt.
2. Die FIX Engine wird redundant auf mehreren Rechnern betrieben. Der Failover erfolgt manuell. Die für einen Failover erforderlichen Informationen (Sequenznummern, gesendete Nachrichten, etc.) werden in einem gemeinsam genutzten SAN-Speicher gehalten. Nach einem Failover kann die neue Instanz der FIX Engine die Session fortsetzen.
3. Die FIX Engine wird redundant auf mehreren Rechnern betrieben. Ein gemeinsamer SAN-Speicher ist nicht vorgesehen. Der Failover erfolgt manuell. Nach dem Start der Session ist der Logon mit einer Message Sequence Number zu versenden, welche sicher über der letzten versendeten liegt (administrative Vorgabe der Message Sequence Number). Die FIX Engine des Kunden muss darauf eingestellt sein, den folgenden Resend Request des FAGSE BT-FIX Gateway mit einer Reset Nachricht mit Gapfill so zu beantworten, dass die Lücke geschlossen wird. Danach kann die Session fortgesetzt werden.

Das BT-FIX Gateway wird ebenfalls über eine CompID identifiziert, welche von der BrainTrade GmbH vergeben wird.

Die Anbindung erfolgt über eine oder zwei Standleitungen, das Protokoll ist TCP/IP².

FIX Sessions werden immer von der FIX Engine des Kunden aufgebaut.

¹ Nachrichtenformate der Version 4.2 werden um Definitionen der Versionen 4.4 und 5.0, Nachrichtenformate der Version 4.4 um Definitionen der Version 5.0 erweitert, siehe hierzu: Anhang D: Erweiterungen des 4.2 Sprachumfangs und Anhang E: Erweiterungen des 4.4 Sprachumfangs.

² Es ist zunächst keine Unterstützung von Version 5.0 und damit auch keine Unterstützung von FIXT vorgesehen.

Ein Client muss zunächst entweder FIX 4.2 oder FIX 4.4 nutzen und zusätzlich die definierten Restriktionen (des vorliegenden Dokuments) einhalten.

Das OMS kann sowohl von einem bestimmten Kunden als auch von einem Provider für mehrere Kunden betrieben werden. Für einen einzelnen Kunden sind die vom Systemanschluss Kreditinstitute bekannten Zentral/Filialkonstruktionen möglich.

Für den Anschlussinhaber und alle Teilnehmer, die einen konkreten Anschluss nutzen wollen, sind zulässige KV-Nummern erforderlich, welche zusätzlich für das FIX Interface berechtigt werden müssen, siehe Kapitel 2.3 Security.

2.3 Security

Das BT-FIX Gateway unterstützt keine Verschlüsselung auf FIX-Level.

Auf Netzwerkebene kann die Verbindung vom Router des Kunden bis zum Router des Betreibers des BT-FIX Gateway in Absprache zwischen dem Betreiber des BT-FIX Gateway und dem Kunden über IPSec abgesichert werden.

Die FIX Engines auf beiden Seiten der Verbindung werden über die Tags SenderCompID bzw. TargetCompID identifiziert.

Jeder FIX Anschlussinhaber muss sicherstellen, dass nur Requests mit der vereinbarten SenderCompID abgesetzt werden.

Requests mit einer falschen SenderCompID werden abgelehnt.

Nach einem erfolgreichen Logon werden Requests mit falscher SenderCompID als Attacke gewertet. In diesem Fall wird die Session ausgeloggt.

Ein Anschlussinhaber muss über eine zulässige KV-Nummer (FIX-Zentrale) verfügen, welche für den FIX Anschluss freigegeben sein muss. Sollen über den Anschluss weitere konfigurierte KV-Nummern möglich sein, dann müssen auch diese gültig und für den FIX Anschluss freigegeben sein.

Das BT-FIX Gateway unterstützt die gängigen Retransmit Mechanismen (Duplicate und Resend).

2.4 Zielsysteme

Unterstützt werden die Handelssysteme

- XONTRO
- MAX-ONE
- XETRA (XETR)**
- Xetra Ffm-2 (XFRA)**

** Das XONTRO FIX Orderrouting zu den XETRA Plattformen endet nach Aussagen der Deutsche Börse AG in 2017. Daher werden innerhalb dieser Strukturen keine MiFID II Anpassungen mehr vorgenommen.

Unterstützt werden die Abwicklungssysteme

- INVESTRO / Vestima
-

2.5 Instrumente

Es bestehen keinerlei Einschränkungen hinsichtlich der Instrumente eines Handels- bzw. Abwicklungssystems.

Zur Instrumentidentifikation wird ausschließlich die ISIN verwendet. Alle anderen Möglichkeiten der Identifikation sind ausgeschlossen.

Das mandatory Tag 55 (Symbol) wird vom BT-FIX-Gateway beim Request ignoriert. Bei ausgehenden Nachrichten enthält das Tag 55 "[N/A]" (undefiniert).

Die einzige Ausnahme sind die Nachrichten zu den Schlussnoten-Realtime (UserMessage TradeCaptureReportSno). Bei diesen enthält das Tag 55 ein Börsenkürzel (sofern vorhanden) oder den Wert "[N/A]".

2.6 Konkurrenzen mit anderen Interfaces der Zielsysteme

Der FIX-Zugang und der Systemanschluss Kreditinstitute (SAKI) bieten grundsätzlich die gleiche Funktionalität an. Diese Funktionalität ist in die folgenden Bereiche unterteilt:

- Orderrouting
- OTC- und MiFID-Eingaben
- Bezug von Schlussnoten-Realtime

Die gleichzeitige Verwendung beider Anschlussarten ist generell möglich, jedoch mit folgender Einschränkung: in jedem der genannten Bereiche kann für eine KV-Nummer entweder nur der FIX-Zugang oder nur der SAKI-Zugang benutzt werden. Dies gilt für die Zentralen (bzw. Anschlussinhaber) und für die Filialen.

Beispiel einer möglichen Konfiguration für die KV-Nummer 1766:

- Orderrouting über den SAKI-Anschluss der Zentrale 7066
- OTC- und MiFID-Eingaben über den FIX-Anschluss der Zentrale 3766
- Bezug von Schlussnoten-Realtime über den FIX-Anschluss der Zentrale 3766

Andere Interfaces (z.Bsp: Dialogeingabe XONTRO, VALUES) können uneingeschränkt genutzt werden. Dabei erhält das FIX Interface auch Nachrichten, welche über andere zulässige Wege ausgelöst wurden. Für die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 kann die Möglichkeit der Bearbeitung von Orders über mehrere Interfaces (FIX und das VALUES Interface) durch die Verwendung unterschiedlicher Subgroups weitgehend eingeschränkt werden.

Der Empfang von Broadcastnachrichten über das VALUES Interface kann für ein Member generell nicht eingeschränkt werden.

2.7 Umsetzung der MiFID II Anforderungen

Beginnend mit Version 2.3.2 dieses Dokumentes wurden die Anforderungen des MiFID II Regelwerkes implementiert. In diesem Zusammenhang möchten wir auf die im folgenden genannten Bereiche besonders hinweisen.

2.7.1 Versorgung der MiFID II Datenfelder

Eingabefelder, die in direktem Zusammenhang mit der Umsetzung der MiFID II Regulatorik stehen, sind bei ihrer ersten Erwähnung im Dokument gesondert gekennzeichnet.

Hier ein Beispiel für eine solche Kennzeichnung: „(ESMA RTS24 Feld 3)“

Sollten bei der Verwendung solcher Tags Unklarheiten bestehen, so verweisen wir auf die entsprechenden Dokumentationen der zuständigen Regulierungsbehörde.

2.7.2 Shortcode-Verfahren

Shortcode-Daten dienen der Kapselung im Rahmen der MiFID II an die Handelsplätze zu übermittelnden Identifikationen von Parteien.

Das Shortcode-Verfahren ist innerhalb von XONTRO nur für die Teilnehmer des FIX-Order routings relevant.

Als maßgeblich für die Übergabe der gesichert zu übertragenden Shortcode-Files werden sämtliche Inhalte (gem. MiFID II Vorgaben) der Datenfelder <client identification code>, <investment decision maker> und <Execution within firm> angesehen. Hierbei handelt es sich im Wesentlichen um personenbezogene Legitimationsdaten.

Der Shortcode ist ein numerisches Datenfeld.

Im Regelfall gehen wir von einer täglich einmaligen Datenübertragung aller verwendeten Shortcodes pro Teilnehmer (bzw. pro technischer Zentrale) per Komma separiertem CSV-File(s) mit einer Überschriftenzeile aus.

Die übermittelten Files werden periodisch per Batch-Verarbeitung in die XONTRO Geschäftsvorfalldokumentation übernommen, separat gespeichert und erst auf Anforderung an die CAs übermittelt. Im Rahmen dieses Prozesses erhalten die übermittelnden Institute qualifizierte Antwortfiles.

Teilnehmer des Handelssystems Max-ONE via XONTRO SAKI-FIX versenden ihre Max-ONE Shortcode-Informationen ebenfalls über die XONTRO-Infrastruktur. Dabei können XONTRO und Max-ONE Shortcode-Informationen in einem gemeinsamen File übertragen werden.

Weitere Details zum Shortcode Verfahren können dem XONTRO MiFID Newsletter 03 entnommen werden, dessen Bereitstellung für Ende Juni 2017 geplant ist.

2.8 Order- bzw. Auftrags-Funktionalität

2.8.1 Orderidentifikation

Das BT-FIX Gateway unterstützt zunächst uneingeschränkt den bekannten FIX Chaining Mechanismus mit Hilfe der ClOrdID bzw. der OrigClOrdID, die Eindeutigkeit der ClOrdID während der Lebensdauer einer Order wird vom BT-FIX Gateway geprüft. Ist eine ClOrdID bereits vorhanden, dann wird der Request abgelehnt.

Zur Löschung oder Änderung von Orders bietet das BT-FIX Gateway zusätzlich die folgende Möglichkeit: Ein Cancel oder Cancel/Replace Request kann auch mit Hilfe der Ordernummer des Handelssystems (OrderID) unter explizitem Ausschluss des Chaining Mechanismus (OrigClOrdID wird auf "[N/A]" gesetzt) durchgeführt werden.

Sind die entsprechenden Identifikationsbegriffe bekannt, dann können beide Verfahren der Orderbearbeitung benutzt werden, ohne Rücksicht darauf, über welches Interface eine Order eingestellt oder zuletzt bearbeitet wurde. Im Rahmen des FIX Chainings werden jedoch nur die über das FIX Interface übermittelten Aufträge verwaltet.

Es sei aber darauf hingewiesen, dass eine Identifikation über die OrderID nur bei bestätigten Orders möglich ist (im Gegensatz zum Chaining Mechanismus).

Weitere Identifikationsverfahren werden nicht unterstützt. Eine Identifikation über eine "bankinterne" Ordernummer mit Hilfe des Tags 526 (SecondaryClOrdID) ist nicht möglich.

Es ist nicht beabsichtigt, die Identifikationsverfahren über die Interfaces hinweg zu harmonisieren.

2.8.2 Empfehlungen

Kunden, welche alle angebotenen Interfaces in den zulässigen Kombinationen uneingeschränkt nutzen wollen, wird dringend empfohlen, für ihre Orders eine eigene, eindeutige Schlüsselssystematik vorzusehen. Eine Verwendung der Ordernummern der Handelssysteme ist **auf keinen Fall** sinnvoll. Die Zuordnung des eigenen Schlüssels einer Order zum aktuellen Schlüssel im Zielsystem muss von einem OMS geleistet werden. Bei der Verwendung des FIX Interfaces ist besonders auf eine korrekte Behandlung der folgenden Situationen zu achten:

- Änderungen einer Order – hier kann die Ordernummer des Handelssystems wechseln. Die korrespondierende FIX Nachricht an das OMS **enthält nur die neue Ordernummer** des Handelssystems (Xetra, Xetra Ffm-2).
- Über das FIX Interface ausgelöste Änderungen oder Löschungen einer Order, welche über ein anderes Interface eingestellt wurde. In diesem Fall muss die korrekte, aktuelle Ordernummer des Handelssystems geliefert werden, falls der FIX Request direkt auf die Einstellung folgt.
- Änderungen oder Löschungen einer Order über ein anderes Interface als das FIX Interface. Die korrespondierenden Nachrichten an das OMS liefern keine OrigClOrdID, und in ClOrdID den Wert des letzten erfolgreichen, über das FIX Interface übermittelten Requests. Ein OMS muss also in der Lage sein, eine Order **an Hand der letzten gültigen ClOrdID oder der OrderID** zu identifizieren.

Ein beliebiger Wechsel des Interfaces zur Bearbeitung einer Order führt zu einer Beeinträchtigung des Chaining Mechanismus und dazu, dass ein OMS ständig dynamisch das Identifikationsverfahren für eine Order wechseln muss.

Es wird deshalb empfohlen, ein Verfahren als das führende festzulegen und den Verfahrenswechsel auf Notfälle zu beschränken.

2.8.3 INVESTRO / Vestima

Die Auftragsverarbeitung an INVESTRO und Vestima wird über die bestehenden Nachrichtenflows und Abläufe für das Orderrouting an die unterstützten Handelssysteme abgebildet.

Bezüglich der Eindeutigkeit der ClOrdID eines Auftrages (vgl. Kap. 2.8.1 Orderidentifikation) gilt für INVESTRO/Vestima die Besonderheit, dass eine ClOrdID auch nach erfolgter Ausführung oder Löschung des Auftrags noch bis zu weiteren 10 Handelstagen eindeutig bleiben muss. Dies liegt an der Möglichkeit der Stornierung einer Ausführung durch Vestima.

Die Besonderheiten von Vestima werden über vorhandene Nachrichten abgebildet:

- Informationen über den Status eines Auftrags

Die formal richtige Nachricht wird dem FIX-Teilnehmer als ExecutionReport mit Pending-Reason 5 (verification pending) - als vorläufige Bestätigung - gemeldet. In der Nachricht wird eine genauere Information über den Auftragsstatus über die Tags 5048 (OrdSubStatus) und 5476 (PrivateReference) geliefert.

Wenn der Auftragsempfänger in Vestima den Auftrag bestätigt, dann erhält der FIX-Teilnehmer die Auftragsstatus-Änderung "endgültig" als ExecutionReport.

Details siehe im Kapitel „7.3.2 Auftragsrouting an INVESTRO mit Vestima-Gattungen“.

- Auftragsausführung (MT515)

Aus einer MT515-Nachricht (Confirmation) von Vestima wird ein ExecutionReport mit Tag 150 (ExecType) = F (Trade) und Tag 39 (OrdStatus) = 2 (filled) generiert.

Abwicklungsdaten, die von Vestima im MT515 geliefert werden, werden in diesen ExecutionReports nicht weitergegeben. Diese Daten können, je nach Teilnehmerkonfiguration, durch die Schlussnoten Nachrichten (TradeCaptureReportSno) bezogen werden.

- Stornierung einer Auftragsausführung (MT515 CANCEL)

Aus dieser Nachricht wird ein ExecutionReport mit Tag 150 (ExecType) = D (Restated), Tag 39 (OrdStatus) = 2 (filled), Tag 5048 (OrdSubStatus) = H (disabled) und Tag 11 (ClOrdID) = [N/A] generiert.

- Auftragsausführung nach MT515 CANCEL

Aus dieser Nachricht wird ein ExecutionReport mit Tag 150 (ExecType) = D (Restated), Tag 39 (OrdStatus) = 2 (filled) und Tag 11 (ClOrdID) = [N/A] generiert.

2.8.4 Besonderheiten bei der Behandlung bestimmter Requests

Es sei ausdrücklich auf die Besonderheiten des Cancel Requests hingewiesen, der einen zweiten Ordertyp erfordert (Tag 5253).

2.9 Trade-Funktionalität

2.9.1 Unterstützte Nachrichten

Folgende Trade-Nachrichten werden unterstützt:

- TradeCaptureReport Request: OTC- und MiFID Funktionalität
- TradeCaptureReportAck Response auf ein TradeCaptureReport
- TradeCaptureReportSno Information zu einer Schlussnote

Folgende FIX-Tags werden als Identifikationskriterien der unterstützten Nachrichten verwendet:

- Funktionalität (OTC, MiFID, SNO)
 - 6556 BusinessTransactionType
 - 487 TradeReportTransType
 - 856 TradeReportType
- Identifikation eines Geschäfts bzw. eines Reports
 - 880 TrdMatchID
 - 6555 OrigTrdMatchID
- Weitere Identifikationskriterien
 - 571 TradeReportID
 - 572 TradeReportRefID
 - 150 ExecType

Details in den Kapiteln zu „7.5 Tradefunktionalität“

2.9.2 Tradeidentifikation

Jede Nachricht enthält das Feld TradeReportID (Tag 571) als eindeutigen Identifier. Nachrichten, die eine vorherige Aktion referenzieren, enthalten zusätzlich das Feld TradeReportRefID (Tag 572).

Über diese Felder gibt es im BT-FIX Gateway keinen Chaining Mechanismus. Im BT-FIX Gateway findet keine Prüfung auf Eindeutigkeit für das Feld TradeReportID statt. Es wird auch nicht geprüft, ob die TradeReportRefID eine vorhandene, bereits gelieferte, TradeReportID enthält.

Die Eindeutigkeit bzw. Richtigkeit dieser Felder in den Request-Nachrichten muss vom Client sichergestellt werden.

In einer Response-Nachricht werden die Felder TradeReportID und TradeReportRefID (sofern vorhanden) mit dem Inhalt aus der Request-Nachricht versorgt.

Im TradeCaptureReportSno wird von XONTRO eine eindeutige TradeReportID generiert.

Als Schlüsselfelder für die Identifikation der Trade-Nachrichten werden im BT-FIX Gateway ausschließlich die in XONTRO vergebenen Report- bzw. Geschäftsnummern verwendet. Diese werden in den Feldern TrdMatchID (Tag 880) und OrigTrdMatchID (Tag 6555) übermittelt.

2.10 Reject Verhalten

Kann das BT-FIX Gateway einen von einem OMS gestellten Request nicht in einen Auftrag an ein Handels- bzw. Abwicklungssystem umsetzen (wegen formaler Fehler oder Inkonsistenzen der Nachrichteninhalte), dann erfolgt immer ein Reject auf Session Level (MsgType 3).

Dies gilt für

- fehlende mandatory oder conditional Mandatory Tags
- nicht zulässige Tags
- ungültige Werte von Tags
- ungültige Kombinationen von Werten

Bei Unterschieden zwischen RoE und den Standard FIX Definitionen gelten die Festlegungen der RoE.

Fehler, die ein Handels- bzw. Abwicklungssystem erkennt, werden über einen Execution Report, Cancel Reject oder einen Business Message Reject mitgeteilt.

Ist ein Handels- bzw. Abwicklungssystem nicht verfügbar, dann liefert das BT-FIX Gateway einen Business Message Reject mit Reason Code 4 ("Application not available").

Business Message Reject und **Reject** Nachrichten werden im Kapitel 6 FIX-Nachrichten vom Typ Reject und Business Message Reject beschrieben. Sie können als negative Antworten auf **jeden Request** versendet werden. Clients und Order Management Systeme müssen eine entsprechende Verarbeitung vorsehen.

2.11 Verhalten bei ResendRequest

Ist in den vom OMS gesendeten Requests eine Lücke in der Sequenznummer (MsgSeqNum) entstanden, dann fordert das BT-FIX Gateway die fehlenden Sequenznummern mit einem ResendRequest an. Die Lücke muss dann umgehend vom OMS geschlossen werden.

Werden stattdessen mehr als 500 weitere Requests gesendet, ohne die Lücke zu schliessen, so erfolgt ein automatischer Logout durch das BT-FIX Gateway. Alle Requests nach der Lücke werden dadurch verworfen.

2.12 Inbetriebnahme

Eine erfolgreiche Teilnahme an der Simulation ist Voraussetzung für die Aufnahme des produktiven Betriebs.

FAGSE

BT-FIX Gateway

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 16 von 139

3 Leistungsmerkmale

3.1 Eingehende und Ausgehende Nachrichten

Der Begriff "eingehende Nachricht" (Request) wird für alle Nachrichten vom Kundensystem (OMS) zum Handels- bzw. Abwicklungssystem verwendet. Diese Festlegung wird auch für Nachrichten verwendet, bei welchen nicht die gesamte Übertragungstrecke durchlaufen wird.

Übertragungstrecke für eingehende Nachrichten:

OMS → FIX Engine (Kunde) → BT-FIX Gateway → Handels- bzw. Abwicklungssystem

Der Begriff "ausgehende Nachricht" (Response, Broadcast) wird für alle Nachrichten vom Handels- bzw. Abwicklungssystem zum Kundensystem (OMS) verwendet.

Übertragungstrecke für ausgehende Nachrichten:

Handels- bzw. Abwicklungssystem → BT-FIX Gateway → FIX Engine (Kunde) → OMS

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 17 von 139

3.2 Szenarien und Nachrichten des Sessionlevels**3.2.1 Verarbeitung FIX-Requests**

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten
Technische Requests		
Anmeldung	Logon	Logon (positiv) Logon + Logout (negativ)
Anmeldung mit gleichzeitiger Passwortänderung	Logon	Logon (positiv) Logon + Logout (negativ)
Abmeldung	Logout	Logout
Passwortänderung	User Request (4.4) Benutzerdefinierter User Request (4.2)	User Response (4.4) Benutzerdefinierte User Response (4.2)
Allgemeine Ablehnungen (möglich für jeden Request)		
Session Level Reject	jede Request-Nachricht	Reject
Allgemeine Ablehnung durch ein Handels- bzw. Abwicklungssystem oder das BT- FIX Gateway	jede Request-Nachricht	Business Message Reject

3.2.2 Systemgenerierte Nachrichten

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten
System Shutdown		
Abmeldung	-	Logout
Statusnachrichten	-	News "End-of-Day Processing" "End-of-Day Cut-off"
Technische Nachrichten		
Prüfen der physischen Verbindung	-	Heartbeat
Anforderung eines Heartbeats	-	TestRequest
Anforderung von Nachrichten	-	Resend Request

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 18 von 139

3.3 Szenarien und Nachrichten des Applikationslevels**3.3.1 Verarbeitung FIX-Requests**

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten
Orderfunktionalität, Auftragsverarbeitung		
Ordereingang	New Order Single	Execution Report
Orderlöschung	Order Cancel	Execution Report (positiv, vorläufig) Order Cancel Reject (negativ)
Orderänderung	Order Cancel/Replace	Execution Report (positiv, vorläufig) Order Cancel Reject (negativ)
Auftragseingang	New Order Single	Execution Report
Auftragslöschung	Order Cancel	Execution Report (positiv) Order Cancel Reject (negativ)
Auftragsänderung	Order Cancel/Replace	Order Cancel Reject (negativ)
Tradefunktionalität		
OTC-Geschäftseingang	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck
OTC-Geschäftsstorno	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck
OTC-Geschäftsdurchlieferung	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck
MiFID-Report-Eingang	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck
MiFID-Report-Storno	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 19 von 139

3.3.2 Externe Eingaben / systemgenerierte Nachrichten

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten
Orderfunktionalität, Auftragsverarbeitung		
Ordereingang	-	Execution Report
Orderlöschung	-	Execution Report (positiv, vorläufig) Order Cancel Reject (negativ)
Orderänderung	-	Execution Report (positiv, vorläufig) Order Cancel Reject (negativ)
Orderausführung	-	Execution Report
Auftragseingang	-	Execution Report
Auftragslöschung	-	Execution Report (positive, vorläufig) Order Cancel Reject (negativ)
Auftragsausführung	-	Execution Report
Nachrichten an den Auftragsempfänger	-	Execution Report
Statusänderungen eines Auftrags (nur Vestima)	-	Execution Report
Storno einer Auftragsausführung (nur Vestima)	-	Execution Report
Tradefunktionalität		
Geschäftsinformationen (Schlussnoten-Realtime)	-	TradeCaptureReportSno
Ereignisse		
Ereignismitteilung	-	News

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 20 von 139

3.4 Unterschiede zwischen FIX 4.2 und FIX 4.4

Die vorliegenden RoE beschreiben die Anforderungen an FIX Version 4.4. Die relevanten Unterschiede zu FIX Version 4.2, die durch das BT-FIX Gateway ebenfalls unterstützt wird, betreffen die Orderstatusverwaltung, das Konzept des "Parties Component Blocks", die Nachrichten zur Passwortänderung und die Trade-Nachrichten.

3.4.1 Orderrouting

Handelt es sich bei einer Session um eine Verbindung der Version 4.2, wird zusätzlich das Feld ExecTransType (Tag 20) in einem Execution Report geliefert. Dieses Tag wird immer mit dem Wert 0 ("New") belegt.

Die Verwaltung der beteiligten Parteien über den Parties Component Block ist in einer Session der Protokollversion 4.2 nicht möglich. Der Component Block entfällt, die Repeating Groups werden in den Nachrichten wie folgt ersetzt³:

<parties>	Tag 4.2	Feldname	Kommentare
<entering firm>	6031	EnteringFirm	String(4), KVNr des Anschlussinhabers
<executing firm>	76	ExecBroker	String(4), zugelassene KVNr des Orderaufgebers
<market maker>	9318	MktMkerID	String(4), KVNr des Maklers
<systematic internaliser>	9318	MktMkerID	String(5), Xetra MemberID
<session>	5177	Source	String, KVNr bzw. MemberID des Eingebers von einem anderen Interface
<executing system>	7931	VenueID	String, folgende Belegung ist möglich: "XETRA" "XETRA-2" "XONTRO" "MAX-ONE" "INVESTRO"
<intermediary>	109	ClientID	String(10) numerisch, INVESTRO-Vertriebspartner
<client identification code>	20003	PartyIDClientID	String(20), Shortcode. (ESMA RTS24 Feld 3) Spezielle Werte: 1 = AGGR 2 = PNAL
	21103	PartyIDClientIDQualifier	Integer Tag wird ignoriert. Der Qualifier zur ClientID sagt aus, ob der angegebene Shortcode im Tag 20003 ein LEI oder eine natürliche Person repräsentiert. 23 = LEI (Legal Entity Identifier) 24 = Nat. Person
	21303	PartyIDClientIDSource	Char Klassifizierung des Tag 20003. P = Shortcode Die Angabe von Tag 21303 ist nicht notwendig.
<investment decision maker>	20122	PartyIDInvestmentDecision Maker	String(20), Shortcode oder Algorithmus. (ESMA RTS24 Feld 4)

³ Die in spitzen Klammern angegebenen Namen sind die in diesem Dokument verwendeten Bezeichner der Occurrences des <parties> Component Block, **keine** FIX Feldnamen.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 21 von 139

<parties>	Tag 4.2	Feldname	Kommentare
	21222	PartyIDInvestmentDecisionMakerQualifier	Integer Der Qualifier zum InvestmentDecisionMaker sagt aus, ob es sich bei der PartyID im Tag 20122 um einen Algorithmus oder um den Shortcode für eine natürliche Person handelt. 22 = Algorithmus 24 = Shortcode für nat. Person Fehlt Tag 21222, wird von einem Shortcode ausgegangen.
	21422	PartyIDInvestmentDecisionMakerSource	Char Klassifizierung des Tag 20122. P = Shortcode, oder in Verbindung mit Tag 21222 auch Algorithmus. Die Angabe von Tag 21422 ist nicht notwendig.
<Execution within firm>	20012	PartyIDExecutingTrader	String(20), Shortcode oder Algorithmus. (ESMA RTS24 Feld 5) Spezielle Werte: 3 = NORE
	21112	PartyIDExecutingTraderQualifier	Der Qualifier zum ExecutingTrader sagt aus, ob es sich bei der PartyID im Tag 20012 um einen Algorithmus oder um den Shortcode für eine natürliche Person handelt. 22 = Algorithmus 24 = Shortcode für nat. Person Fehlt Tag 21112, wird von einem Shortcode ausgegangen.
	21312	PartyIDExecutingTraderSource	Char Klassifizierung des Tag 20012. P = Shortcode, oder in Verbindung mit Tag 21112 auch Algorithmus. Die Angabe von Tag 21312 ist nicht notwendig.

Konflikte bei der Verwendung des Tags 9318 können nicht auftreten. Bei keinem der Zielsysteme können beide Parteien gleichzeitig vorhanden sein.

3.4.2 Passwortänderung

Die für eine Passwortänderung erforderlichen Nachrichten der MsgTypes "BE" - User Request - und "BF" - User Response - sind in Version 4.2 nicht definiert. Bei unveränderter Nachrichtenstruktur wird "BE" durch "UBE" und "BF" durch "UBF" ersetzt.

Soll die Version 4.2 benutzt werden, dann ist darauf zu achten, dass der Standardumfang der in 4.2 definierten Tags um die aus den Folgeversionen entnommenen zusätzlichen Standardtags erweitert werden muss, siehe: Anhang D: Erweiterungen des 4.2 Sprachumfangs.

3.4.3 Trade-Nachrichten

Die MsgTypes "AE" - TradeCaptureReport und "AR" - TradeCaptureReportAck sind in Version 4.2 nicht definiert. Bei unveränderter Nachrichtenstruktur wird "AE" durch "UAE" und "AR" durch "UAR" ersetzt. Innerhalb der userdefinierten TradeCaptureReport-Nachricht und TradeCaptureReportSno-Nachricht werden die Party-Repeating Groups nicht mehr, wie oben beschrieben, ersetzt.

FAGSE

BT-FIX Gateway

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 22 von 139

4 FIX-Nachrichten, Detailbeschreibung zu Header/Trailer

4.1 Erläuterungen FIX Header/Trailer

Legende **FIX Header/Trailer**

Sortierung: FIX Header und Trailer enthalten Felder, die eine feste Position am Anfang oder Ende einnehmen müssen und solche, die an einer beliebigen, sonstigen Stelle im Header/Trailer stehen können. Felder, die eine feste Position einnehmen müssen, sind in der Tabelle grau hinterlegt und stehen an der Position, die sie auch in der Nachrichtenstruktur einnehmen müssen. Alle anderen Felder sind nach Tags aufsteigend sortiert.

Spalten: RF (required FIX) und R (required) enthält eine der Angaben Mandatory/Optional, alle anderen Überschriften sind selbsterklärend.

Inhalte: Das Feld "**Kommentare**" enthält zunächst das FIX Format des Feldes, dann eine Feldbeschreibung und eine Beschreibung von Restriktionen, Angaben zu Länge und Position etc. Entscheidend für die Behandlung eines Tags ist der Eintrag in der Spalte "R".

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 23 von 139

4.2 FIX Header <standard message header>**Eingehende Nachrichten**

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
8	BeginString	M	M	String Kennzeichnung der FIX Version muss immer = "FIX.4.4" oder "FIX.4.2" sein feste Feldposition (1)
9	BodyLength	M	M	Length Nachrichtenlänge feste Feldposition (2)
35	MsgType	M	M	String Typ der Nachricht feste Feldposition (3) nur die vom BT-FIX Gateway definierten Typen sind zulässig
34	MsgSeqNum	M	M	SeqNum Folgenummer der Nachricht, vom sendenden System vergeben, lückenlos pro Session, Startwert = "1". Die Sequenznummer der FIX Engine wird innerhalb eines Tages hochgezählt, unabhängig davon, wie oft eine Session beendet und wieder aufgebaut wurde. Am nächsten Tag startet die Sequenznummer wieder mit "1"
43	PossDupFlag	O	O	Boolean Wird bei einer Retransmission mit identischer Folgenummer von der Engine auf "Y" gesetzt
49	SenderCompID	M	M	String Identifikation des sendenden Systems. Ist zwischen dem Eigentümer des Systems und der BrainTrade GmbH zu vereinbaren. Werden von einem Eigentümer mehrere Systeme betrieben, dann können diese nicht gleichzeitig aktiv sein Das Tag SenderCompID muss auf allen Systemen identisch belegt werden
52	SendingTime	M	M	UTCTimestamp
56	TargetCompID	M	M	String Identifikation des empfangenden Systems. Wird von der BrainTrade GmbH festgelegt
97	PossResend	O	O	Boolean Die sendende Applikation zeigt bei auf „Y“ gesetztem Flag an, dass die Nachricht ggf. mit anderer Sequenznummer schon einmal übertragen wurde. Muss von Applikation überprüft werden. Diese Funktionalität wird nicht in vollem Umfang unterstützt: Das BT-FIX-Gateway erlaubt das PossResend nur für NewOrderSingle. Wenn der Request mit derselben ClOrderID bereits einmal empfangen wurde, dann wird der bereits versendete ExecutionReport bzw. Reject nochmals an den Client übertragen, ansonsten wird der Request nicht verarbeitet, sondern mit einem Reject beantwortet.
122	OrigSendingTime	O	O	UTCTimestamp Bei Antworten auf einen Resend Request des BT-FIX Gateway: Timestamp der Originalnachricht Aus Kompatibilitätsgründen aufgenommen Das Tag wird ignoriert
369	LastMsgSeqNumProcessed	O	O	SeqNum Letzte vom sendenden System verarbeitete Folgenummer

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 24 von 139

Ausgehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
8	BeginString	M	M	String Kennzeichnung der FIX Version immer = "FIX.4.4" oder "FIX.4.2" feste Feldposition (1)
9	BodyLength	M	M	Length Nachrichtenlänge feste Feldposition (2)
35	MsgType	M	M	String Typ der Nachricht feste Feldposition (3) nur die vom BT-FIX Gateway definierten Typen sind zulässig
34	MsgSeqNum	M	M	SeqNum Folgenummer der Nachricht, vom sendenden System vergeben, lückenlos pro Session, Startwert = 1
43	PossDupFlag	O	O	Boolean Wird bei einer Retransmission mit gleicher Folgenummer auf "Y" gesetzt, wird bei einer Antwort auf einen Resend Request immer gesetzt
49	SenderCompID	M	M	Identifikation des empfangenden Systems. Wird von der BrainTrade GmbH festgelegt
52	SendingTime	M	M	UTCTimestamp
56	TargetCompID	M	M	Identifikation des sendenden Systems. Ist zwischen dem Eigentümer des Systems und der BrainTrade GmbH zu vereinbaren
97	PossResend	O	O	Boolean Das BT-FIX Gateway zeigt bei auf „Y“ gesetztem Flag an, dass die Nachricht ggf. mit anderer Sequenznummer schon einmal übertragen wurde. Das Feld muss von der empfangenden Applikation überprüft werden
122	OrigSendingTime	O	O	UTCTimestamp Bei Antworten auf einen Resend Request des Clients: Timestamp der Originalnachricht

4.3 FIX Trailer <standard message trailer>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
10	Checksum	M	M	3 Byte Checksum feste Feldposition (letztes Feld)

5 FIX-Nachrichten des Sessionlevels

5.1 Erläuterungen FIX Datenteil

Spalten: RF (required FIX) und R (required) enthalten eine der Angaben Mandatory/Optional, XEOMI die Angaben Mandatory/Optional/Conditional/Not allowed für die Handels- bzw. Abwicklungssysteme Xetra⁴/XEtra Ffm-2⁵/XONTRO/MAX-ONE/INVESTRO.

Inhalte: In den Spalten **R/RF** werden M/C nur vergeben, wenn das Tag für alle Zielsysteme mandatory/conditional mandatory ist. In **XEOMI** findet sich dann kein Eintrag.

Das Feld "**Kommentar**" enthält zunächst das FIX Format des Feldes. Es folgen eine Feldbeschreibung und eine Beschreibung von Restriktionen, Angaben zu Länge und Position etc.

Eine Bezeichnung Integer(5) bedeutet, dass nach dem Entfernen führender Nullen maximal fünf signifikante Stellen zulässig sind, eine Bezeichnung Float(10,3) heißt, dass nach dem Entfernen führender Nullen maximal zehn signifikante Stellen, davon 3 Nachkommastellen vorkommen dürfen. Es handelt sich hierbei lediglich um eine verkürzte Beschreibung der für dieses BT-FIX Gateway zulässigen Formate, **nicht** um FIX Konventionen.

⁴ vgl. hierzu bitte auch Abschnitt 2.4 Zielsysteme

⁵ vgl. hierzu bitte auch Abschnitt 2.4 Zielsysteme

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 26 von 139

5.2 Logon / Logon mit gleichzeitiger Passwortänderung

Ein Logon Request (ggf. mit gleichzeitiger Passwortänderung) wird in allen Fällen zunächst von der FIX Engine des BT-FIX Gateway mit einer Logon Nachricht beantwortet. Wird der Request nicht akzeptiert, dann erhält der Teilnehmer eine zusätzliche Logout Nachricht.

Logon Request

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "A" (MsgType)
98	EncryptMethod	M	M		Integer Verschlüsselungsmethode muss auf 0 = "keine" gesetzt sein
108	HeartBtInt	M	M		Integer Heartbeatintervall wird gegen den im BT-FIX Gateway konfigurierten Wert geprüft
141	ResetSeqNumFlag	O	O	00000	Boolean Anforderung zum Zurücksetzen der Sequence Number
383	MaxMessageSize	O	O	00000	Length Maximale Nachrichtenlänge (Empfang) wird nicht ausgewertet
553	Username	O	M		siehe PartyID in <entering Firm> userID Es werden nur numerische Werte akzeptiert
554	Password	O	M		String(8) Passwort
789	NextExpectedMsgSeqNum	O	O	00000	SeqNum Nächste erwartete Sequence Number wird nicht ausgewertet reserviert für zukünftige Erweiterungen
925	NewPassword	O	O	00000	String(8) Passwort neu wenn das NewPassword vorhanden ist wird ein Logon mit gleichzeitiger Passwortänderung durchgeführt
	<standard message trailer>	M	M		

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 27 von 139

Logon Response

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "A" (MsgType)
98	EncryptMethod	M	M		Integer Verschlüsselungsmethode immer auf 0 = "keine" gesetzt
108	HeartBtInt	M	M		Integer Heartbeatintervall wird gegen den im BT-FIX Gateway konfigurierten Wert geprüft
141	ResetSeqNumFlag	O	O	00000	Boolean Anforderung zum Zurücksetzen der Sequence Number
383	MaxMessageSize	O	O	00000	Length Maximale Nachrichtenlänge (Empfang)
553	Username	O	O	00000	String(10) userID Das Tag ist zur Zeit nie belegt
789	NextExpectedMsgSeqNum	O	O	00000	SeqNum Nächste Erwartete Sequence Number wird nicht belegt reserviert für zukünftige Erweiterungen
	<standard message trailer>	M	M		

Bei Ablehnung eines Logon wird zusätzlich die folgende Nachricht versendet. SessionStatus muss nicht in allen Fällen belegt sein.

Logout Response

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "5" (MsgType)
58	Text		O	00000	String Fehlertext
1409	SessionStatus		O	00000	Integer Errorcode 5 = "Invalid username or password" 7 = "Logons are not allowed at this time" 8 = "Password expired"
	<standard message trailer>	M	M		

Wird ein Logon mit "Password expired" abgelehnt, dann ist ein Logon mit Passwortänderung erforderlich. Im Logon Request ist das Tag 554 (altes Passwort) und das Tag 925 (NewPassword) zu liefern.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 28 von 139

5.3 Passwortänderung

Dieser Request erfordert eine bestehende Session. Er kann also **bei einem abgelaufenen Passwort nicht verwendet werden.**

User Request

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "BE" (MsgType)
553	Username	M	M		String userID
554	Password	O	M		String(8) Passwort
923	UserRequestID	M	M		String(16) Eindeutiger Schlüssel
924	UserRequestType	M	M		Integer Requesttyp muss auf 3 = "Passwortänderung" gesetzt sein
925	NewPassword	O	M		String(8) Passwort neu
	<standard message trailer>	M	M		

User Response

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "BF" (MsgType)
553	Username	M	M		String userID
923	UserRequestID	M	M		String(16) Eindeutiger Schlüssel
926	UserStatus	O	M		Integer User Status Passwortänderung erfolgreich 5 = "Passwortänderung erfolgreich" Passwortänderung abgelehnt 2 = "Nicht eingeloggt" 3 = "User nicht erkannt" 4 = "Passwort fehlerhaft" 6 = "sonstige" Weitere Information wird bei Ablehnungen im Tag 927 geliefert
927	UserStatusText	O	O	OOOOO	String Passwortänderung erfolgreich das Tag wird nicht geliefert Passwortänderung abgelehnt erläuternder Text zu 926
	<standard message trailer>	M	M		

5.4 Logout

Logout Request

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "5" (MsgType)
	<standard message trailer>	M	M		

Logout Response

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "5" (MsgType)
58	Text		O	OOOOO	String erläuternder Text zur Abmeldung
	<standard message trailer>	M	M		

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 30 von 139

5.5 System Shutdown

Der System Shutdown wird durch eine News Nachricht mit Status "002" = "End of Business Day" eingeleitet. Eingehende Requests werden ab diesem Zeitpunkt abgelehnt, noch auf ihre Auslieferung wartende Nachrichten werden ausgeliefert. Die beteiligten Handels- bzw. Abwicklungssysteme erzeugen möglicherweise auch noch weitere Nachrichten. Sobald auch dieser Prozess beendet ist, erhält der Kunde eine News Nachricht mit Status "003" = "End of Business Day Cut-Off" und - mit geringem zeitlichem Abstand - eine Logout Nachricht. Danach wird in jedem Fall die Verbindung abgebaut.

Nr.	System shutdown	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handels- bzw. Abwicklungssystem
1	news ("2", "End of Business Day")		←●	
	<i>weitere Requests vom Client</i>			
2	NewOrderSingle	●→		
	<i>Ablehnung auf Requests nach "End of Business Day"</i>			
3	Business Message Reject (4)		←●	
	<i>Nachrichten vom System werden noch geliefert</i>			
4	Execution Report ("Trade", "Partially filled")		←●	←●
5	News ("3", "End of Business Day Cut-Off")		←●	
6	Logout		←●	
7	Logout	-	-	-
8	Verbindungsabbau	●→	←●	

News Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "B" (MsgType)
33	LinesOfText		M		NumInGroup Anzahl Zeilen mit "1" belegt
58	Text		M		String Text der News Messages End of Business Day "End of Day Processing – No more Input messages" End of Business Day Cut-Off "End of Business Day Cut-Off, System unavailable"
148	Headline		M		String Message Status "002" = End of Business Day "003" = End of Business Day Cut-Off
	<standard message trailer>	M	M		

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 31 von 139

6 FIX-Nachrichten vom Typ Reject und Business Message Reject

Beschrieben werden im Folgenden lediglich die Datenteile. Beide Nachrichtentypen besitzen weder Party- noch Instrumentinformationen.

Reject (MsgType = 3)

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
45	RefSeqNum	M	M		SeqNum Sequenznummer des abgelehnten Requests
58	Text	O	O	00000	String Fehlertext
371	RefTagID	O	M		Integer Tag auf das sich die Fehlermeldung bezieht
372	RefMsgType	O	M		String MsgType der abgelehnten Nachricht
373	SessionRejectReason	O	O	00000	Integer Grund der Ablehnung
5555	ReturnCode		O	00000	Integer Returncode
9803	TradingSystemID		O	00000	Integer Identifiziert das System, das die Ablehnung erzeugt hat

Wird ein Standardcode in Tag 373 (SessionRejectReason) vergeben, dann kann Tag 58 (Text) belegt sein. Kann kein Standardcode vergeben werden, dann sind die Tags 5555 (ReturnCode), 9803 (TradingSystemID) und 58 (Text) belegt, **Tag 373 (SessionRejectReason) fehlt**. Referenziert wird in Tag 371 (RefTagID) das fehlerhafte Tag, bei Prüfungen eines Zusammenhangs das Tag, welches fehlt oder nicht zulässig ist.

Business Message Reject (MsgType = j)

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
45	RefSeqNum	O	M		SeqNum Sequenznummer des abgelehnten Requests
58	Text	O	O	00000	String Fehlertext
372	RefMsgType	M	M		String MsgType der abgelehnten Nachricht
380	BusinessRejectReason	M	M		Integer Grund der Ablehnung
5555	ReturnCode		O	00000	Integer Returncode
9803	TradingSystemID		O	00000	Integer Identifiziert das System, das die Ablehnung erzeugt hat

Wird ein Standardcode in Tag 380 (BusinessRejectReason) vergeben, dann kann Tag 58 (Text) belegt sein. Kann kein Standardcode vergeben werden, dann sind die Tags 5555 (ReturnCode), 9803 (TradingSystemID) und 58 (Text) belegt, **Tag 380 (BusinessRejectReason) wird auf "0" gesetzt**.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 32 von 139

7 FIX-Nachrichten des Applicationlevels**7.1 Erläuterungen FIX Datenteil**

<u>Sortierung:</u>	Die Elemente des <instrument> Component Blocks können in beliebiger Reihenfolge übermittelt werden. Sie müssen nicht aufeinander folgen. Für die vom BT-FIX Gateway versendeten Nachrichten gilt das Gleiche. Repeating Groups enthalten Felder, die eine feste Position am Anfang einnehmen müssen und solche, die an einer beliebigen, sonstigen Stelle in der Repeating Group stehen können. Eine Repeating Group beginnt immer mit dem Tag, welches die Anzahl der Gruppen enthält, danach folgt das 1. Tag innerhalb dieser Gruppe. Felder, die eine feste Position einnehmen, sind in der Tabelle grau hinterlegt und stehen an der Position, die sie auch in der Repeating Group einnehmen müssen. Alle anderen Felder sind nach Tags aufsteigend sortiert, können jedoch in beliebiger Reihenfolge übermittelt werden. Für die vom BT-FIX-Gateway erstellten Repeating Groups gilt das Gleiche.
<u>Spalten:</u>	RF (required FIX) und R (required) enthalten eine der Angaben M andatory/ O ptional/ C onditional, XEOMI die Angaben M andatory/ O ptional/ C onditional/ N ot allowed für die Handels- bzw. Abwicklungssysteme X etra/ XE tra Ffm-2/ XO NTRO/ M AX-ONE/ I NVESTRO: Bei einem Order-Cancel-/Replace Request werden auch die Werte A enderbar/ U nverändert verwendet. EnterOTC, DeleteOTC, ReverseOTC, EnterMIFID, DeleteMifid enthalten M andatory/ O ptional/ C onditional/ N ot allowed/ I gnoriert für die Request-Vorfälle Einstellung, Storno, Durchlieferung OTC-Geschäfte und Einstellung, Storno MiFID-Reports. Alle anderen Überschriften sind selbsterklärend. Bei INVESTRO wird in bestimmten Fällen die Spalte mit "-" angegeben, als Hinweis dass die beschriebene Aktion für INVESTRO nicht relevant (nicht möglich) ist, z.B. Auftragsänderung.
<u>Inhalte:</u>	In den Spalten R/RF werden M/C nur vergeben, wenn das Tag für alle Zielsysteme mandatory/conditional mandatory ist. In XEOMI findet sich dann kein Eintrag. Handelt es sich um ein Feld einer Repeating Group oder eines Component Blocks, dann bedeutet der Eintrag "M", dass das Feld innerhalb der übergeordneten Struktur mandatory ist. Die entsprechende Eigenschaft hinsichtlich der Nachricht findet sich dann bei der Struktur. Ist ein Tag in einem Zielsystem mandatory, in einem anderen nicht wird insgesamt der Code "O" vergeben. Mit dem Code "C" werden alle Felder gekennzeichnet, die von einem anderen Feld abhängig sind. Beispiel: StopPx hängt von OrdType ab. In diesem Fall erhält StopPx den Code "C". Das Feld " Kommentar " enthält zunächst das FIX Format des Feldes. Es folgen eine Feldbeschreibung und eine Beschreibung von Restriktionen, Angaben zu Länge und Position etc. Eine Bezeichnung Integer(5) bedeutet, dass nach dem Entfernen führender Nullen maximal fünf signifikante Stellen zulässig sind, eine Bezeichnung Float(10,3) heißt, dass nach dem Entfernen führender Nullen maximal zehn signifikante Stellen, davon 3 Nachkommastellen vorkommen dürfen. Es handelt sich hierbei lediglich um eine verkürzte Beschreibung der für dieses BT-FIX Gateway zulässigen Formate, nicht um FIX Konventionen.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 33 von 139

7.2 Orderfunktionalität**7.2.1 Order- bzw. Auftragseinstellung****7.2.1.1 Abläufe – Orders**

Nr.	Ordereinstellung positiv	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	new order single			
2	<i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i> execution report ("Pending New", "Pending New")			
3	<i>endgültige Bestätigung positiv</i> execution report ("New", "New")			

Nr.	Ordereinstellung negativ	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	new order single			
2	<i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i> execution report ("Pending New", "Pending New")			
3	<i>endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)</i> execution report ("Rejected", "Rejected")			

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 34 von 139

Nr.	Ordereinstellung ohne endgültige Bestätigung	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	new order single			
2	<i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i> execution report ("Pending New", "Pending New")			
3	<i>Tagesende: vorläufige Bestätigung mit PendingReason 4 = "order status unknown (end of day)"</i> execution report ("Pending New", "Pending New")			

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 35 von 139

7.2.1.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)INVESTRO "classic"

Nr.	Auftragseinstellung positiv	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	INVESTRO
1	new order single			
2	<i>endgültige Bestätigung positiv</i> execution report ("New", "New")			
3	<i>Nachricht an den Auftragsempfänger</i> execution report ("Order Status", "New")			

Nr.	Auftragseinstellung negativ	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	INVESTRO
1	new order single			
2	<i>endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation</i> <i>(Tags 5555, 9320, 9803)</i> execution report ("Rejected", "Rejected")			

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 36 von 139

INVESTRO/Vestima

Nr.	positive Auftragseinstellung an INVESTRO/Vestima	messageflow			
		FE Customer	BT FIX Gateway	INVESTRO	Vestima
1	new order single				MT502
2	<i>Annahmebestätigung INVESTRO</i> execution report ("Pending New", "Pending New")				
3	<i>Annahmebestätigung Vestima</i> execution report ("Pending New", "Pending New")			MT509 	
4	<i>optional Provision check</i> execution report ("Pending New", "Pending New")			MT509 	
5	<i>optional, wenn OHA den Auftrag endgültig bestätigt</i> execution report ("New", "New")			MT 509 	

Anmerkungen:

Nr. 1-4: Nach jeder vorläufigen Bestätigung (pending new) kann noch eine Ablehnung (Rejection) des Auftrages erfolgen.

Exkurs Provision Check:

In Vestima gibt es zwei Varianten, die für den INVESTRO Teilnehmer konfiguriert werden können:

Variante 1: Wird bei der Prüfung auf Kontodeckung (redemption check) festgestellt, dass keine Deckung vorhanden ist, wird der Auftrag sofort abgelehnt und rejected.

Variante 2: Wird bei der Prüfung auf Kontodeckung (redemption check) festgestellt, dass keine Deckung vorhanden ist, wird der Auftrag 5 Tage vorgehalten und täglich geprüft, ob Deckung vorhanden ist. Ist nach 6 Tagen immer noch keine Deckung vorhanden, wird der Auftrag endgültig abgelehnt. Ansonsten werden zwei Provision-Check Nachrichten geliefert (erst negativ, dann positiv).

Bei der Variante 2 können folgende vorläufigen Bestätigungen erstellt werden:

- Auftragsänderung in Vestima durch negativen Provisions-Check
- Auftragsänderung in Vestima durch positiven Provisions-Check

Nr. 5: Der endgültige Status wird nur dann gesendet, wenn der Auftragsempfänger in Vestima den Auftrag bestätigt (Dieses Verhalten wird von Vestima konfiguriert und ist nicht zwingend für jeden Auftragsempfänger eingestellt):

- Auftragseinstellung in Vestima durch Vestima-Depotbank positiv bestätigt
 - Auftragslöschung durch Vestima-Depotbank
-

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 38 von 139

7.2.1.3 Request "NewOrderSingle"

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "D" (MsgType)
	<parties>	O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 1 – 6 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
	<entering firm>	O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
	<executing firm>	O	O	OOOOO	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben, fehlt die Gruppe, dann werden die Daten des Anschlussinhabers für die Transformationen verwendet
	<market maker>	O	O	NOOOO	Daten, die den Orderempfänger beschreiben, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig Für alle anderen Handelssysteme ignoriert
	<intermediary>	O	O	NNNNO	Daten, die den Vertriebspartner beschreiben, nur für INVESTRO zulässig.
	<systematic internaliser>	O	O	ONNNN	Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben
	<client identification code>	O	O	NNOON	Identifikation des Kunden
	<investment decision maker>	O	O	NNOON	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Investitionsentscheidung verantwortet.
	<Execution within firm>	O	O	NNOON	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Orderausführung verantwortet.
	end <parties>				
	<instrument>	M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
	<trading sessions>	O	O	ONOOO	Trading Session Information Relevant ist nur die TradingSessionSubID alternativ können auch die Einzeltags 336 und 625 geliefert Auch für FIX 4.2 kann die Repeating Group in dieser Form verwendet werden. Es ist zu beachten, dass der Aufbau der Gruppe der Version 4.4 entnommen ist und von der Definition der Version 4.2. abweicht
	<OrderAttributes>	O	O	NNOON	Repeating Group für Order-Attribute
	<ValueChecksGrp>	O	O	NNOON	Kennzeichen für die Prüfung auf den maximal für eine Order zulässigen Kurswert am Börsenplatz.
1	Account	O	O	MMOOO	String(2), aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number Möglicher Wertebereich: P1 – Eigengeschäft der Bank A1 – Kundengeschäft der Bank
11	ClOrdID	M	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom sendenden System vergeben werden muss. Der Identifier muss für die gesamte Lebensdauer der Order eindeutig sein. Wird vom BT-FIX Gateway überprüft

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 39 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
21	HandlInst	M / O	M / O		Char für "FIX.4.2" mandatory für "FIX.4.4" optional Instructions for order handling on Broker trading floor Valid values: 1 = Automated execution order, private, no Broker intervention 2 = Automated execution order, public, Broker intervention OK 3 = Manual order, best execution Dieses Tag wird ignoriert
38	OrderQty	O	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen
40	OrdType	M	M		Char Zulässig sind Xetra 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit" K = "Market with Leftover" P = "Pegged" Xetra Ffm-2, MAX-ONE 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit" XONTRO 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" INVESTRO / Vestima 1 = "Market"
44	Price	C	C		Price, Float(13,5) Orderlimit, muss bei Limitorders Tag 40 (OrdType) = "2", "4", "P" angegeben sein, darf bei anderen Werten von OrdType nicht angegeben sein.
54	Side	M	M		Char Seite der Order 1 = "Buy" 2 = "Sell"
58	Text	O	O	OOOOO	String(25) An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 40 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
59	TimelnForce	O	O	OOOOO	<p>Char Zulässig sind</p> <p>Xetra 0 = "Day" 3 = "Immediate or Cancel" 4 = "Fill or Kill" 6 = "Good till Date"</p> <p>INVESTRO / Vestima Dieses Tag wird ignoriert.</p> <p>alle anderen Systeme 0 = "Day" 6 = "Good till Date"</p> <p>Default: "0"</p>
60	TransactTime	M	M		<p>UTC Timestamp Zeitstempel des sendenden Systems oder des Orderaufgebers</p> <p>Dieses Tag wird ignoriert</p>
99	StopPx	O	O	CCCCN	<p>Price, Float(13,5) Stop Limit, muss bei Stop Orders Tag 40 (OrdType) = "3", "4" angegeben sein. Es darf bei anderen Werten von OrdType nicht angegeben sein.</p>
100	ExDestination	O	M		<p>Exchange MIC Code</p>
110	MinQty	O	O	CNNNN	<p>Qty, Float(12,3) Minimal auszuführendes Volumen nur für Midpoint Orders zulässig (OrdType = "P")</p>
432	ExpireDate	C	C		<p>LocalMktDate Ordergültigkeit bis, muss bei Tag 59 = "6" angegeben sein, bei anderen Ausprägungen von TimelnForce nicht zulässig</p> <p>Besonderheiten:</p> <p>XONTRO <u>Zeichnungsaufträge</u> Bei Zeichnungsaufträgen wird die Angabe im Feld ExpireDate nicht berücksichtigt.</p> <p>Das Gültigkeitsdatum wird vom System zu dem kleinsten von folgenden Werten gesetzt: - maximale Ordergültigkeit (360 Tage) - Datum des letzten Tilgungstermins</p> <p><u>Fondssegment Hannover</u> Bei Orders im Fondssegment Hannover wird die Angabe im Feld ExpireDate nicht berücksichtigt. Das Gültigkeitsdatum wird vom System zu dem kleinsten von folgenden Werten gesetzt: - maximale Ordergültigkeit (360 Tage) - Datum des letzten Tilgungstermins</p> <p>Diese Fälle werden in der Response-Nachricht (Execution Report) über eindeutige Ausprägungen des Tags 9933 (CombinedOrderType) gekennzeichnet.</p>

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 41 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
					<p>INVESTRO / Vestima</p> <p>Bei Fondsaufträgen wird die Angabe im Feld ExpireDate nicht berücksichtigt. Das Gültigkeitsdatum wird vom System auf die maximale Ordergültigkeit (360 Tage) gesetzt.</p>
526	SecondaryCIOrdID	O	O	OOOOO	<p>String(16)</p> <p>Bankinterne Ordernummer</p> <p>Weiterer Identifier, der benutzt werden kann, um eine eigene Ordernummer des sendenden Systems oder des Orderaufgebers zu übermitteln. Wird vom BT-FIX Gateway selbst nicht geprüft. Es gelten aber die Regeln des jeweiligen Handels- bzw. Abwicklungssystems.</p>
1094	PegPriceType		O	CNNNN	<p>Integer</p> <p>Nur für Xetra Midpoint Orders anzugeben: 2 = "Mid-price peg" Ist bei anderen Ausprägungen von OrdType nicht zulässig.</p>
1138	DisplayQty		O	CNNNN	<p>Qty, Float(12,3)</p> <p>Nur für Xetra Iceberg Orders anzugeben, maximal sichtbares Volumen, darf nur bei Limitorders angegeben sein.</p>
1724	OrderOrigination	O	O	NNOON	<p>Integer</p> <p>Kennzeichen für DEA (Direct Electronic Access). (ESMA RTS 24, Feld 2) 5 = DEA (Direct Electronic Access) Fehlendes Tag bedeutet „kein DEA“.</p>
1815	TradingCapacity	O	O	NNOON	<p>Integer</p> <p>Handelsfunktion. (ESMA RTS 24, Feld 7)</p> <p>1 = AOTC (Handel für Kunde) 5 = DEAL (Handel für eigene Rechnung) 6 = DEAL (Handel als Market Maker) 9 = MTCH (Zusammenführung sich deckender Kundenaufträge) Fehlendes Tag bedeutet „1=AOTC“</p>
5076	FundReinvestIncome		O	NNNNO	<p>Char</p> <p>Y = Kauf zu Wiederanlage Space = sonstiges Nur für INVESTRO.</p>
5078	FundSpecialDealDiscount		O	NNNNO	<p>Char</p> <p>Y = Kauf zum Rücknahmepreis = (R) Space = sonstiges Nur für INVESTRO.</p>
5156	UnreleasedDate		O	NNOON	<p>LocalMktDate</p> <p>Wird für die Kennzeichnung von Orders verwendet, die erst in der Zukunft gültig sind. Muss mit einem Wert >= aktueller Handelstag belegt sein. Jeder Wert > aktueller Handelstag wird akzeptiert, auch wenn dies kein gültiger Handelstag ist.</p> <p>Das tatsächliche Datum Gültig-Ab wird vom Handelssystem intern gesetzt. Der gesetzte Wert wird in der Response-Nachricht (auch im Tag 5156 - Feld Unreleased Date) geliefert.</p>

FAGSE

BT-FIX Gateway

Rules of Engagement

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
5253	OrdTypeExt		C	NNOON	Char Zulässig sind XONTRO, MAX-ONE E = "EG-Order" Besonderheit nur für XONTRO: Das Kennzeichen EG-Order ist bei einer Folgetags- Order nicht erlaubt.
<standard message trailer>		M	M		

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 43 von 139

7.2.1.4 Response "Execution Report" - Identifikationskriterien

Nachfolgend die FIX-Tags innerhalb des ExecutionReport zur Identifikation der Responses auf die Ordereinstellungen:

FIX Tags		Response auf die Ordereinstellung			
Tag	Feld	Vorläufig	Positiv	Negativ	Negativ (nur Vestima)
39	OrdStatus	A = "Pending New"	0 = "New"	8 = "Rejected"	4 = "Cancelled"
150	ExecType	A = "Pending New"	0 = "New"	8 = "Rejected"	4 = "Cancelled"
5946	PendingReason	1 = "buffered" 2 = "locked stock" 3 = "response delayed" 4 = "order status unknown (end of day)" 5 = "verification pending"	-	-	-
nur für Aufträge in Vestima Gattungen					
5048	OrdSubStatus	D = "provision check negativ" E = "provision check positiv" I = "order entry received in Vestima"	F = "enter confirmation from OHA"	-	G = "delete from Vestima"
5476	PrivateReference	"Order-Entry received in Vestima" "Provision check"	"OHA Confirmation - successful Order-Entry"	-	Text von Vestima (Erläuterung zu der Löschung)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 44 von 139

7.2.1.5 Response "Execution Report" - Nachrichtendaten

Der zugehörige New Order Single Request kann auch nur einen Party Eintrag enthalten (die Entering Firm agiert auch als Executing Firm). Im Execution Report werden in jedem Fall getrennte Einträge mit identischer PartyID erzeugt. Zusätzlich kann auch ein Eintrag für einen Market Maker generiert werden.

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "8" (MsgType)
	<parties>	O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur die Werte 2 – 4 können vorkommen
	<entering firm>	O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
	<executing firm>	O	O	MMMMM	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
	<market maker>	O	O	NOOOO	Daten, die den Orderempfänger beschreiben, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig
	<intermediary>	O	O	NNNNO	Daten, die den Vertriebspartner beschreiben, nur für INVESTRO zulässig.
	<systematic internaliser>	O	O	ONNNN	Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben
	end <parties>				
	<instrument>	M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
1	Account	O	O	MMOMO	String(2), aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number Wenn in der Request-Nachricht nicht vorhanden werden von den Handels- bzw. Abwicklungssystemen Defaultwerte gesetzt
6	AvgPx	M	M		Schnittpreis, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt
11	ClOrdID	O	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags
14	CumQty	M	M		Qty, Float(12,3) Gesamtausführungsmenge, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt
17	ExecID	M	M		String eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig
37	OrderID	M	M		String(13) Eindeutige Ordernummer des Handels- bzw. Abwicklungssystems Wenn keine Ordernummer vorhanden wird "[N/A]" geliefert. Das ist der Fall bei Ablehnungen und bei vorläufigen Bestätigungen, die vor der Vergabe einer Ordernummer generiert werden.
38	OrderQty	O	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 45 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus 0 = "New" Einstellung endgültig positiv A = "Pending New" Einstellung vorläufig angenommen (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason) 8 = "Rejected" Einstellung abgelehnt Vestima 4 = "Cancelled" Ablehnung eines Auftrags durch Vestima-Depotbank (wird als Auftragslöschung übermittelt)
40	OrdType	O	M		Char Ordertyp
44	Price	C	C		Price, Float(13,5) Limit der Order Orderlimit, wird für OrdType "2", "4" und "P" belegt
54	Side	M	M		Char Seite der Order 1 = Buy 2 = Sell
58	Text	O	O	OOOOO	String(25) An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben Textfeld
59	TimeInForce	O	M		Char
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp [microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss] Zeitstempel des Handels- bzw. Abwicklungssystems
99	StopPx	C	O	CCCCN	Price, Float(13,5) Stop Limit, wird für OrdType "3" und "4" belegt
100	ExDestination	O	M		Exchange MIC Code Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt
110	MinQty	O	O	CNNNN	Qty, Float(12,3) Minimal auszuführendes Volumen wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt
150	ExecType	M	M		Char Art des Report 0 = "New" Einstellung endgültig positiv A = "Pending New" Einstellung vorläufig angenommen (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason) 8 = "Rejected" Einstellung abgelehnt INVESTRO I = "OrderStatus" Nachricht an den Auftragsempfänger bei einer positiven Einstellung (OrdStatus "New")

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 46 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
					Vestima 4 = "Cancelled" Ablehnung eines Auftrags durch Vestima-Depotbank (wird als Auftragslöschung übermittelt)
151	LeavesQty	M	M		Qty, Float(12,3) offene Menge der Order mit dem Gesamtvolumen belegt
336	TradingSessionID	O	O	ONOOO	String(1) Aus dem New Order Single Request immer mit Tag 625 zusammen verwendet enthält immer den Wert "1"
432	ExpireDate	O	M		LocalMktDate Ordergültigkeit bis nur bei TimeInForce = "6" belegt (Tag 59)
526	SecondaryClOrdID	O	O	OOOOO	String(16) Bankinterne Ordernummer
625	TradingSessionSubID	O	O	CNCCO	String immer mit Tag 336 zusammen verwendet
1094	PegPriceType		O	CNNNN	Integer Nur für Xetra Midpoint Orders wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt enthält immer den Wert "2"
1138	DisplayQty		O	CNNNN	Qty, Float(12,3) Nur für Xetra Iceberg Orders, maximal sichtbares Volumen, darf nur bei Limitorders angegeben sein
5048	OrdSubStatus		O	NNNNC	Char Nur bei Nachrichten für Aufträge in Vestima-Gattungen belegt. Vestima <u>Vorläufig</u> (OrdStatus A = "Pending New" PendingReson 5 = "verification pending") I = "order entry received in Vestima" Auftragseinstellung in Vestima empfangen D = "provision check negativ" Auftragsänderung in Vestima durch negativen Provisions-Check E = "provision check positiv" Auftragsänderung in Vestima durch positiven Provisions- Check <u>Endgültig positiv</u> (OrdStatus 0 = "New") F = "enter confirmation from OHA" Auftragseinstellung in Vestima durch Vestima- Depotbank positive bestätigt <u>Endgültig negativ</u> (OrdStatus 4 = "Cancelled") G = "delete from Vestima" Auftragslöschung durch Vestima-Depotbank In diesem Fall wird OrdStatus = 4 und ExecType 4 ("Cancelled") geliefert
5076	FundReinvestIncome		O	NNNNO	Char Y = Kauf zu Wiederanlage Nur für INVESTRO.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 47 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
5078	FundSpecialDealDiscount		O	NNNNO	Char Y = Kauf zum Rücknahmepreis = (R) Nur für INVESTRO.
5156	UnreleasedDate		O	NNOOO	LocalMktDate XONTRO, INVESTRO, MAX-ONE Datum Gültig-ab für Orders, die erst in der Zukunft gültig werden. Das Feld enthält der Börsentag, ab dem eine Order gültig ist. XONTRO Folgetagsorders, Fondssegment Hannover MAX-ONE Folgetagsorders INVESTRO Aufträge nach Annahmeschluss, ggf. unter Berücksichtigung des Emittenten- oder Gattungs-Feiertagskalenders.
5253	OrdTypeExt		C	NNOON	Char Zweiter Ordertyp für EG-Orders Zulässig sind XONTRO; MAX-ONE E = "EG-Order"
5476	PrivateReference		O	NNNNC	String Ergänzung zu OrdSubStatus Vestima <u>Vorläufig</u> "Order-Entry received in Vestima" "provision check" <u>Endgültig positiv</u> "OHA Confirmation – successful Order-Entry" <u>Endgültig negativ</u> Text von Vestima – Erläuterung zu der Ablehnung des Auftrags
5689	VersionID		O	MMNNN	Integer(18) Xetra, Xetra Ffm-2 Schlüssel zur Updatekontrolle

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 48 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
5946	Pending Reason		O	CCCCC	String das BT-FIX Gateway liefert immer Integer(1) Das Feld ist nur bei vorläufigen Bestätigungen ("Pending New" - OrdStatus = A, ExecType = A) belegt 1 = "buffered" Ordereingang wegen nicht verfügbarem Handelssystem vorgehalten (Xetra, Xetra Ffm-2) 2 = "locked stock" Ordereingang wegen Orderbuchsperrung (XONTRO, MAX-ONE) bzw. wegen Locked-Stock (Xetra, Xetra Ffm-2) vorgehalten. 3 = "response delayed (intraday)" keine Bestätigung vom Handelssystem innerhalb eines bestimmten, konfigurierbaren Zeitintervalls empfangen (Xetra, Xetra Ffm-2) 4 = "order status unknown (end of day)" Bis Ende des Handelstages wurde keine endgültige Bestätigung (positiv oder negativ) zum Ordereingang erhalten. Der Orderstatus ist unbekannt. 5 = "verification pending" XONTRO EG-Order vorläufig angenommen INVESTRO / Vestima Auftrag für eine Vestima-Gattung vorläufig angenommen.
9933	CombinedOrderType		O	NNONN	Char "Z" = Zeichnungsauftrag "H" = Fondssegment Hannover In den Fällen, in denen dieses Tag geliefert wird, wird das Gültigkeitsdatum der Order vom Handelssystem gesetzt und im Feld ExpireDate (Tag 432) geliefert. Das ExpireDate in der Request-Nachricht wird nicht berücksichtigt. Siehe weitere Details in der Beschreibung des Tags 432 (ExpireDate) bei der Request-Nachricht "NewOrderSingle"
	Folgende Felder sind nur bei Ablehnungen ("Rejected" - OrdStatus = 8, ExecType = 8) belegt				
5555	ReturnCode		O	CCCCC	Integer Returncode
9320	OrderRejectReasonTxt		O	CCCCC	String Fehlertext des Handels- bzw. Abwicklungssystems
9803	TradingSystemID		O	CCCCC	Integer Identifiziert das System, welches den Fehlercode erzeugt hat
<standard message trailer>		M	M		

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 49 von 139

7.2.2 Order- bzw. Auftragslöschung**7.2.2.1 Abläufe – Orders**

Nr.	Orderlöschung positiv	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")			
	<i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i>			
2	execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")			
	<i>endgültige Bestätigung positiv</i>			
3	execution report ("Canceled", "Canceled")			

Nr.	Orderlöschung negativ	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")			
	<i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i>			
2	execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")			
	<i>endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)</i>			
3	order cancel reject ("Rejected")			

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 50 von 139

Nr.	Orderlöschung ohne endgültige Bestätigung	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")			
2	optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946) execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")			
3	Tagesende: vorläufige Bestätigung mit PendingReason 4 = "order status unknown (end of day)" execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")			

Anmerkungen zum Messageflow:

Der Execution Report "Pending Replace" oder "Pending Cancel" bedeutet in Verbindung mit dem Completion Code 127650 (MODIFICATION/CANCELLATION ACCEPTED BUT TEMPORARILY POSTPONED), dass eine Orderänderung bzw. -löschung logisch bereits endgültig, aber aus technischen Gründen vorübergehend zurückgestellt ist. Der endgültige Execution Report der Bestätigung "Replace" oder "Canceled" folgt.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 51 von 139

7.2.2.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)INVESTRO "classic"

Nr.	Auftragslöschung positiv	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	INVESTRO
1	order cancel ("CIOrdID", "OrigCIOrdID")			
2	<i>endgültige Bestätigung positiv</i> execution report ("Canceled", "Canceled")			
3	<i>Nachricht an den Auftragsempfänger</i> execution report ("Order Status", "Canceled")			

Nr.	Auftragslöschung negativ	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	INVESTRO
1	order cancel ("CIOrdID", "OrigCIOrdID")			
2	<i>endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation</i> <i>(Tags 5555, 9320, 9803)</i> order cancel reject ("Rejected")			

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 52 von 139

INVESTRO/Vestima

Nr.	positive Auftragslöschung an INVESTRO/Vestima	messageflow			
		FE Customer	BT FIX Gateway	INVESTRO	Vestima
1	ordercancel ("CIOrdID", "OrigCIOrdID")				
					MT502
2	<i>Annahmebestätigung INVESTRO</i> execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")				
3	<i>Validierung Vestima</i> execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")			MT509	
4	<i>Bestätigung der Löschung durch OHA</i> execution report ("Canceled", "Canceled")			MT509	

Nr.	negative Auftragslöschung an INVESTRO/Vestima	messageflow			
		FE Customer	BT FIX Gateway	INVESTRO	Vestima
1	ordercancel ("CIOrdID", "OrigCIOrdID")				
					MT502
2	<i>Annahmebestätigung INVESTRO</i> execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")				
3	<i>Validierung Vestima</i> execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")			MT509	
4	<i>Ablehnung der Löschung durch OHA</i> execution report ("Rejected", "Rejected")			MT509	

FAGSE

BT-FIX Gateway

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 53 von 139

Anmerkungen zum Messageflow:

Alle Löschungen werden von Vestima als Löschanfragen bewertet. Erst die Bestätigung der Löschung durch den Empfänger in Vestima führt zur Löschung des Auftrags in INVESTRO.

Auf alle Pending Cancel Nachrichten kann noch ein Reject der Cancellation erfolgen.

Nr. 2: Bestätigung, dass Löschung in INVESTRO empfangen und an Vestima weitergeleitet wurde

Nr. 3: Auftragslöschung in Vestima empfangen

Nr. 4: Auftragslöschung in Vestima durchgeführt (positiv) bzw. abgelehnt (negativ)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 54 von 139

7.2.2.3 Request "Order Cancel Request"

Wird die Order über die OrigClOrdID identifiziert, dann kann ExDestination fehlen. Ist das Tag vorhanden, dann muss es aber korrekt belegt sein. Wird OrderID zur Identifikation benutzt, dann muss ExDestination belegt sein. Die Angabe von ExDestination verbessert die Performance.

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "F" (MsgType)
	<parties>	O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 1 – 5 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
	<entering firm>	O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
	<executing firm>	O	O	OOOOO	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben, fehlt die Gruppe, dann werden die Daten des Anschlussinhabers für die Transformationen verwendet
	<client identification code>	O	O	NNOON	Identifikation des Kunden
	<investment decision maker>	O	O	NNOON	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Investitionsentscheidung verantwortet.
	<Execution within firm>	O	O	NNOON	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Orderausführung verantwortet.
	end <parties>				
	<instrument>	M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
	<OrderAttributes>	O	O	NNOON	Repeating Group für Order-Attribute
11	ClOrdID	M	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom sendenden System vergeben werden muss. Der Identifier muss für die gesamte Lebensdauer der Order eindeutig sein. Wird vom BT-FIX Gateway geprüft
37	OrderID	O	C		String(13) kann zur Identifikation einer Order verwendet werden, die OrigClOrdID muss in diesem Fall auf "[N/A]" gesetzt sein
38	OrderQty	M	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen Dieses Tag wird ignoriert
41	OrigClOrdID	M	M		String(16) ClOrdID des letzten erfolgreichen verarbeiteten FIX Requests zu dieser Order, falls auf "[N/A]" gesetzt, wird Tag 37 zur Identifikation der Order herangezogen.
54	Side	M	M		Char Seite der Order 1 = "Buy" 2 = "Sell" MAX-ONE akzeptiert einen Cancel Request auch bei einer falschen, aber formal korrekten Angabe
60	TransactTime	M	M		UTC Timestamp Zeitstempel des sendenden Systems oder des Orderaufgebers Dieses Tag wird ignoriert

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 55 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
100	ExDestination		O	00000	Exchange MIC Code
5253	OrdTypeExt		OC	CO000	Char Alternativer Ordertyp Ist für XONTRO, MAX-ONE oder INVESTRO ein Wert angegeben, dann wird er ignoriert. Der Request wird akzeptiert. Wird für Xetra Ffm-2 ein Wert angegeben, muss er mit dem Wert der Order übereinstimmen, das Tag ist jedoch optional Wird für Xetra ein Wert angegeben, muss er ebenfalls mit dem Wert der Order übereinstimmen. Ist die Order vom Typ "Stop", "Stop Limit", "Midpoint" oder "Iceberg" muss das Tag belegt sein Zulässig sind Xetra: 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit" K = "Market with Leftover" M = "Midpoint" I = "Iceberg" Xetra Ffm-2 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit"
6042	CxlReason	O	O	NNOON	Integer Kennzeichnung einer Orderlöschung durch Kill-Funktionalität (MIFID II). 1 = Cancel durch Kill-Funktion
<standard message trailer>		M	M		

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 56 von 139

7.2.2.4 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv, negativ von Vestima)

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "8" (MsgType)
	<parties>	O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur der Wert 2 kann vorkommen
	<entering firm>	O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
	<executing firm>	O	O	MMMMM	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
	end <parties>				
	<instrument>	M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
6	AvgPx	M	M		Schnittpreis, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt
11	ClOrdID	O	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags. Der im Cancel Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
14	CumQty	M	M		Qty, Float(12,3) Gesamtausführungsmenge
17	ExecID	M	M		String eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig
37	OrderID	M	M		String(13) Eindeutige Ordernummer des Handels- bzw. Abwicklungssystems
38	OrderQty	M	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus 4 = "Canceled" Löschung endgültig positiv 6 = "Pending Cancel" Löschung vorläufig angenommen (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason) Vestima 8 = "Rejected" Auftragslöschung in Vestima durch Vestima OHA abgelehnt
41	OrigClOrdID	O	M		String(16) Der im Cancel Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
44	Price	O	O	NNCCO	Price, Float(13,5) Orderlimit, wird für OrdType "2", "4" und "P" belegt
54	Side	M	M		Char Seite der Order
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp [microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss] Zeitstempel des Handels bzw. Abwicklungssystems

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 57 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
100	ExDestination		M		Exchange MIC Code
150	ExecType	M	M		Char Art des Report 4 = "Canceled" Löschung endgültig positiv 6 = "Pending Cancel" Löschung vorläufig angenommen (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason) INVESTRO Nachricht an den Auftragsempfänger wird mit I = "OrderStatus" belegt. Nachricht an den Empfänger bei einer positiven Einstellung (OrdStatus "Canceled") Vestima 8 = "Rejected" Auftragslöschung in Vestima durch Vestima OHA abgelehnt
151	LeavesQty	M	M		Qty, Float(12,3) offene Menge der Order mit "0" belegt
526	SecondaryClOrdID	O	O	OOOOO	String(16) Bankinterne Ordernummer
5048	OrdSubStatus		O	NNNNC	Char Nur bei Nachrichten für Aufträge in Vestima-Gattungen belegt. Vestima <u>Vorläufig</u> (OrdStatus 6 = "Pending Cancel" PendingReson 5 = "verification pending") A = "delete received in Vestima" Auftragslöschung in Vestima empfangen <u>Endgültig positiv</u> (OrdStatus 4 = "Canceled") B = "delete executed in Vestima" Auftragslöschung in Vestima durch Vestima OHA durchgeführt <u>Endgültig negativ</u> (OrdStatus 8 = "Rejected") C = "delete rejected in Vestima" Auftragslöschung in Vestima durch Vestima OHA abgelehnt
5476	PrivateReference		O	NNNNC	String Ergänzung zu OrdSubStatus Vestima <u>Vorläufig</u> "delete request received in Vestima" <u>Endgültig positiv</u> "deletion processed by Vestima / OHA" <u>Endgültig negative</u> Text von Vestima – Erläuterung zu der Ablehnung der Auftragslöschung

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 58 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
5946	Pending Reason		O	CCCCC	<p>String das BT-FIX Gateway liefert immer Integer(1)</p> <p>Das Feld ist nur bei vorläufigen Bestätigungen ("Pending Cancel" - OrdStatus = 6, ExecType = 6) belegt</p> <p>1 = "buffered" Orderlöschung wegen nicht verfügbarem Handelssystem vorgehalten (Xetra, Xetra Ffm-2)</p> <p>2 = "locked stock" Orderlöschung wegen Orderbuchsperrung (XONTRO, MAX-ONE) bzw. wegen Locked-Stock (Xetra, Xetra Ffm-2) vorgehalten.</p> <p>3 = "response delayed (intraday)" keine Bestätigung vom Handelssystem innerhalb eines bestimmten, konfigurierbaren Zeitintervalls empfangen (Xetra, Xetra Ffm-2)</p> <p>4 = "order status unknown (end of day)" Bis Ende des Handelstages wurde keine endgültige Bestätigung (positiv oder negativ) zu der Orderlöschung erhalten. Der Orderstatus ist unbekannt.</p> <p>5 = "verification pending" INVESTRO / Vestima Auftragslöschung für eine Vestima-Gattung vorläufig angenommen</p>
	<standard message trailer>	M	M		

7.2.2.5 Response "Order Cancel Reject" (endgültig negativ)

Bei abgelehnten Orderlöschungen wird statt eines Execution Reports ein Order Cancel Reject versendet.

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "9" (MsgType)
<parties>			M		
453	NoPartyIDs		M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur der Wert 2 kann vorkommen
<entering firm>			M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>			O	OOOOO	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
end <parties>					
11	ClOrdID	M	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags Der im Cancel Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
37	OrderID	M	M		String(13) Eindeutige Ordernummer des Handels- bzw. Abwicklungssystems Das Tag kann fehlen oder mit [N/A] belegt sein
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus wird mit 8 = "Rejected" belegt
41	OrigClOrdID	M	M		String(16) Der im Cancel Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp Zeitstempel des Handels bzw. Abwicklungssystems
100	ExDestination		M		Exchange MIC Code Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt
102	CxlRejReason	O	M		Integer wird mit 99 = "Other" belegt, falls kein passender Reason Code vorhanden ist. In diesem Fall liefert Tag 5555 einen Fehlercode und Tag 9320 einen Fehlertext
434	CxlRejResponseTo	M	M		Char 1 = "Order Cancel Request"
5555	ReturnCode		M		Integer Returncode
9320	OrderRejectReasonTxt		M		String Fehlertext des Handels- bzw. Abwicklungssystems
9803	TradingSystemID		M		Integer Identifiziert das System, welches den Returncode erzeugt hat
<standard message trailer>		M	M		

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 60 von 139

7.2.3 Order- bzw. Auftragsänderung**7.2.3.1 Abläufe – Orders**

Nr.	Orderänderung positiv	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel/replace ("ClOrdID", "OrigClOrdID")			
	<i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i>			
2	execution report ("Pending Replace", "Pending Replace")			
	<i>endgültige Bestätigung positiv</i>			
3	execution report ("Replace", aktueller Orderstatus)			

Nr.	Orderänderung negativ	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel/replace ("ClOrdID", "OrigClOrdID")			
	<i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i>			
2	execution report ("Pending Replace", "Pending Replace")			
	<i>endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)</i>			
3	order cancel reject ("Rejected")			

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 61 von 139

Nr.	Orderänderung ohne endgültige Bestätigung	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel/replace ("CLOrdID", "OrigCLOrdID")			
2	<i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i> execution report ("Pending Replace", "Pending Replace")			
3	<i>Tagesende: vorläufige Bestätigung mit PendingReason 4 = "order status unknown (end of day)"</i> execution report ("Pending Replace", "Pending Replace")			

Anmerkungen zum Messageflow:

Der Execution Report "Pending Replace" oder "Pending Cancel" bedeutet in Verbindung mit dem Completion Code 127650 (MODIFICATION/CANCELLATION ACCEPTED BUT TEMPORARILY POSTPONED), dass eine Orderänderung bzw. -löschung logisch bereits endgültig, aber aus technischen Gründen vorübergehend zurückgestellt ist. Der endgültige Execution Report der Bestätigung "Replace" oder "Canceled" folgt.

7.2.3.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)

Nr.	Auftragsänderung negativ	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	INVESTRO
1	order cancel/replace ("CLOrdID", "OrigCLOrdID")			
2	<i>endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)</i> order cancel reject ("Rejected")			

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 62 von 139

7.2.3.3 Request "Order Cancel Replace Request"

Üblicherweise muss ein Cancel/Replace Request alle Felder der Order liefern. Das BT-FIX Gateway unterstützt dieses Verhalten, lässt aber - als alternative Erweiterung - auch zu, dass nur die zu ändernden optionalen Tags gesendet werden. Mandatory Tags müssen immer angegeben werden, die Behandlung von conditional mandatory Tags ist der Requestbeschreibung zu entnehmen. Die Bemerkung "**nicht änderbar**" ist als Hinweis zu verstehen. Das BT-FIX Gateway kann dies nicht prüfen, die Felder werden immer weitergegeben.

Änderungen von INVESTRO-/Vestima-Aufträgen sind nicht möglich.

Order Cancel/Replace Requests mit ExDestination "XINV" (INVESTRO) werden immer abgelehnt.

Wird die zu ändernde Order über die OrigClOrdID identifiziert, dann kann ExDestination fehlen. Ist das Tag vorhanden, dann muss es aber korrekt belegt sein. Wird OrderID zur Identifikation benutzt, dann muss ExDestination belegt sein.

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "G" (MsgType)
<parties>		O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 2 – 6 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
<entering firm>		O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>		O	O	MMMM-	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben, fehlt die Gruppe, dann werden die Daten des Anschlussinhabers für die Transformationen verwendet
<market maker>		O	O	NOOO-	Daten, die den Orderempfänger beschreiben, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig Wird für alle anderen Handelssysteme ignoriert
<systematic internaliser>		O	O	ONNN-	Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben
<client identification code>		O	O	NNOON	Identifikation des Kunden
<investment decision maker>		O	O	NNOON	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Investitionsentscheidung verantwortet.
<Execution within firm>		O	O	NNOON	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Orderausführung verantwortet.
end <parties>					
<instrument>		M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
<trading sessions>		O	O	ONOO-	Trading Session Information Relevant ist nur die TradingSessionSubID alternativ können auch die Einzeltags 336 und 625 geliefert werden Auch für FIX 4.2 kann die Repeating Group in dieser Form verwendet werden. Es ist zu beachten, dass der Aufbau der Gruppe der Version 4.4 entnommen ist und von der Definition der Version 4.2. abweicht
<OrderAttributes>		O	O	NNOON	Repeating Group für Order-Attribute
<ValueChecksGrp>		O	O	NNOON	Kennzeichen für die Prüfung auf den maximal für eine Order zulässigen Kurswert am Börsenplatz.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 63 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
1	Account	O	O	MMNN-	String(2), aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number Nicht änderbar Möglicher Wertebereich: P1 – Eigengeschäft der Bank A1 – Kundengeschäft der Bank
11	ClOrdID	M	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom sendenden System vergeben werden muss. Der Identifier muss für die gesamte Lebensdauer der Order eindeutig sein. Wird vom BT-FIX Gateway geprüft
21	HandlInst	M / O	M / O		Char für "FIX.4.2" mandatory für "FIX.4.4" optional Instructions for order handling on Broker trading floor Valid values: 1 = Automated execution order, private, no Broker intervention 2 = Automated execution order, public, Broker intervention OK 3 = Manual order, best execution Dieses Tag wird ignoriert
37	OrderID	O	C		String(13) Ordernummer des Handelssystems nicht änderbar kann zur Identifikation einer Order verwendet werden, die OrigClOrdID muss in diesem Fall auf "[N/A]" gesetzt sein
38	OrderQty	O	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen incl. ausgeführter Menge Bei XONTRO und MAX-ONE entspricht dies der Ursprungsnominalen. Eine Änderung der Qty ist nicht möglich. XONTRO Der Request wird abgelehnt wenn die OrderQty und die Ursprungsnominale der Order nicht übereinstimmen. Xetra, Xetra Ffm-2, MAX-ONE Das Tag wird ignoriert.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 64 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
40	OrdType	M	M		Char Zulässig sind Xetra: 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit" K = "Market with Leftover" P = "Pegged" Xetra Ffm-2, MAX-ONE 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit" XONTRO 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop"
41	OrigClOrdID	M	M		String(16) ClOrdID des letzten erfolgreichen verarbeiteten FIX Requests zu dieser Order, falls auf "N/A" gesetzt, wird Tag 37 zur Identifikation der Order herangezogen
44	Price	O	C		Price, Float(13,5) Orderlimit, muss bei Limitorders Tag 40 (OrdType) = "2", "4", "P" angegeben sein
54	Side	M	M		Char Seite der Order 1 = "Buy" 2 = "Sell" nicht änderbar
58	Text	O	O	0000-	String(25) An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben
59	TimeInForce	O	O	0000-	Char Zulässig ist: 6 = Good till Date kein Default, soll das Gültigkeitsdatum einer Order geändert werden, dann muss das Tag mit "6" belegt sein, Tag 432 muss den neuen Wert enthalten
60	TransactTime	M	M		UTC Timestamp Zeitstempel des sendenden Systems oder des Oderaufgebers. Dieses Tag wird ignoriert
99	StopPx	O	O	CCCC-	Price, Float(13,5) Stop Limit, muss bei Stop Orders Tag 40 (OrdType) = "3", "4" angegeben sein
100	ExDestination	O	O	0000-	Exchange MIC Code nicht änderbar
432	ExpireDate	O	C		LocalMktDate Ordergültigkeit bis, bei Änderungen der Ordergültigkeit anzugeben, siehe Tag 59

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 65 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
526	SecondaryClOrdID	O	O	O000-	String(16) Bankinterne Ordernummer Weiterer Identifier, der benutzt werden kann, um eine eigene Ordernummer des sendenden Systems oder des Orderaufgebers zu übermitteln. Wird vom BT-FIX Gateway nicht geprüft
1094	PegPriceType		O	CNNN-	Integer Nur für Xetra Midpoint Orders anzugeben: 2 = "Mid-price peg"
1138	DisplayQty		O	CNNN-	Qty, Float(12,3) Nur für Xetra Iceberg Orders anzugeben, maximal sichtbares Volumen
1724	OrderOrigination	O	O	NNOON	Integer Kennzeichen für DEA (Direct Electronic Access). (ESMA RTS 24, Feld 2) 5 = DEA (Direct Electronic Access) Fehlendes Tag bedeutet „kein DEA“.
5689	VersionID		O	O0NN-	Integer(18) Xetra, Xetra Ffm-2 Schlüssel zur Updatekontrolle
6126	OrigLeavesQty		O	NNOO-	Qty, Float(12,3) Noch ausführbare Menge zur Updatekontrolle Wird eine Prüfung der noch ausführbaren Nominalen der Order gewünscht dann, dann muss diese im Tag 6126 mitgegeben werden (nur XONTRO) Ansonsten ist das Tag nicht erforderlich
<standard message trailer>		M	M		

7.2.3.4 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv)

Ein Cancel/Replace Request kann auch nur einen Party Eintrag enthalten (die Entering Firm agiert auch als Executing Firm). Im Execution Report werden in jedem Fall getrennte Einträge mit identischer PartyID erzeugt. Zusätzlich kann auch ein Eintrag für einen Market Maker generiert werden.

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "8" (MsgType)
<parties>		O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur die Werte 2 – 3 können vorkommen
<entering firm>		O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>		O	O	O000-	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
<market maker>		O	O	N000-	Daten, die den Orderempfänger beschreiben, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig
end <parties>					
<instrument>		M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
1	Account	M	M		String(2), aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 66 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
6	AvgPx	M	M		Schnittpreis, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt
11	ClOrdID	O	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags- Aus dem Order Cancel/Replace Request übernommen
14	CumQty	M	M		Qty, Float(12,3) Gesamtausführungsmenge
17	ExecID	M	M		String eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig
37	OrderID	M	M		String(13) Eindeutige Ordernummer des Handelssystems Die Ordernummer kann wechseln (Xetra, Xetra Ffm-2). Ist dies der Fall, dann verbleiben alle bisher verwendeten ClOrdIDs bei der alten Ordernummer. Die "neue" Order muss über Tag 37 identifiziert werden
38	OrderQty	O	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus 0 = „New“ Änderung durchgeführt (endgültig) wird je nach Status der Order belegt Änderung vorläufig angenommen E = "Pending Replace" (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason)
40	OrdType	O	M		Char Ordertyp
41	OrigClOrdID	O	M		String(16) Aus dem Request kopiert ClOrdID des letzten erfolgreichen Requests zu dieser Order, falls der zugehörige Request die Order über Tag 41 identifiziert hat. Wurde die Order über Tag 37 identifiziert, enthält Tag 41 "[N/A]"
44	Price	C	C		Price, Float(13,5) Limit der Order
54	Side	M	M		Char Seite der Order
58	Text	O	O	OOOO-	String(25) An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben Textfeld
59	TimeInForce	O	O	MMOO-	Char
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp [microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss] Zeitstempel des Handelssystems
99	StopPx	C	O	CCCC-	Price, Float(13,5) Stop Limit
100	ExDestination		M		Exchange MIC Code Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 67 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
150	ExecType	M	M		Char Art des Report Änderung durchgeführt (endgültig) 5 = "Replace" Änderung vorläufig angenommen E = "Pending Replace" (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason)
151	LeavesQty	M	M		Qty, Float(12,3) offene Menge der Order
336	TradingSessionID	O	O	ONOO-	String(1) immer mit Tag 625 zusammen verwendet "1" oder fehlend
432	ExpireDate	O	C		LocalMktDate Ordergültigkeit bis
526	SecondaryClOrdID	O	O	O000-	String(16) Bankinterne Ordernummer
625	TradingSessionSubID	O	O	CNCC-	String immer mit Tag 336 zusammen verwendet
1094	PegPriceType		O	CNNN-	Integer Nur für Xetra Midpoint Orders
1138	DisplayQty		O	CNNN-	Qty, Float(12,3) Nur für Xetra Iceberg Orders, maximal sichtbares Volumen
5689	VersionID		O	MMNN-	Integer(18) Schlüssel zur Updatekontrolle
5946	Pending Reason		O	CCCCC	String das BT-FIX Gateway liefert immer Integer(1) Das Feld ist nur bei vorläufigen Bestätigungen ("Pending Replace" - OrdStatus = E, ExecType = E) belegt 1 = "buffered" Orderänderung wegen nicht verfügbarem Handelssystem vorgehalten (Xetra, Xetra Ffm-2) 2 = "locked stock" Orderänderung wegen Orderbuchsperrung (XONTRO, MAX-ONE) bzw. wegen Locked-Stock (Xetra, Xetra Ffm-2) vorgehalten. 3 = "response delayed (intraday)" keine Bestätigung vom Handelssystem innerhalb eines bestimmten, konfigurierbaren Zeitintervalls empfangen (Xetra, Xetra Ffm-2) 4 = "order status unknown (end of day)" Bis Ende des Handelstages wurde keine endgültige Bestätigung (positiv oder negativ) zu der Orderänderung erhalten. Der Orderstatus ist unbekannt.
	<standard message trailer>	M	M		

7.2.3.5 Response "Order Cancel Reject" (endgültig negativ)

Statt eines Execution Reports wird ein Order Cancel Reject versendet.

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "9" (MsgType)
	<parties>		M		
453	NoPartyIDs		M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur der Wert 2 kann vorkommen
	<entering firm>		M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
	<executing firm>		O	MMMMM	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
	end <parties>				
11	ClOrdID	M	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags Der im Order Cancel/Replace Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
37	OrderID	M	M		String(13) Eindeutige Ordernummer des Handelssystems Das Tag kann fehlen oder mit [N/A] belegt sein
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus wird mit 8 = "Rejected" belegt
41	OrigClOrdID	M	M		String(16) Der im Order Cancel/Replace Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp Zeitstempel des Handels- bzw. Abwicklungssystems
100	ExDestination		M		Exchange MIC Code Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt
102	CxlRejReason	O	M		Integer wird mit 99 = "Other" belegt, falls kein passender Reason Code vorhanden ist. In diesem Fall liefert Tag 5555 einen Fehlercode und Tag 9320 einen Fehlertext
434	CxlRejResponseTo	M	M		Char mit 2 = "Order Cancel/Replace Request"
5555	ReturnCode		M		Integer Returncode
9320	OrderRejectReasonTxt		M		String Fehlertext des Handels- bzw. Abwicklungssystems
9803	TradingSystemID		M		Integer Identifiziert das System, welches den Returncode erzeugt hat
	<standard message trailer>	M	M		

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 69 von 139

7.2.4 Order- bzw. Auftragsausführung**7.2.4.1 Abläufe – Orders**

Nr.	Teilausführung	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	<i>Teilausführung</i> execution report ("Trade", "Partially Filled")		←●	←●

Nr.	Vollausführung	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	<i>Vollausführung</i> execution report ("Trade", "Filled")		←●	←●

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 70 von 139

7.2.4.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)INVESTRO "classic"

Nr.	Vollausführung	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	INVESTRO
1	<i>Vollausführung</i> execution report ("Trade", "Filled")			←●
			←●	
2	<i>Nachricht an den Auftragsempfänger</i> execution report ("Order Status", "Filled")			←●
			←●	

INVESTRO/Vestima

Nr.	Auftragsausführung und Storno	messageflow			
		FE Customer	BT FIX Gateway	INVESTRO	Vestima
1	<i>Auftragsausführung</i> execution report ("Trade"; "Filled")			MT 515	←●
			←●	←●	
2	<i>Stornierung Auftragsausführung</i> execution report ("Restated", "Filled")			MT 515	←●
			←●	←●	
3	<i>neue Auftragsausführung</i> execution report ("Restated", "Filled")			MT515	←●
			←●	←●	

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 71 von 139

7.2.4.3 Nachricht zur Orderausführung "Execution Report"

Der zugehörige New Order Single Request kann auch nur einen Party Eintrag enthalten (die Entering Firm agiert auch als Executing Firm). Im Execution Report werden in jedem Fall getrennte Einträge mit identischer PartyID erzeugt. Zusätzlich kann auch ein Eintrag für einen Market Maker generiert werden.

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "8" (MsgType)
	<parties>	O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur die Werte 1 –3 können vorkommen
	<entering firm>	O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
	<executing firm>	O	O	OOOOO	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
	<market maker>	O	O	NOOOO	Daten, die den Orderempfänger beschreiben, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig
	<systematic internaliser>	O	O	ONNNN	Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben
	end <parties>				
	<instrument>	M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
	<RegulatoryTradeIDGrp>	O	O	NNMMN	TVTIC (Trading venue transaction identifier)
6	AvgPx	M	M		Schnittpreis, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt
11	ClOrdID	O	M		String(16) Eindeutiger Identifier eines Requests. Eingesetzt wird der Wert, der im letzten für diese Order erfolgreichen FIX Request geliefert wurde Vestima Bei Nachrichten mit Tag 150 (ExecType) D (Restated) enthält die ClOrdID immer "[N/A]"
14	CumQty	M	M		Qty, Float(12,3) Gesamtausführungsmenge
15	Currency	O	O	OOOOO	Currency Handels-Währung am gehandelten Börsenplatz
17	ExecID	M	M		String eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig
31	LastPx	M	M		Price, Float(13,5) Preis der Ausführung
32	LastQty	M	M		Qty, Float(12,3) Volumen der Ausführung
37	OrderID	M	M		String(13) Eindeutige Ordnernummer des Handels- bzw. Abwicklungssystems
38	OrderQty	O	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen (Gesamtvolumen der Order)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 72 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus XONTRO, MAX-ONE, Xetra, Xetra Ffm-2 1 = "Partially Filled" Teilausführung 2 = "Filled" Vollauführung INVESTRO / Vestima 2 = "Filled" Vollauführung (Teilausführungen sind nicht möglich)
44	Price	C	O	CCCNN	Price, Float(13,5) Limit der Order, wird für OrdType "2", "4" und "P" belegt. Fehlt für das Handelssystem MAX-ONE
54	Side	M	M		Char Seite der Order 1 = "Buy" 2 = "Sell"
59	TimeInForce	O	M		Char
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp [microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss] Zeitstempel des Handels- bzw. Abwicklungssystems
64	SettleDate	O	O	NNOOO	LocalMktDate XONTRO, MAX-ONE Valutadatum bei Ausführungen, die vor dem Emissionstermin erfolgen. INVESTRO / Vestima SettlementDate von Vestima. Xetra, Xetra Ffm-2 Das Feld wird nicht geliefert
99	StopPx	C	C		Price, Float(13,5) Stop Limit, wird für OrdType "3" und "4" belegt
100	ExDestination		M		Exchange MIC Code Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt
110	MinQty	O	O	CNNNN	Qty, Float(12,3) Minimal auszuführendes Volumen wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt
150	ExecType	M	M	MMMMC	Char Art des Report alle Systeme das Feld mit F = "Trade" belegt (Nachrichten an den Orderaufgeber) INVESTRO classic Bei Nachrichten an den Auftragsempfänger wird das Feld mit I = "OrderStatus" belegt Vestima wird in folgenden Fällen mit D = "Restated" belegt: - zur Kennzeichnung der Stornierung einer Auftragsausführung durch Vestima oder - zur Kennzeichnung einer Auftragsausführung von Vestima nach dem einer vorherigen Ausführung storniert wurde Bei ExecType = D wird das Tag 11 (ClOrdID) mit "[N/A]" belegt.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 73 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
151	LeavesQty	M	M		Qty, Float(12,3) offene Menge der Order bei Teilausführung 0 bei Vollauführung
157	NumDaysInterest	O	O	OOOON	Integer Stückzinstage analog FIX 4.4 Tag 157 auch für FIX.4.2
432	ExpireDate	O	M		LocalMktDate Ordergültigkeit bis
526	SecondaryClOrdID	O	O	OOOOO	String(16) Bankinterne Ordernummer
1094	PegPriceType		O	CNNNN	Integer wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt
1138	DisplayQty		O	CNNNN	Qty, Float(12,3) Nur für Xetra Iceberg Orders, maximal sichtbares Volumen
5048	OrdSubStatus		O	NNNNC	Char Nur für INVESTRO / Vestima "H" = disabled für die "Kennzeichnung der (Vestima-) Stornierung einer Auftragsausführung". In diesem Fall ist Tag 150 (ExecType) = D. Das Tag 11 (ClOrdID) wird mit [N/A] belegt.
5689	VersionID		O	MMNNN	Integer(18) Xetra, Xetra Ffm-2 Schlüssel zur Updatekontrolle
5944	InitialDisplayQty		O	CNNNN	Qty, Float(12,3) Enthält für Iceberg Orders das ursprünglich eingestellte, maximal sichtbare Volumen
6584	SpreadPctPremium		O	NNNNO	Float(5,3) Bonifikationssatz
6585	SpreadPctDiscount		O	NNNNO	Float(10,7) Wiederanlagerabatt in Prozent
6611	TotalAccruedInterestAmt		O	NNNNO	Float(17,8) Akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag
6893	Profit		O	NNNNO	Float(15,8) Zwischengewinn
7491	CustomPrice1		O	NNNNO	Float(15,8) Ausgabepreis Wird nur belegt wenn bei der Auftrags-Aufgabe die Tags 5076 oder 5078 belegt waren.
7680	OTCInd		M		Integer Kennzeichen börslich 0 = börslich 1 = außerbörslich
9583	MIFIDInternalizationIndicator		O	OONNN	Char Xetra Best Trade Indikator
<standard message trailer>		M	M		

7.2.5 Auslösung einer Aktion über ein anderes Interface

7.2.5.1 Einstellungen, Änderungen und Löschungen von Orders bzw. Aufträgen

Einstellungen, Änderungen, Löschungen von Orders bzw. Aufträgen, die für einen FIX-Teilnehmer relevant sein können, können auch über andere Interfaces als das FIX Interface ausgelöst werden:

- Dialog XONTRO, INVESTRO, MAX-ONE
- Systemanschluss Makler XONTRO
- MAX-ONE GUIs MAX-ONE
- Xetra GUIs Xetra, Xetra Ffm-2
- SAKI-Eingaben INVESTRO
- Eingaben von Vestima OIs INVESTRO

Nachrichten an FIX Teilnehmer werden generiert, wenn das Handels- bzw. Abwicklungssystem eine (vorläufige oder endgültige) **positive Response** am auslösenden Interface generiert. Ist dies der Fall, dann wird ein FIX Teilnehmer auch über alle systemseitig veranlassten Folgeaktivitäten informiert. Entscheidend ist, ob die erste (auslösende) Aktion akzeptiert wird. Dies bedeutet, dass zum Beispiel für eine mit Status "Pending" akzeptierte Orderänderung, die nach Auflösung eines Locked-Stock Zustand abgelehnt wird, ein Execution Report vom Typ "Rejected" an den FIX Teilnehmer verschickt wird. Die Diskussion kann sich auf den Execution Report beschränken. Andere Nachrichtentypen sind nicht betroffen.

Der Execution Report entspricht weitestgehend der Antwort auf einen erfolgreich durchgeführten FIX-Request.

Der Execution Report für jeden Nachrichtentyp wird in folgenden Kapiteln beschrieben:

- Ordereinstellung 7.2.1.5 Response "Execution Report" - Nachrichtendaten
- Orderänderung 7.2.3.4 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv)
- Orderlöschung 7.2.2.4 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv, negativ von Vestima)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 75 von 139

Die Abweichungen im Execution Report (im Vergleich zu Antworten auf FIX Requests) sind:

- Im <parties> Component Block wird ein zusätzlicher Eintrag für die PartyRole **session** erzeugt.
- Der Execution Report liefert OrigClOrdID = [N/A] (Tag 41) und in ClOrdID (Tag 11) den Identifikationsbegriff des letzten erfolgreich durchgeführten Requests, der über das FIX Interface übermittelt wurde (falls vorhanden).

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
Im <parties> Component Block (Tag 453 wird erhöht)					
448	<session> PartyID		M		String KVNr bzw. MemberID des Eingegers
447	PartyIDSource		M		Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole		M		Integer wird mit 55 = "Session ID" belegt
802	NoPartySubIDs		M		NumInGroup wird mit "1" belegt
523	PartySubID		M		String(6) wird mit den letzten 6 Stellen des Identifikationsbegriffs des Eingegers belegt
803	PartySubIDType		M		Integer wird mit "4040" belegt (User Identifier)
11	ClOrdID		M		String(16) Identifikationsbegriff des letzten erfolgreich durchgeführten Requests, der über das FIX Interface übermittelt wurde (falls vorhanden), ansonsten "[N/A]"
41	OrigClOrdID		M		String(16) wird mit "[N/A]" belegt

7.2.5.2 Eingaben über die Investro-Funktion „Sammelerfassung von Aufträgen“

Bei Eingaben über die Investro-Funktion „Sammelerfassung von Aufträgen“ werden ExecutionReports verschickt, wenn der Auftrags-Aufgeber ein FIX-Teilnehmer ist.

Dies ist unabhängig davon, ob der Auftrags-Aufgeber Investro-TN ist oder nicht.

Die Feldbelegung im ExecutionReport entspricht der Beschreibung im Kapitel 7.2.5.1 Einstellungen, Änderungen und Löschungen von Orders.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 76 von 139

7.2.5.3 Umsetzung einer Stop Order

Bei der Umsetzung einer Stop Order wird ein Execution Report generiert.

Der Execution Report entspricht der Antwort auf einen erfolgreich durchgeführten Cancel/Replace Request (vgl. 7.2.3.4) mit folgenden Abweichungen:

- OrdStatus = 0 - "New" (Tag 39).
- Im <parties> Component Block wird ein zusätzlicher Eintrag für die PartyRole **executing system** erzeugt.
- Der Execution Report liefert OrigClOrdID = [N/A] (Tag 41) und in ClOrdID (Tag 11) den Identifikationsbegriff des letzten erfolgreich durchgeführten Requests, der über das FIX Interface übermittelt wurde (falls vorhanden).
- Das Tag 6489 (TriggerIndicator) wird geliefert

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
Im <parties> Component Block (Tag 453 wird erhöht)					
448	<executing system> PartyID		M		String mögliche Werte sind XETRA XETRA-2 XONTRO MAX-ONE
447	PartyIDSource		M		Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole		M		Integer wird mit 16 = "Executing System" belegt
802	NoPartySubIDs		M		NumInGroup wird mit "1" belegt
523	PartySubID		M		String wird mit "[N/A]" belegt
803	PartySubIDType		M		Integer wird mit 3 belegt (System)
11	ClOrdID		M		String(16) Identifikationsbegriff des letzten erfolgreich durchgeführten Requests, der über das FIX Interface übermittelt wurde (falls vorhanden), ansonsten "[N/A]"
39	OrdStatus		M		Char OrderStatus 0 = "New"
41	OrigClOrdID		M		String(16) wird mit "[N/A]" belegt
6489	TriggerIndicator		C	CCCC-	Char "Y" = Trigger Stop Order (fehlt bei der Antwort auf einen normalen Cancel/Replace)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 77 von 139

7.2.5.4 Aktivierung einer EG-Order

Wenn die Aktivierungsregel für eine EG-Order erfüllt ist, wird diese vom skontroführenden Makler aktiviert.

Für diese Aktion wird ein ExecutionReport verschickt. Dieser entspricht weitgehend demjenigen, der für eine Orderänderung über ein externes Interface verschickt wird (vgl. 7.2.5.1 Einstellungen, Änderungen und Löschungen von Orders).

In diesem Fall wird zusätzlich das Tag 6489 (TriggerIndicator) geliefert.

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
6489	TriggerIndicator		C	NNCC-	Char Nur XONTRO und MAX-ONE "A" = Aktivierung einer EG-Order

7.2.5.5 Zurücksetzen einer bereits aktivierten EG-Order auf den ursprünglichen Status "EG"

Eine als EG-Order eingestellte Order, die bereits aktiviert wurde, kann in XONTRO nachträglich vom skontroführenden Makler wieder auf den Status EG zurückgesetzt werden.

Für diese Aktion wird ein ExecutionReport verschickt. Dieser entspricht weitgehend demjenigen, der für eine Orderänderung über ein externes Interface verschickt wird (vgl. 7.2.5.1 Einstellungen, Änderungen und Löschungen von Orders).

In diesem Fall werden zusätzlich die Tags 5253 (OrdTypeExt) und 6489 (TriggerIndicator) geliefert.

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
5253	OrdTypeExt		C	NNCN-	Char Nur XONTRO "E" = EG-Order
6489	TriggerIndicator		C	NNCN-	Char Nur XONTRO "B" = Order auf EG zurückgesetzt

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 78 von 139

7.2.6 Systemgenerierte Orderänderungen und Löschungen

In verschiedenen Situationen werden von den Handelssystemen Orders geändert und gelöscht:

- | | |
|------------------------------------------------------------|---------------------------|
| - Stammdatenänderungen | Änderungen, Löschungen |
| - Kursaussetzungen | Löschungen |
| - Nebenrechte | Änderungen, Löschungen |
| - Nicht akzeptierte EG-Orders (XONTRO) | Löschungen |
| - Orderverfall (MAX-ONE, Xetra, Xetra Ffm-2) | Löschungen |
| - Kassaspitze wegen Teilausführung (XONTRO) | Änderungen, Löschungen |
| - FOK, IOC und Market-to-Limit Orders (Xetra, Xetra Ffm-2) | Löschungen (Restnominale) |
| - Eingaben vom Superuser | Änderungen, Löschungen |

Versendet werden in diesen Fällen Execution Reports, welche weitgehend denjenigen entsprechen, die als Antwort auf einen Cancel/Replace bzw. einen Cancel Request verschickt werden mit folgenden Abweichungen:

- Zusätzlicher Eintrag für die PartyRole **executing system** im <parties> Component Block.
- Zusätzliches Tag 5862 UpdateReason, welches den Änderungs- bzw. Lösch-Grund beinhaltet.
- Bei Löschungen wegen Orderverfall erhalten die FIX Nachrichten zusätzlich einen abweichenden OrdStatus "C" ("expired") und ExecType "C" ("expired").

Die vom Handelssystem XONTRO im Rahmen der Tagesendeverarbeitung geänderten und gelöschten Orders werden am nächsten Morgen an das jeweilige OMS übertragen.

Keine Orderänderungen oder -Löschungen erfolgen bei Zeichnungssperre.

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
Im <parties> Component Block (Tag 453 wird erhöht)					
448	<executing system> PartyID		M		String mögliche Werte sind XETRA XETRA-2 XONTRO MAX-ONE
447	PartyIDSource		M		Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole		M		Integer wird mit 16 = "Executing System" belegt
802	NoPartySubIDs		M		NumInGroup wird mit "1" belegt
523	PartySubID		M		String wird mit "[N/A]" belegt
803	PartySubIDType		M		Integer wird mit "3" belegt (System)
39	OrdStatus		M		Char OrderStatus wird bei Löschung wegen Orderverfall mit "C" belegt (expired)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 79 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
150	ExecType		M		Char Art des Report wird bei Löschung wegen Orderverfall mit "C" belegt (expired)
5862	UpdateReason		O	OOOON	String(15) Grund der systemgenerierten Order-Änderung bzw. – Löschung <u>Stammdatenänderungen</u> "SBSL" = Entfall der SB/SL Fähigkeit der Gattung "MSEG" = Marktsegmentwechsel "EREO" = Datum der Redenominierung "ENOT" = Einstellung der Notierung "MBKS" = Änderung Kassa-Notierung (Mindestbetrag, kleinste handelbare Einheit, Inkrement) "MBVA" = Änderung Variabel-Notierung (Mindestbetrag, kleinste handelbare Einheit, Inkrement) "KSVA" = Notierung von Kassa auf Variabel "KSKH" = Einstellung Notierung Kassa "VAKS" = Notierung von Variabel auf Kassa "VAKH" = Einstellung Notierung Variabel "VKKS" = Kassa und Variabel auf Kassa "VKVA" = Kassa und Variabel auf Variabel "VKKH" = Einstellung Kassa- und Variabel-Notierung "LHBR" = Ende des Bezugsrechtshandels <u>Nebenrechte</u> "EXBR" = Ex Bezugsrecht "EXBA" = Ex Berichtigungsaktien "EXDI" = Ex Dividendenausschüttung "EXAG" = Ex Ausschüttung "EXDA" = Ex Dividendenausschüttung (Auslandsaktien) "EXSP" = Ex Split bei ausländischen Aktien "EXRS" = Ex Reversesplit "EXZS" = Ex Zinsen "EXAZ" = Ex Ausgleichszahlung "EXBO" = Ex Bonusrecht "EABC" = Ex Verschiedene Rechte "HL" = Hinweis (Orderlöschung) "HA" = Hinweis (Limitabschlag) "WKNA" = ISIN-Änderung <u>Weitere Ereignisse</u> "SYSV" = Löschung nicht akzeptierter EG Order "AUSG" = Kursaussetzung " _Z" = Kursaussetzung mit dem Zusatz "gestrichen Ziehung" "XETRABATCH" = Xetra Batch (Löschung, Orderverfall) "XETRAGENERATED" = Löschung Restnominale (FOK, IOC oder MTL Orders) "SUPERUSER" = Eingabe durch den Superuser "KASSASPITZE" = Kassaspitze wegen Teilausführung "ORDEREXPIRED" = Orderverfall in MAX-ONE

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 80 von 139

7.2.7 Componenten Blocks und Repeating Groups

Es werden ausschließlich die folgenden Component Blocks/Repeating Groups der Version 4.4 verwendet:

- Instrument
- Parties
- Trading Sessions
- Order Attributes
- Value Checks
- Regulatory TradeID

7.2.7.1 Instrument Component Block <instrument>**Eingehende Nachrichten**

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
55	Symbol	O	M		String ignoriert
48	SecurityID	O	M		String ISIN
22	SecurityIDSource	O	M		String muss immer = "4" sein

Ausgehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
55	Symbol	O	M		String Wird vom BT-FIX Gateway auf "[N/A]" gesetzt
48	SecurityID	O	M		String ISIN
22	SecurityIDSource	O	M		String Wird vom BT-FIX Gateway auf "4" gesetzt

Der Instrument Component Block wird mit <instrument> referenziert.

7.2.7.2 Party Konzept <parties>

Der "Parties" Component Block wird zur Beschreibung sämtlicher Teilnehmer eines Vorgangs verwendet. Die einzelnen Teilnehmer werden in getrennten Repeating Groups beschrieben.

Der Parties Component Block wird mit <parties> referenziert, die einzelnen Repeating Groups mit <entering firm>, <executing firm>, <market maker>, <systematic internaliser>, <session>, <executing system>, <Client Identification Code>, <Execution within Firm>, <Investment Decision Maker>.

Beispiel:

<entering firm> bedeutet eine Repeating Group innerhalb des Parties Component Block mit PartyRole 7 (Entering Firm).

Eingehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 1 – 6 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
448	PartyID	O	M		String PartyRole=1 (Executing Firm) String(4), zugelassene KVNr des Orderaufgebers PartyRole=3 (Client Identification Code) String(20), Shortcode. (ESMA RTS24 Feld 3) Spezielle Werte: 1 = AGGR 2 = PNAL PartyRole=7 (Entering Firm) String(4), KVNr des Anschlussinhabers PartyRole=12 (Execution within Firm) String(20), Shortcode oder Algorithmus. (ESMA RTS24 Feld 5) Spezielle Werte: 3 = NORE PartyRole=29 (Intermediary) String(10) numerisch, INVESTRO-Vertriebspartner PartyRole=63 (Systematic Internaliser) String(5), Xetra MemberID PartyRole=66 (Market Maker) String(4), KVNr des Maklers PartyRole=122 (Investment Decision Maker) String(20), Shortcode oder Algorithmus. (ESMA RTS24 Feld 4)
447	PartyIDSource	O	M		Char PartyIDSource=D (KVNr), wenn PartyRole gleich 1 = "Executing Firm" 7 = "Entering Firm" 29 = "Intermediary" 63 = "Systematic Internaliser" 66 = "Market Maker" PartyIDSource=P (Shortcode), wenn PartyRole gleich 3 = "Client Identification Code" 12 = "Execution within Firm" 122 = "Investment Decision Maker"

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 82 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
452	PartyRole	O	M		<p>Integer muss mit einem der Werte</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 = "Executing Firm" 3 = "Client Identification Code" 7 = "Entering Firm" 12 = "Execution within Firm" 29 = "Intermediary" 63 = "Systematic Internaliser" 66 = "Market Maker" 122 = "Investment Decision Maker" <p>belegt sein</p>
2376	PartyRoleQualifier	O	O	NNOON	<p>Integer Die Angabe dieses Qualifiers ist nur notwendig, wenn „PartyID“ einen Algorithmus (22) darstellt und keinen Shortcode (Default). Die Differenzierung eines Shortcodes als LEI (23) oder nat. Person (24) ist nicht notwendig und wird ignoriert.</p> <p>22 = „Algorithmus“ Kennzeichnet die PartyID als Algorithmus. Nur erlaubt für PartyRoles 12 = "Execution within Firm" 122 = "Investment Decision Maker"</p> <p>23 = „LEI (Legal Entity Identifier)“ Kennzeichnet die PartyID als Shortcode für einen LEI Nur erlaubt für PartyRole 3 = "Client Identification Code"</p> <p>24 = „Nat. Person“ Kennzeichnet die PartyID als Shortcode für eine natürliche Person Nur erlaubt für PartyRoles 3 = "Client Identification Code" 12 = "Execution within Firm" 122 = "Investment Decision Maker"</p>

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 83 von 139

Ausgehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 1 – 5 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
448	PartyID	O	M		String PartyRole=1 (Executing Firm) String(4), zugelassene KVNr des Orderaufgebers PartyRole=7 (Entering Firm) String(4), KVNr des Anschlussinhabers PartyRole=16 (Executing System) folgende Belegung ist möglich: "XETRA" "XETRA-2" "XONTRO" "MAX-ONE" "INVESTRO" PartyRole=29 (Intermediary) String(10) numerisch, INVESTRO-Vertriebspartner PartyRole=55 (Session ID) String(4), KVNr des Eingebers String(5), Xetra MemberID des Eingebers PartyRole=63 (Systematic Internaliser) String(5), Xetra MemberID PartyRole=66 (Market Maker) String(4), KVNr des Maklers
447	PartyIDSource	O	M		Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole	O	M		Integer wird mit einem der Werte 1 = "Executing Firm" 7 = "Entering Firm" 16 = "ExecutingSystem" 29 = "Intermediary" 55 = "Session ID" 63 = "Systematic Internaliser" 66 = "Market Maker" belegt
802	NoPartySubIDs	O	C		NumInGroup wird mit "1" belegt oder fehlt. Nur für PartyRole 16 und 55 zulässig
523	PartySubID	O	C		String wird für PartyRole 55 mit dem Identifikationsmerkmal des Eingebers bei Eingabe über ein anderes Interface belegt. Wird für PartyRole 16 auf "[N/A]" gesetzt
803	PartySubIDType	O	C		Integer wird für PartyRole 55 mit "4040" belegt (User Identifier) wird für PartyRole 16 mit "3" belegt (System)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 84 von 139

7.2.7.3 Trading Sessions Repeating Group <trading sessions>

Nur bei eingehenden Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
386	NoTradingSessions	O	O	OOOOO	NumInGroup ignoriert Nur der Wert "1" ist zulässig Ist das Tag vorhanden, dann müssen die Tags 336 und 625 direkt folgen
336	TradingSessionID	O	O	OOOOO	String(1) ignoriert Nur der Wert "1" ist zulässig muss vorhanden sein, falls Tag 386 vorhanden ist muss vorhanden sein, falls Tag 625 vorhanden ist
625	TradingSessionSubID	O	O	OOOOO	String muss vorhanden sein, falls Tag 336 vorhanden ist Zulässig sind Xetra, Xetra Ffm-2 2 = "Opening auction only" 3 = "Main trading" 4 = "Closing auction only" 6 = "Main auction" 100 = "Auction only" 101 = "End-of-day auction" 102 = "Pending for next auction" 103 = "Closing crossing" 104 = "Accept surplus" 105 = "Special auction" XONTRO 2 = "Opening auction only" (EK - EK-Order) 6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order) MAX-ONE 6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order) INVESTRO / Vestima Das Feld wird ignoriert Die Belegung der Werte entspricht den FIX 5.0 Definitionen

Statt der Repeating Group <trading sessions> - die immer nur aus einer Instanz bestehen darf – können alternativ auch die einzelnen Tags TradingSessionID (336) und TradingSessionSubID (625) verwendet werden. Das Tag NoTradingSessions (386) darf dann nicht vorhanden sein.

Die Trading Sessions Repeating Group wird mit <trading sessions> referenziert.

7.2.7.4 Order Attribute Repeating Group <OrderAttributes>

Nur bei eingehenden Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
2593	NoOrderAttributes	O	O	NNOON	NumInGroup Anzahl der Order-Attribute. Nur die Werte 1 – 3 sind zulässig. Der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen.
2594	OrderAttributeType	O	O	NNOON	Integer Art des Attributes. 0 = AGGR (Aggregated Order) Die Angabe dieses Attributes schließt die gleichzeitige Angabe der Party <client identification code> aus. (ESMA RTS 24 Feld 3) 1 = PNAL (Pending Allocation) Die Angabe dieses Attributes schließt die gleichzeitige Angabe der Party <client identification code> aus. (ESMA RTS 24 Feld 3) 2 = Liquidity provision activity order (ESMA RTS 24 Feld 8) Nur in NewOrderSingle-Nachricht erlaubt. 6 = NORE Die Angabe dieses Attributes schließt die gleichzeitige Angabe der Party <Execution within firm> aus. (ESMA RTS 24 Feld 5)
2595	OrderAttributeValue	O	O	NNOON	String(1) Wert zum OrderAttributeType Y = Yes

7.2.7.5 Value Checks Repeating Group <ValueChecksGrp>

Nur bei eingehenden Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
1868	NoValueChecks	O	O	NNOON	NumInGroup Anzahl der enthaltenen ValueCheck-Einträge. Nur der Wert 1 ist zulässig.
1869	ValueCheckType	O	O	NNOON	Integer Art des Attributes. 1 = Prüfung auf maximal zulässigen Kurswert am Börsenplatz (ESMA RTS 7 Opt-Out-Flag)
1870	ValueCheckAction	O	O	NNOON	Integer Wert zum ValueCheckType 0 = keine Prüfung 1 = Prüfung durchführen (Default)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 86 von 139

7.2.7.6 Regulatory TradeID Repeating Group <RegulatoryTradeIDGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
1907	NoRegulatoryTradeID	O	O		NumInGroup Nur der Wert 1 ist zulässig.
1903	RegulatoryTradeID	O	O		String(52) TVTIC (Trading venue transaction identifier) Der TVTIC setzt sich zusammen aus: Segment MIC (4 Stellen) + ISIN (12 Stellen) + Börsentag (8 Stellen) + Zeit Kursbestätigung (12 Stellen)
1906	RegulatoryTradeIDType	O	O		Integer Art der Regulatory TradeID 5 = TVTIC (Trading venue transaction identifier)

7.2.8 Besonderheiten der Tag Behandlung

Fehlerhafte Tags eines New Order Single Requests werden in einem Execution Report immer zurückgegeben.

Werden im Rahmen eines erfolgreichen New Order Single Defaultwerte gesetzt, dann werden sie in den Execution Report übernommen. Optionale Tags des Execution Report sind darüber hinaus nur belegt, wenn sie auch im Request vorhanden waren.

Wird eine Order über ein anderes Interface als das FIX Interface eingestellt, dann werden, in bestimmten Fällen, optionale Tags auch dann übermittelt, wenn sie keine signifikanten Werte enthalten, ein Client muss folglich in diesen Konstellationen in der Lage sein Nachrichteninhalte wie 12=0 oder 526=" " zu verarbeiten.

Diese Aussagen gelten auch für Cancel/Replace Requests - soweit dies im Fall abgelehnter Requests bei der eingeschränkten Informationsmenge der Cancel Reject Nachricht möglich ist.

Nachlaufende Spaces werden vom BT-FIX Gateway entfernt; besteht ein Tag nur aus Spaces dann bleibt ein Space erhalten.

Beispiel:

Eine Order wird geändert: der Ordertext wird von "ungleich SPACE" auf "SPACE" geändert.

Diese Änderung wird als ExecutionReport mit Tag 58 = " " übermittelt. Damit ist es eindeutig, dass der neue Ordertext SPACE ist.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 87 von 139

7.3 Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima) - Besonderheiten**7.3.1 Nachrichten an den Auftragsempfänger (INVESTRO "classic")**

Bei positiven Einstellungen und Löschungen von Aufträgen und bei Auftragsausführungen werden "Execution Reports" für den Auftragsempfänger generiert.

Diese entsprechen denjenigen, die für die Einstellung und Löschung von Orders über ein anderes Interface und für die Ausführung von Orders verschickt werden (vgl. 7.2.5 Auslösung einer Aktion über ein anderes Interface, 7.2.4 Order- bzw. Auftragsausführung) mit folgenden Abweichungen:

1. Kennzeichnung der Nachrichten an den Empfänger

Tag 150 (ExecType) = I (Order Status)

Im <parties> Component Block wird ein zusätzlicher Eintrag für die PartyRole **executing system** mit PartyID "INVESTRO" erzeugt.

Damit ist es eindeutig, ob bei einer empfangenen Nachricht die Bank Aufgeber oder Empfänger des Auftrags ist.

2. Folgende Felder werden dem Empfänger nicht geliefert

SecondaryCIOrdID	Tag 526	Bankinterne Ordernummer
Text	Tag 58	Ordertext
PartyID / PartySubID (FIX 4.4)	Tags 448 / 523	ID-KZ des Eingebers (User Identifier)
Source (FIX 4.2)	Tag 5177	ID-KZ des Eingebers (User Identifier)
SpreadPctPremium	Tag 6584	Bonifikationssatz
SpreadPctDiscount	Tag 6585	Wiederanlagerabatt in Prozent
TotalAccruedInterestAmt	Tag 6611	Akkum. ausschüttungsgleicher Ertrag
Profit	Tag 6893	Zwischengewinn
CustomPrice1	Tag 7491	Ausgabepreis

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
Im <parties> Component Block (Tag 453 wird erhöht)					
448	<executing system> PartyID		M		String INVESTRO
447	PartyIDSource		M		Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole		M		Integer wird mit 16 = "Executing System" belegt
802	NoPartySubIDs		M		NumInGroup wird mit "1" belegt
523	PartySubID		M		String wird mit "[N/A]" belegt
803	PartySubIDType		M		Integer wird mit "3" belegt (System)
150	ExecType		M		Char Art des Report wird mit "I" belegt (Order Status)

7.3.2 Auftragsrouting an INVESTRO mit Vestima-Gattungen

7.3.2.1 Direkte Ablehnung in INVESTRO

Auftragseinstellungen und -Löschungen für Vestima Gattungen werden beim Eingang in INVESTRO formal geprüft.

Bei formalen Fehlern (z.B. fehlende Pflichtfelder) werden diese an Vestima nicht weitergeleitet, sondern direkt abgelehnt (vgl. 7.2.1 Order- bzw. Auftragseinstellung und 7.2.2 Order- bzw. Auftragslöschung).

7.3.2.2 Übergabe an Vestima

Nachrichten für Vestima Gattungen werden generell vorläufig bestätigt. Erst nach der Rückmeldung von Vestima wird eine endgültige Bestätigung (positiv oder negativ) ausgegeben.

Zusätzlich können von Vestima Statusänderungen (Prüfungen auf Kontendeckung) zu einem Auftrag geliefert werden, die an die FIX-Teilnehmer als vorläufige Nachrichten weitergegeben werden.

In den oben beschriebenen vorläufigen Bestätigungen werden Execution Reports (Pending-Nachrichten) mit Pending-Reason = 5 (Verification Pending) generiert.

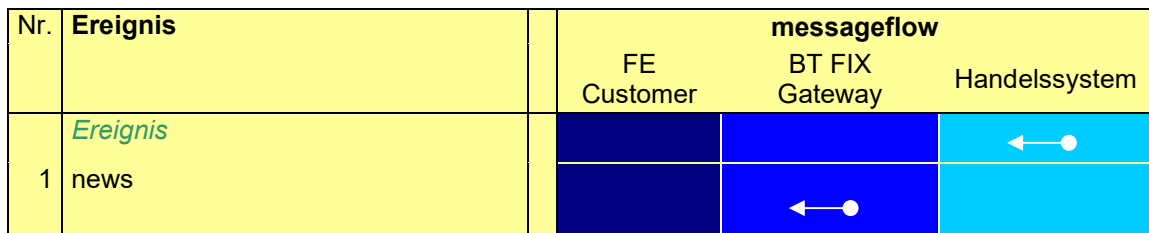
Weitere Information über den Auftragsstatus wird über die FIX-Tags 5048 (OrdSubStatus) und 5476 (PrivateReference) geliefert.

Es ist möglich, dass ein Auftrag von Vestima ausgeführt wird (Mitteilung über SWIFT-Nachricht MT515) und später die Ausführung storniert wird (MT515 CANCEL). Nach dem Storno kann von Vestima wieder eine Ausführung generiert werden (neuer MT515).

Die Information zu den SWIFT-Nachrichten MT515 bzw. MT515-CANCEL wird über ExecutionReports mit speziellen Ausprägungen der Tags 39 (OrdStatus), 150 (ExecType) und 5048 (OrdSubStatus) übermittelt.

7.4 Ereignisse

7.4.1 Abläufe



7.4.2 Ereignismitteilung "News"

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
	<standard message header>	M	M		Tag 35 = "B" (MsgType)
	<LinesOfTextGrp>	O	M		
	<InstrmtGrp>	O	O		
148	Headline		M		String Ereignisschlüssel - FIXOF Kursaussetzung bzw. Zeichnungssperre - FIXON Rücknahme der Kursaussetzung bzw. Zeichnungssperre - TREXP Verlängerung der Börsenzeit für eine Börse - TRINT Unterbrechung der Kursfeststellung - TRSTA Freigabe der Kursfeststellung - BOINT Unterbrechung der Börsenversammlung - NBSTA Freigabe der Börsenversammlung - BOEND, EHEND, XEBAT Handelssystem-spezifische "Ende"- Nachrichten
	<routingGrp>	O	M		
6255	EndTime		O	00000	String Ende Börsenzeit (Ereignis TREXP) Format „HHMM0000“
6516	NewsValidUntil		O	00000	LocalMktDate Datum bis
6517	NewsEventDate		O	00000	LocalMktDate Datum bzw. Datum ab
	<standard message trailer>	M	M		

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 90 von 139

7.4.3 NoLinesOfText Repeating Group <LinesOfTextGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
33	LinesOfText		M		NumInGroup Anzahl Zeilen mit "1" oder "2" belegt
58	Text		M		String 1. Zeile: Text zum Ereignis 2. Zeile optional: " _Z" = Kursaussetzung mit dem Zusatz "gestrichen Ziehung" "PO" = Zeichnungssperre mit dem Zusatz "Public Offering"

7.4.4 NoRelatedSym Repeating Group <InstrmtGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
146	NoRelatedSym	O	O		NumInGroup Anzahl Zeilen mit "1" belegt Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 55, 22 und 48.
55	Symbol	O	C		String ist vorhanden, falls Tag 146 vorhanden ist Wird vom BT-FIX Gateway auf "[N/A]" gesetzt.
22	SecurityIDSource	O	C		String ist vorhanden, falls Tag 146 vorhanden ist Wird vom BT-FIX Gateway auf "4" gesetzt
48	SecurityID	O	C		String ist vorhanden, falls Tag 146 vorhanden ist ISIN

7.4.5 NoRoutingIDs Repeating Group <RoutingGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
215	NoRoutingIDs	O	O		NumInGroup Nur die Werte "1", "2", "3" sind zulässig Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 216 und 217.
216	RoutingType	O	C		Integer Ist vorhanden, falls Tag 215 vorhanden ist. Wird vom BT-FIX Gateway auf "1" gesetzt.
217	RoutingID	O	C		String Ist vorhanden, falls Tag 215 vorhanden ist. Beinhaltet - 1. Group-Element immer Handelssystem - 2. Group-Element immer Börsenplatz - 3. Group-Element immer Empfänger Anmerkungen: Sollte ein Empfänger vorhanden sein, dann sind das Handelssystem und der Börsenplatz ebenfalls vorhanden, u.U. ist der Inhalt "[N/A]". Sollte ein Börsenplatz vorhanden sein, dann ist das Handelssystem ebenfalls vorhanden, u.U. ist der Inhalt "[N/A]"

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 91 von 139

7.5 Tradefunktionalität**7.5.1 Unterstützte Vorfälle**

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten	Empfänger der ausgehenden Nachrichten
OTC-Geschäftseingang	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck	Eingeber
OTC-Geschäftsstorno	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck	Eingeber
OTC-Geschäftsdurchlieferung	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck	Eingeber
MiFID-Report-Eingang	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck	Eingeber
MiFID-Report-Storno	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck	Eingeber
Geschäftsinformationen (Schlussnoten-Realtime)	-	TradeCaptureReportSno	Beide Kontrahenten (abhängig von der Konfiguration der Anschlüsse)

Bei der Einstellung, Storno und Durchlieferung eines OTC-Geschäftes wird immer eine Bestätigung an den Eingeber zurückgegeben (siehe Tabelle oben).

Zusätzlich werden die aus dem Geschäft resultierenden Schlussnoten an beide Kontrahenten verschickt.

Bei Geschäftseingaben in Dialog oder über SAKI werden die beteiligten FIX-Teilnehmer über die generierten Schlussnoten über FIX-Nachrichten informiert.

Bei Geschäften, die aus einer Kursfeststellung und aus Maklereingaben entstehen, werden alle beteiligten FIX-Teilnehmer über die generierten Schlussnoten über FIX-Nachrichten informiert. Die Nachrichten für die Schlussnoten enthalten die Daten über die betroffenen Orders und halben Geschäften.

Die Ausgabe der Schlussnoten-Information (TradeCaptureReportSno) ist abhängig von der Teilnehmer-Konfiguration: diese wird nur an FIX-Teilnehmer geliefert, die für den Bezug von Schlussnoten-Realtime konfiguriert sind.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 92 von 139

7.5.2 Abläufe

Nr.	OTC-Requests MiFID-Requests	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	XONTRO
1	trade capture report			
3	<i>Bestätigung (immer endgültig)</i> trade capture report ack			

Nr.	SNO-Realtime	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	XONTRO
	<i>Schlussnote</i>			
1	trade capture report sno (für den Kontrahent 1)			
2	trade capture report sno (für den Kontrahent 2)			

7.5.3 OTC-Geschäfte und MiFID-Reports - Requests

7.5.3.1 Request "TradeCaptureReport" - Identifikationskriterien

Nachfolgend die FIX-Tags innerhalb des TradeCaptureReport zur Identifikation der Trade-Requests:

	6556 BusinessTransactionType	487 TradeReportTransType	856 TradeReportType
OTC-Geschäftseingang (EnterOTC)	Tag nicht vorhanden	0 (new)	0 (submit)
OTC-Geschäftsstorno (DeleteOTC)	Tag nicht vorhanden	1 (cancel)	6 (TradeReportCancel)
OTC- Geschäftsdurchlieferung (ReverseOTC)	Tag nicht vorhanden	4 (reverse)	0 (submit)
MiFID-Report-Eingang (EnterMifid)	1 (TradeAdvice)	0 (new) 2 (replace) Amendment	0 (submit)
MiFID-Report-Storno (DeleteMifid)	1 (TradeAdvice)	1 (cancel)	6 (TradeReportCancel)

In allen Fällen ist das Tag 571 (TradeReportID) mit einem eindeutigen Wert zu belegen (Unique identifier of trade capture report). Die Eindeutigkeit muss von dem FIX-Teilnehmer sichergestellt werden, da im FIX-Gateway keine Prüfung stattfindet.

Das Feld TradeReportID in den Request-Nachrichten wird in den Response-Nachrichten zurückgegeben.

Für die Stornierung von MiFID-Reports und für die Storno- und Durchlieferung von OTC-Geschäften wird die Geschäftsnummer im Tag 880 (TrdMatchID) angegeben.

In den folgenden Kapiteln werden die Nachrichtenformate für die unterstützten Vorfälle beschrieben.

Die Spalten RF (required FIX) und R (required) enthalten eine der Angaben **M**andatory/**O**ptional, die Spalten EnterOTC bis DeleteMifid die Angaben **M**andatory/**O**ptional/**C**onditional/**N**ot allowed/**I**gnored

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 94 von 139

7.5.3.2 Request "TradeCaptureReport" - Nachrichtendaten

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
	<standard message header>	M	M						Tag 35 = "AE" (MsgType)
30	LastMkt	O	M						Exchange MIC Code Börsenplatz
31	LastPx	M	M						Price, Float(10,4)
32	LastQty	M	M						Qty, Float(13,3)
60	TransactTime	M	M						UTCTimestamp Zeitstempel
64	SettlDate	O		C	I	I	I	I	LocalMktDate Datum Festvaluta Nur mit Tag 5053 gemeinsam zu verwenden.
75	TradeDate	M	M						LocalMktDate Schlusstag (AS) Datum des Abschlusses des Geschäfts.
487	TradeReportTransType	O	M						Integer 0 = new für EnterOTC EnterMiFID 1 = cancel für DeleteOTC DeleteMiFID 2 = replace für EnterMiFID (amendment) 4 = reverse für ReverseOTC
570	PreviouslyReported	M	M	C	C	C	C	C	Boolean wenn Tag 487 = new, dann Tag 570 = N, ansonsten = Y N für EnterOTC EnterMiFID Y für ReverseOTC EnterMiFID (amendment) DeleteOTC DeleteMiFID
571	TradeReportID	M	M						String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom FIX-Client vergeben wird. Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.
572	TradeReportRefID	O	O	N	M	M	N	M	String(16) Identifier des Auftrags, der vom FIX-Client vergeben wird.
578	TradeInputSource	O	O	O	I	I	I	I	String(4) Segment-MIC eines „nicht XONTRÖ Börsenplatzes“ zur Markierung des Geschäfts im Sinne der CSDR.
818	SecondaryTradeReportID	O	O	O	I	I	O	I	String(13) Bankinterne OTC-Nummer, vom FIX-Client vergeben. Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 95 von 139

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMiFid	DeleteMiFid	Kommentare
880	TrdMatchID	O	O	N	M	M	N	M	String(16) ursprüngliche Geschäftsnummer Identifizier - von XONTRON - des ursprünglichen Auftrags.
856	TradeReportType	O	M						Integer 0 (submit) für EnterOTC ReverseOTC EnterMiFID 6 = TradeReportCancel für DeleteOTC DeleteMiFID
	<instrument>	M	M						
	<TrdRegTimestamps>	O		O	I	I	O	I	Abweichender Abschlussstag (AA) bzw. Abschlussdatum.
5053	TradeType2	O		C	I	I	I	I	Integer Festvaluta-Kennzeichnung 1 (DVP) = FZ Nur mit Tag 64 gemeinsam zu verwenden.
5179	TradeTime	O		O	I	I	O	I	String Abschluss-Uhrzeit (hhmmss) <u>EnterOTC / EnterMiFID</u> Default ist die aktuelle Uhrzeit.
5681	ExchangeTradeType	O		C	I	I	I	I	Char Kennzeichen Emissionsgeschäft "1" = Emissionsgeschäft Bei Kombination mit Tag 9473 nur 1=AC zulässig.
6556	BusinessTransactionType	O	O	N	N	N	M	M	String 1 = TradeAdvice
5458	MDDelayed	O	O	I	I	I	O	I	Boolean Delay-Indikator
7017	VolumeIndicator	O	O	I	I	I	M	I	Integer Einheit der Effektennotiz 1 = Stück, 2 = Prozent, 3 = Promille, 4 = Punkte, 9 = Sonstige
7566	TimezoneOffset	O	O	I	I	I	M	I	Integer Abweichung der Abschlussuhrzeit zu UTC. Hier ist anzugeben, wie weit der Ort, dessen Uhrzeit als Abschlussuhrzeit gemeldet wird, von der Universal Time Coordinated (UTC) abweicht.
7567	ReportedPxDiff	O	O	I	I	I	O	I	Boolean Abweichender Preis Indikator
7568	ReportedPxReason	O	O	I	I	I	O	I	Char Verhandelter Preis Indikator "N" = negotiated Trade
7680	OTCInd	O	O	O	I	I	I	I	Integer OTC (Off Exchange order) indicator 0 = börslich 1 = außerbörslich (Default)
	<TrdCaptRptSideGrp>	M	M						

FAGSE

BT-FIX Gateway

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 96 von 139

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
	<standard message trailer>	M	M						

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 97 von 139

7.5.3.3 Instrument Component Block <instrument>

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
55	Symbol	O	M						String Börsenkürzel Wird vom BT-FIX-Gateway ignoriert
48	SecurityID	M	M						String ISIN
22	SecurityIDSource	M	M						String muss immer = "4" sein

Der Instrument Component Block wird mit <instrument> referenziert.

7.5.3.4 NoTrdRegTimestamps Repeating Group <TrdRegTimestamps>

Der "TrdRegTimestamps" Component Block beinhaltet die Repeating Group NoTrdRegTimestamps.

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
768	NoTrdRegTimestamps	O	O	O	I	I	O	I	NumInGroup Nur der Wert 1 sind zulässig. Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 769 und 770.
769	TrdRegTimestamp	O	C	C	I	I	C	I	UTCTimestamp Folgt dem Tag 768, wenn Tag 768 vorhanden ist. Das Feld enthält den (abweichenden) Abschlusstag des Geschäfts bzw. das Abschlussdatum des MiFID-Reports. <u>Enter OTC</u> Erlaubt ist die Eingabe von "Nicht-Börsentagen in der Vergangenheit", wobei diese Eingabe max. 90 Tage zurückreichen darf. Ist das Feld nicht belegt, wird das Geschäft mit dem Datum des aktuellen Börsentags abgeschlossen. <u>Enter MiFID</u> Erlaubt ist die Eingabe von Kalendertagen. Ist das Feld nicht belegt, wird der MiFID-Report mit dem Datum des aktuellen Börsentags generiert.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 98 von 139

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
770	TrdRegTimestampType	O	C	C	I	I	C	I	Integer Ist vorhanden, falls Tag 768 vorhanden ist. Gültige Werte 1 = "Execution Time" (Abschluss- Zeitstempel)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 99 von 139

7.5.3.5 NoTransactionCosts Repeating Group <courtage>

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
9471	NoTransactionCosts	O	O	O	I	I	I	I	NumInGroup Nur der Wert 1 ist zulässig. Ist das Tag vorhanden, dann folgt das Tag 9473. Ggf. folgt das Tag 9476.
9473	TransactionCostCode	O	O	C	I	I	I	I	Char Folgt dem Tag 9471, wenn dieses vorhanden ist. Zulässige Werte sind: 1 = AC (Abweichende Courtage) 2 = FC (Franco Courtage) 3 = FR (Franco Rechnung) 4 = HC (Halbe Courtage) In Kombination mit Tag 5681 nur 1=AC zulässig. Bei 3 = FR ist die Kombination mit den Tags 12.
9476	TransactionCostAmt	O	O	C	I	I	I	I	Float(9,2) Courtage Ist vorhanden, falls Tag 9473 den Wert 1 = AC enthält.

7.5.3.6 NoSides Repeating Group <TrdCaptRptSideGrp>

Der "TrdCaptRptSideGrp" Component Block beinhaltet die Repeating Group NoSides, welche die Repeating Groups NoTransactionCosts und NoPartyIDs beinhaltet.

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
552	NoSides	M	M	2	1	1	1	1	NumInGroup Für EnterOTC: Nur der Wert "2" ist zulässig. Für die die sonstigen Requests: Nur der Wert "1" ist zulässig. Es folgt das Tag 54 (Side).
<Side 1>		M	M						<Side 1> für die Geschäfts-Angaben des Eingebers
<Side 2>		O	O	M	N	N	N	N	<Side 2> für die Geschäfts-Angaben zum Kontrahenten

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 100 von 139

<Side1>

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
54	Side	M	M						Char Seite des Trades 1 = Buy 2 = Sell
37	OrderID	M	M						String Mit "[N/A]" belegt.
	<parties>	O	M						
453	NoPartyIDs	O	M						NumInGroup Nur die Werte "1" bis "4" sind zulässig.
	<entering firm>	O	M						
	<executing firm>	O	O	O	O	O	O	O	
	<report originator>	O	O	N	N	N	M	N	
	<execution venue>	O	O	N	N	N	M	N	
	end <parties>	O	M						
12	Commission	O	O	O	I	I	I	I	Float(9,2) Spesen Das Feld enthält die Angabe des Spesenbetrags. Bei Finanzierungsschätzen ist die Angabe nicht erlaubt.
15	Currency	O	O	M	I	I	M	I	Currency Währung der Notierung. Bei EnterOTC wird das Feld nicht berücksichtigt.
58	Text	O	O	O	I	I	I	I	String(30) Frei wählbarer Text.
155	SettlCurrFxRate	O	O	C	I	I	I	I	Float(10,5) Devisenkurs des Geschäfts. Nur mit Tag 156 gemeinsam zu verwenden.
156	SettlCurrFxRateCalc	O	O	C	I	I	I	I	Char D=divide Nur mit Tag 155 gemeinsam zu verwenden.
6584	SpreadPctPremium	O	O	O	I	I	I	I	Float(5,3) Bonifikationssatz Das Feld enthält die Prozentangabe des Bonifikationssatzes für die Bonifikationsberechnung. Bei Finanzierungsschätzen ist das Feld Mussfeld. Ansonsten ist eine Eingabe nur bei Emissionsgeschäften möglich.
6586	CashOffset	O	O	O	I	I	I	I	Float(9,2) Wiederanlagerabatt Eine Eingabe ist nur bei Investmentzertifikaten möglich.
	<courtage>	O	O	O	I	I	I	I	

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 101 von 139

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
9596	ClientFreeField1	O	O	C	I	I	I	I	String Provision Das Feld ist auf Float(10,3) > 0 eingeschränkt. Nur mit Tag 9597 gemeinsam zu verwenden. Falls Tag 9597 "PM" enthält, muss der Wert <= 99,999 sein Falls Tag 9597 "PD" enthält, muss der Wert <= 9999999,990 sein (letzte Nachkommastelle = 0)
9597	ClientFreeField2	O	O	C	I	I	I	I	String(2) Schlüsselcode zur Provision. Nur mit Tag 9596 gemeinsam zu verwenden. Zulässig sind "PM" = Provisionsatz "PD" = Provisionsbetrag

<Side2>

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
54	Side	M	M	M	N	N	N	N	Char Seite des Trades für "contra firm" 1 = Buy 2 = Sell
37	OrderID	M	M	M	N	N	N	N	String Mit "[N/A]" belegt.
<parties>		O	O						
453	NoPartyIDs	O	O						NumInGroup Nur der Wert "1" ist zulässig.
<contra firm>		O	O	M	N	N	N	N	
end <parties>		O	M						

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 102 von 139

7.5.3.7 Party Konzept <parties>

Der "Parties" Component Block wird zur Beschreibung sämtlicher Teilnehmer eines Vorgangs verwendet.

Der TradeCaptureReport für FIX 4.2 ist eine userdefinierte Message die von der Nachrichtenstruktur identisch zu dem TradeCaptureReport für FIX 4.4 gehalten ist. Sollte ein FIX 4.2 - Teilnehmer auch Trade-Nachrichten beziehen wollen, so muss dieser Teilnehmer die NoPartyIDs Repeating Group vorsehen und auch verarbeiten können.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
453	NoPartyIDs	O	M	NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 1 – 4 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen. Es folgen die Tags 448, 447, 452.
448	PartyID	O	M	String PartyRole=1 (Executing Firm) String(4), zugelassene KVNr des Geschäftseingegers PartyRole=7 (Entering Firm) String(4), KVNr des Anschlussinhabers PartyRole=17 (Contra Firm) String(4), KVNr des Kontrahenten PartyRole=62 (Report Originator) String(11, Code zur Identifizierung des meldenden Instituts PartyRole=73 (Execution Venue) String(12) Hier ist anzugeben, ob das gemeldete Geschäft <ul style="list-style-type: none"> • ein OTC-Geschäft, • ein internalisiertes Geschäft oder • ein auf einer Plattform (und ggf. welcher) zustande gekommenes Geschäft ist. • Konstante "OTC" für OTC-Geschäfte • Konstante "SI" für systematische Internalisierer Zur Identifizierung einer Plattform: <ul style="list-style-type: none"> • "B" plus BIC (ISO 9662, 11-stellig alphanumerisch) • "M" plus MIC (ISO 10383, 4-stellig alphanumerisch) • "I" plus IBEI (ISO 16327, 10-stellig alphanumerisch)
447	PartyIDSource	O	M	Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole	O	M	Integer muss mit einem der Werte 1 = "Executing Firm" 7 = "Entering Firm" 17 = "Contra Firm" 62 = "Report Originator" 73 = "Execution Venue" belegt sein

Der Parties Component Block wird mit <parties> referenziert, die einzelnen Repeating Groups mit <entering firm>, <executing firm>, <contra firm>, <report originator>, <execution venue>.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 103 von 139

7.5.4 OTC-Geschäfte und MiFID-Reports - Responses**7.5.4.1 Response "TradeCaptureReportAck" - Identifikationskriterien**

Nachfolgend die FIX-Tags innerhalb TradeCaptureReportAck zur Identifikation der Trade-Responses.

TradeCaptureReportAck (positive Bestätigung)

	6556 Business TransactionType	487 TradeReport TransType	856 TradeReportType	150 ExecType
OTC Einstellung	nicht vorhanden	0 (new)	0 (submit)	0 (new)
OTC Storno	nicht vorhanden	1 (cancel)	6 (TradeReportCancel)	4 (canceled)
OTC Durchlieferung	nicht vorhanden	4 (reverse)	0 (submit)	0 (new)
MiFID Einstellung	1 (TradeAdvice)	0 (new)	0 (submit)	0 (new)
MiFID Storno	1 (TradeAdvice)	1 (cancel)	6 (TradeReportCancel)	4 (canceled)

In allen Fällen werden die Tags 571 (TradeReportID) und 572 (TradeReportRefID) mit dem Inhalt aus der Request-Nachricht belegt.

Das Tag 880 (TrdMatchID) enthält bei Einstellungen (OTC, MiFID) die generierte Geschäftsnummer bzw. Report-Nummer, bei Durchlieferung die Geschäftsnummer des neu generierten Geschäftes.

Bei Durchlieferungen wird das Tag 6555 (OrigTrdMatchID) mit der Geschäftsnummer aus der Request-Nachricht (Tag 880) belegt.

Bei einer Durchlieferung werden dann beide Geschäftsnummern geliefert:

- Tag 880 (TrdMatchID) neue Geschäftsnummer
- Tag 6555 (OrigTrdMatchID) alte Geschäftsnummer

TradeCaptureReportAck (negative Bestätigung)

Feldbelegung wie bei einer positiven Bestätigung aber mit Tag 150 (ExecType) = 8 (rejected).

In allen Fällen werden die Tags 571 (TradeReportID) und 572 (TradeReportRefID) mit dem Inhalt aus der Request-Nachricht belegt.

Bei Durchlieferungen wird das Tag 6555 (OrigTrdMatchID) mit der Geschäftsnummer aus der Request-Nachricht (Tag 880) belegt. Bei allen anderen Requests wird die Geschäftsnummer aus der Request-Nachricht im Tag 880 geliefert.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 104 von 139

7.5.4.2 Response "TradeCaptureReportAck" - Nachrichtendaten

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMiFid	DeleteMiFid	Kommentare
	<standard message header>	M	M						Tag 35 = "AR" (MsgType)
	<instrument>	M	M						
30	LastMkt	O	M						Exchange MIC Code Börsenplatz, der vom FIX-Client verwendet wurde. Analog FIX 5.0 Definition von TradeCaptureReportAck.
58	Text	O	C	C	C	C	C	C	String Fehlertext des Handels- bzw. Abwicklungssystems Gemeinsam mit den Tags 751, 5555, 9803.
60	TransactTime	M							UTCTimestamp Zeitstempel
150	ExecType	M	M						Char Art des Reports. 0 = "New", bei erfolgreichem EnterOTC ReverseOTC EnterMiFid, 4 = "Canceled", bei erfolgreichem DeleteOTC DeleteMiFid 8 = "Rejected", bei Ablehnung
487	TradeReportTransType	O	M						Integer 0 = "new", wenn Antwort auf EnterOTC EnterMiFID 1 = "cancel", wenn Antwort auf DeleteOTC DeleteMiFID 2 = "replace", wenn Antwort auf EnterMiFID 4 = "reverse", wenn Antwort auf ReverseOTC
571	TradeReportID	M	M						String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom FIX-Client vergeben wurde. Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.
572	TradeReportRefID	O	O	N	M	M	N	M	String(16) Identifier des Auftrags, der vom FIX-Client vergeben wurde. Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.
751	TradeReportRejectReason	O	O	O	O	O	O	O	Integer Reject-Reason Nur wenn Tag 150 = 8, dann 99 = Other Gemeinsam mit den Tags 58, 5555, 9803.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 105 von 139

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	ReverseOTC	EnterMifid	DeleteMifid	Kommentare
818	SecondaryTradeReportID	O	O	O	-	-	O	-	String(13) Bankinterne OTC-Nummer, die vom FIX-Client vergeben wurde. Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.
856	TradeReportType	O	M						Integer 0 = "submit", wenn Antwort auf EnterOTC ReverseOTC EnterMIFID 6 = "TradeReportCancel", wenn Antwort auf DeleteOTC DeleteMIFID
880	TrdMatchID	O	M						String(16) Geschäftsnummer Bei positiver Antwort: Eindeutiger Identifier des Auftrags vom Handels- bzw. Abwicklungssystem vergeben. Bei negativer Antwort, "[N/A]".
5555	ReturnCode	O	C	C	C	C	C	C	Integer Fehlercode (bspw. 3730) Gemeinsam mit den Tags 58, 751, 9803.
6555	OrigTrdMatchID	O	O	-	-	M	-	-	String(16) Alte Geschäftsnummer, wie sie vom FIX-Client im Request als TrdMatchID verwendet wurde.
6556	BusinessTransactionType	O	O	N	N	N	M	M	String 1 = TradeAdvice
9591	PriceCheckingFlag	O	O	-	-	-	O	-	Integer Indikator für einen PriceAlert. 2 = severe (PriceAlert)
9803	TradingSystemID	O	C	C	C	C	C	C	Integer Identifikation des Systems, welches den Fehlercode erzeugt hat. Gemeinsam mit den Tags 58, 751, 5555.
<standard message trailer>		M	M						

7.5.4.3 Instrument Component Block <instrument>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
22	SecurityIDSource	O	M	String Wird vom BT-FIX Gateway auf "4" gesetzt
48	SecurityID	O	M	String ISIN
55	Symbol	O	M	String Wird vom BT-FIX Gateway auf "[N/A]" gesetzt

7.5.5 Schlussnoten-Realtime

Die Schlussnoten-Informationen werden den Teilnehmern über eine User-Defined Nachricht "TradeCaptureReportSno" (MsgType ,USN') übermittelt.

Diese wird analog dem für FIX 4.4 definierten TradeCaptureReport (MsgType AE), aber ohne die Restriktion für das Tag 552 (NoSides), definiert: in FIX 4.4 und FIX 5.0 kann dieses Tag nur die Werte 1 und 2 enthalten. In der neuen Nachricht "TradeCaptureReportSno" sind für das Tag 552 (NoSides) Werte größer 2 möglich.

Zu einer Schlussnote können 1 oder mehrere Nachrichten geliefert werden.

Jeder "TradeCaptureReportSno" kann bis zu 15 Orderreferenzen enthalten.

Die Orderreferenzen werden als zusätzliche "Sides" innerhalb der Repeating Group "NoSides" (Tag 552) übermittelt.

Die Anzahl von "TradeCaptureReportSno" Nachrichten, die zu einer Schlussnote geliefert werden, ist von der Anzahl von Orderreferenzen abhängig: bei 1 bis 15 Orderreferenzen wird eine einzelne Nachricht geliefert, bei über 15 Orderreferenzen werden mehrere Nachrichten mit jeweils bis zu 15 Orderreferenzen geliefert.

Orderreferenzen werden geliefert, wenn das Geschäft aus Orders entstand und der Teilnehmer für den Empfang von Ordernummer konfiguriert ist (Einstellung über die Teilnehmer-Konfiguration). Je nach Einstellung werden entweder die DWZ- oder die bankinternen Ordernummern geliefert.

Diese Logik wird entsprechend auch bei den manuellen Eingabe-Bezügen angewandt.

Die letzte Nachricht zu einer Schlussnote wird über das Tag 9954 (NextMsgFlag) mit der Ausprägung "N" gekennzeichnet. Alle vorherigen Nachrichten (falls welche vorhanden) werden mit der Ausprägung "Y" gekennzeichnet.

Alle zu einer Schlussnote zusammengehörenden Nachrichten werden zusammen (d.h. ohne weitere Nachrichten dazwischen) geliefert.

Die verschiedenen Nachrichten zu einer Schlussnote unterscheiden sich nur bei den Orderreferenzen. Die allgemeinen Daten (Geschäftsdaten, Kontrahenten...) werden in jeder Nachricht (redundant) geliefert. Das Tag 6732 (DealerNote) wird jedoch nur einmalig in der ersten Nachricht geliefert. Das Tag 880 (TrdMatchID) enthält die Geschäftsnummer.

Das Tag 571 (TradeReportID) wird in jeder Nachricht mit einem eindeutigen, von XONTRO vergebenen Wert belegt.

Die Verknüpfung aller zusammengehörenden Nachrichten erfolgt über die Geschäftsnummer und die Geschäftsart und die Satzart, die in den FIX-Tags 880 (TrdMatchID) und 54 (Side) und 829 (TrdSubType) bei jedem „TradeCaptureReportSno“ geliefert werden.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 107 von 139

7.5.5.1 Geschäftsinformation "TradeCaptureReportSno"

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
	<standard message header>	M		Tag 35 = "USN" (MsgType)
	<instrument>	M		
30	LastMkt	O	M	Exchange MIC Code Börsenplatz
31	LastPx	M		Price, Float(10,4) Kurs
32	LastQty	M		Qty, Float(13,3) Geschäfts-Nominale
75	TradeDate	M		LocalMktDate Schlusstag Datum des Geschäfts-Abschlusses (ggf. abweichender AS).
60	TransactTime	M		UTCTimestamp Zeitstempel des sendenden Systems
64	SettlDate	O	C	LocalMktDate Datum Festvaluta Nur mit Tag 5053 gemeinsam.
283	LocationID	O	M	String Börsenplatz des Meldewesens Wird als FIX-Data-Type Exchange geliefert. Xontro-Börsen "XBER" = Berlin "XDUS" = Duesseldorf "XETR" = Xetra "XFRA" = Frankfurt "XHAM" = Hamburg "XHAN" = Hannover "XINV" = Investro Abwicklungssystem "XMUN" = Muenchen "XSTU" = Stuttgart Nicht-Xontro-Börsen "BAAD" = Unterschleißheim - Baader Bank "BMTF" = London - Bloomberg Trading Facility "BTFE" = Amsterdam - Bloomberg Trading Facility "CATS" = Stuttgart - cats "EUWA" = Stuttgart - EUWAX AG "HAML" = Hamburg - Hanseatische Wertpapierbörse Hamburg - Lang & Schwarz Exchange "LSSI" = Düsseldorf - Lang & Schwarz - Wertpapierhandel "MAEL" = London - MarketAxess Europe "TGAT" = Berlin - Tradegate Exchange "TQEX" = Amsterdam - Turquoise Europe "TREU" = London - Tradeweb Europe "TRQX" = London - Turquoise "XEQT" = Berlin - Börse Berlin Equiduct Trading "XMUN" = München - Börse München - gettex "XQTX" = Düsseldorf - Börse Düsseldorf - Quotrix "XSTF" = Stuttgart - Baden-Württembergische Wertpapierbörse - Technical Platform 2 "XSTU" = Stuttgart - Baden-Württembergische Wertpapierbörse
487	TradeReportTransType	O	M	Integer 0 = new
570	PreviouslyReported	M	M	Boolean N = no
571	TradeReportID	M	M	String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der von XONTRO vergeben wird.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 108 von 139

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
578	TradeInputSource	O	O	String(4) Segment-MIC eines „nicht XONTRO Börsenplatzes“ zur Markierung des Geschäfts im Sinne der CSDR.
<TrdRegTimestamps>		O		- Abschlussdatum + abweichende Abschlussuhrzeit (AU) Wurde ein Abweichendes Abschlussdatum (AA) eingegeben, so wird dieser in das Abschlussdatum übernommen, ansonsten ist das Abschlussdatum immer der Schlusstag aus dem Tag 75. - Eingabezeit
820	TradeLinkID	O	O	String(16) Wegen-Geschäftsnummer
828	TrdType	O	O	Integer OTC Post-trade indicator Indikator für die Art der Transaktion gemäß ESMA RTS 22 Feld 63. 9001 = ACTX (Agency cross transaction) 9002 = CANC (Cancellation) 9101 = ACTX CANC (Agency cross transaction and Cancellation)
829	TrdSubType	O	M	Integer Satzart siehe Kapitel 14 Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart) bspw. 9012= "Kauf - Direktgeschäft"
856	TradeReportType	O	M	Integer 0 = submit
880	TrdMatchID	O	O	String(16) Geschäftsnummer
1125	OrigTradeDate	O	O	LocalMktDate ursprünglicher Schlusstag (bei Aufgabenschließung und -weitergabe)
1126	OrigTradeID	O	O	String(16) Ursprünglicher Geschäftsnummer (bei Aufgabenschließung, Aufgabenweitergabe und Durchlieferung)
<RegulatoryTradeIDGrp>		O	O	TVTIC (Trading venue transaction identifier)
5053	TradeType2	O	C	Integer Festvaluta-Kennzeichnung 1 (DVP) = FZ 7 (when issued) = FE Nur mit Tag 64 gemeinsam.
5494	LastTrader	O	O	Integer Ursprünglicher Makler (bei Aufgabenschließung und -weitergabe)
5665	MKTXPriceDiff	O	O	Float(15,2) Kurs-Differenz-Betrag Wenn negativer Betrag, dann überweist der Makler. Ansonsten erhebt der Makler.
6034	ConcessionAmt	O	O	Float(9,2) Boni-Differenz-Betrag
6475	ClientIndicator	O	O	Char Y = "IW-Geschäft"
6732	DealerNote	O	O	String(350) diverse SAKI-Feldinhalte mit \ getrennt. In TradeCaptureReportSno wurden alle relevanten Tags zur Beschreibung eines Geschäfts definiert. Im Tag 6732 werden Feldinhalte, die zusätzlich in einer SAKI-SNO-Nachricht bzw. aufgrund von zusätzlichen Anforderungen enthalten sind, aufgenommen. Kennzeichen Lieferfreigabe ab 3.6.2013 immer Space\ Abweichender Kontrahentenkurs \ Kennzeichen für Abweichender Schlusstag \ Art des Wertpapiers \

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 109 von 139

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
				Verwahrmöglichkeit \ Zinstermin \ APMT-Konstante \ Abschlusskurs-Währung \ Kurswert-Währung \ Kursdifferenz-Währung \ Stückzins-Währung \ Kennzeichen für Courtage \ Kennzeichen für Spesen \ Kennzeichen für Wiederanlagerabatt \ Kennzeichen für Bonifikation \ Kennzeichen für Boni-Differenz \ Kennzeichen für Provision \ Courtage-Währung \ Spesen-Währung \ Wiederanlagerabatt-Währung \ Bonifikations-Währung \ Boni-Differenz-Währung \ Provisions-Währung \ Kennzeichen für Wiederanlagerabatt \ Kennzeichen für Bonifikation \ Bonischlüssel \ Kennzeichen für Boni-Differenz \ Kennzeichen für Order-Referenz \ Eingebener-ID \ Formate und Werte siehe im Kapitel Anhang C: Benutzerdefinierte Tags
7017	VolumeIndicator	O	O	Integer Einheit der Effektennotiz 1 =Stück, 2 = Prozent, 3 = Promille
7680	OTCIInd	O	M	Integer OTC (Off Exchange) indicator 0 = börslich 1 = außerbörslich
9954	NextMsgFlag	O	M	Boolean Y = (weitere) Folgesätze werden geliefert N = keine (weiteren) Folgesätze
9807	RegFeeFlag	O	O	Char Courtage-Schlüssel aus der jeweiligen Courtage Staffel. Hierbei ist zu beachten, dass Schlussnoten, die aus der Zuteilung heraus erstellt werden, keinen Courtage-Schlüssel erhalten, da in diesem Fall evtl. die Ursprungsnominale verändert wurde.
9893	DiscountRate	O	O	Float(9,7) Diskontsatz (Nur für Finanzierungsschätze)
	<SnoRealtimeSideGrp>	M		
	<standard message trailer>	M	M	

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 110 von 139

7.5.5.2 Instrument Component Block <instrument>

Der "Instrument" Component Block beinhaltet die Repeating Group NoSecAltID.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
55	Symbol	O	M	String Börsenkürzel Wird vom BT-FIX Gateway ggf. "[N/A]" gesetzt
48	SecurityID	O	M	String ISIN
22	SecurityIDSource	O	M	String Wird vom BT-FIX Gateway auf "4" gesetzt
223	CouponRate	O	O	Float(13,9) Zinssatz
228	Factor	O	C	Float(10,9) Poolfaktor / Umrechnungsfaktor Mit Tag 691 zusammen.
240	RedemptionDate	O	O	LocalMktDate Letzter Tilgungstermin (letzte Fälligkeit)
<SecAltIDGrp>		O	O	
691	Pool	O	C	String Kennzeichen für Tag 228. 1 = PF (Poolfaktor) 2 = FS (Fundierungsschuldverschreibungen) 3 = IK (Indexierungskoeffizient)
6611	TotalAccruedInterestAmt	O	O	Float(17,8) Akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag Das Feld wird gefüllt, sofern ein akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag in WSS hinterlegt ist oder falls der akkumulierte ausschüttungsgleiche Ertrag in der Geschäftseingabe INVESTRO eingegeben wurde. Bei Vestima-Geschäften ist das Feld nicht belegt.
6893	Profit	O	O	Float(15,8) Zwischengewinn Das Feld wird gefüllt, sofern ein Zwischengewinn in WSS hinterlegt ist oder der Zwischengewinn in der Geschäftseingabe INVESTRO eingegeben wurde. Bei Vestima-Geschäften ist das Feld nicht belegt.
7491	CustomPrice1	O	O	Float(15,8) Ausgabepreis Das Feld wird gefüllt bei Kaufaufträgen, die zur Wiederanlage oder zur Rücknahme preisausgezeichnet wurden oder falls der Ausgabepreis in der Geschäftseingabe INVESTRO (Kürzel „AP“) eingegeben wurde. Bei Vestima-Geschäften ist das Feld nicht belegt.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 111 von 139

7.5.5.3 NoSecAltID Repeating Group <SecAltIDGrp>

Der SecAltIDGrp Component Block beinhaltet die Repeating Group NoSecAltID.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
454	NoSecAltID	O	O	NumInGroup Wird vom BT-FIX Gateway auf die Werte 1, 2 oder 3 gesetzt. Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 455 und 456.
455	SecurityAltID	O	C	String WP-Kurzbezeichnung WKN ISIN Ist vorhanden, falls Tag 454 vorhanden ist.
456	SecurityAltIDSource	O	C	String Wird vom BT-FIX Gateway auf "8" = "Exchange Symbol" (WP-Kurzbezeichnung) "B" = "Wertpapier" (WKN) "4" = "ISIN" gesetzt. Ist vorhanden, falls Tag 454 vorhanden ist.

7.5.5.4 NoTrdRegTimestamps Repeating Group <TrdRegTimestamps>

Der "TrdRegTimestamps" Component Block beinhaltet die Repeating Group NoTrdRegTimestamps.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
768	NoTrdRegTimestamps	O	O	NumInGroup Nur die Werte 1 und 2 sind zulässig. Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 769 und 770.
769	TrdRegTimestamp	O	C	UTCTimestamp [microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss] Ist vorhanden, falls Tag 768 vorhanden ist.
770	TrdRegTimestampType	O	C	Integer Ist vorhanden, falls Tag 768 vorhanden ist. Gültige Werte 1 = "Execution Time" (Abschluss-Zeitstempel) 2 = "Time In" (Eingabezeit)

7.5.5.5 NoMiscFees Repeating Group <gebühren>

Der "MiscFeesGrp" Component Block beinhaltet die Repeating Group NoMiscFees.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
136	NoMiscFees	O	O	NumInGroup Nur der Wert 1 ist zulässig. Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 137, 138 und 139.
137	MiscFeeAmt	O	C	Float(9,2) Gebühren, die Differenz - wenn ungleich 0 - aus dem ausmachenden Betrag und dem Kurswert. Ist vorhanden, falls Tag 136 vorhanden ist.
138	MiscFeeCurr	O	C	Currency Ist vorhanden, falls Tag 136 vorhanden ist. Währung zur Gebühr
139	MiscFeeType	O	C	String "7" = Other

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 112 von 139

7.5.5.6 NoTransactionCosts Repeating Group <courtage>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
9471	NoTransactionCosts	O	O	NumInGroup Nur der Wert 1 ist zulässig. Ist das Tag vorhanden, dann folgt das Tags 9473 und ggf. 9476
9473	TransactionCostCode	O	C	Char Ist vorhanden, falls Tag 9471 vorhanden ist. Zulässige Werte sind: 0 = Standardcourtage 1 = AC (Abweichende Courtage) 2 = FC (Franco Courtage) 3 = FR (Franco Rechnung) 4 = HC (Halbe Courtage) 5 = PC (Prozentcourtage, nur bei maklervermittelten Geschäften möglich)
9476	TransactionCostAmt	O	C	Float(9,2) Courtage Ist vorhanden, falls Tag 9471 vorhanden ist.

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 113 von 139

7.5.5.7 NoSides Repeating Group <SnoRealtimeSideGrp>

Die Repeating Group NoSides beinhaltet die Repeating Groups NoTransactionCosts, NoMiscFees und NoPartyIDs.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
552	NoSides	M	M	NumInGroup Nur die Werte größer gleich 2 sind zulässig. Es folgt das Tags 54 (Side).
<Side 1>		M	M	<Side 1> für die Geschäfts-Angaben des Eingebers
<Side 2>		O	O	<Side 2> für die Geschäfts-Angaben zum Kontrahenten
<Side #>		O	O	<Side 3> bis <Side n> für die Orderreferenzen

<Side1>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
54	Side	M	M	Char Seite des Trades für <entering firm> 1 = Buy 2 = Sell
37	OrderID	M	M	String Mit "[N/A]" belegt.
<parties>		O	M	
453	NoPartyIDs	O	M	NumInGroup Nur die Werte "1" bis "6" sind zulässig.
<customer account>		O	M	Daten, die den SNO-Empfänger beschreiben.
<executing firm>		O	O	Daten, die den Eingeber beschreiben.
<buyer seller>		O	O	Daten, die den Käufer / Verkäufer beschreiben.
<order origination trader>		O	O	Händlernummer
<clearing firm>		O	O	KVNr des Clearers
<clearing organization>		O	O	KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei internem Settlement. KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei bilaterale Aggregation.
end <parties>		O	M	
1	Account	O	O	String(2), Aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number. Ist jeweils das 'Kennzeichen Eigengeschäft' des Empfängers der Geschäftsbestätigung. Eine Ausnahme bilden Schlussnoten, bei denen es sich um Eigengeschäfte des Maklers handelt. Hier wird nicht das 'Kennzeichen Eigengeschäft' des Empfängers der Geschäftsbestätigung, sondern das 'Kennzeichen Eigengeschäft' des Eingebers abgebildet. Bei Bankdirektgeschäften wird dieses Kennzeichen n i c h t gefüllt. Möglicher Wertebereich: EA – Eigengeschäft des Maklers aus systemseitiger Aufgabenschließung EE – Eigengeschäft des Maklers P1 – Eigengeschäft der Bank A1 – Kundengeschäft der Bank

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 114 von 139

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
12	Commission	O	O	Float(9,2) Spesen Das Feld enthält die Angabe des Spesenbetrags. Bei Finanzierungsschätzen ist die Angabe nicht erlaubt.
58	Text	O	O	String(35) frei wählbarer Text. mit ggf. vorangestellten Präfix: "BOSS/" bei XONTRÖ-Order-Geschäften "INVESTRO/" bei INVESTRO-Geschäften "EUFO/" bei EUFO-Geschäften "MAX/" bei Max-One-Geschäfte "FIX/" bei OTC-Geschäften, die über FIX erfasst wurden. "FIXF/" bei OTC-Geschäften, die über FIX fremd-erfasst wurden.
157	NumDaysInterest	O	C	Integer Zinstage, wenn Tag 5427 = I Diskonttag, wenn Tag 5427 = D
159	AccruedInterestAmt	O	C	Amt, Float(12,2) Zinsbetrag, wenn Tag 5427 = I Diskontbetrag, wenn Tag 5427 = D
119	SettlCurrAmt	O	O	Amt, Float(12,2) Ausmachender Betrag
120	SettlCurrency	O	O	Currency Währung des Ausmachender Betrags.
155	SettlCurrFxRate	O	C	Float(10,5) Devisenkurs des Geschäfts. Nur mit Tag 156 gemeinsam zu verwenden.
156	SettlCurrFxRateCalc	O	C	Char D=divide Nur mit Tag 155 gemeinsam zu verwenden.
381	GrossTradeAmount	O	O	Amt, Float(15,2) Kurswert
5427	IntrAttribType	O	C	Char Kennzeichen, ob Zins- oder Diskont-Felder - Tags 157 und 159 - geliefert werden. I = Interest (Zinsen) D = Discount (Diskont)
6583	SpreadPremium	O	O	Float(9,2) Bonifikationsbetrag
6584	SpreadPctPremium	O	O	Float(5,3) Bonifikationssatz Das Feld enthält die Prozentangabe des Bonifikationssatzes für die Bonifikationsberechnung.
6585	SpreadPctDiscount	O	O	Float(10,7) Wiederanlagerabatt in Prozent
6586	CashOffset	O	O	Float(9,2) Wiederanlagerabatt
7493	CustomRate1	O	O	Float(4,2) Ausgabeaufschlag
9596	ClientFreeField1	O	O	String Provision Das Feld ist auf Float(10,3) > 0 eingeschränkt. Nur mit Tag 9597 gemeinsam zu verwenden. Falls Tag 9597 "PM" enthält, muss der Wert <= 99,999 sein Falls Tag 9597 "PD" enthält, muss der Wert <= 9999999,990 sein (letzte Nachkommastelle = 0)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 115 von 139

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
9597	ClientFreeField2	O	O	String(2) Schlüsselcode zur Provision. Nur mit Tag 9596 gemeinsam zu verwenden. Zulässig sind "PM" = Provisionsatz "PD" = Provisionsbetrag
9938	ClearingHandlingType	O	O	Char Kennzeichen des (Handels-)Schlussnote für internes Settlement oder bilaterale Aggregation. Das Geschäft wird nicht an Clearstream geliefert. "I" = internes Settlement "A" = bilaterale Aggregation Kennzeichen des Abwicklungs-Geschäfts bei bilateraler Aggregation. Das Geschäft wird an Clearstream geliefert. "B" = bilaterale Aggregation
	<gebühren>	O	O	
	<courtage>	O	O	

<Side2>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
54	Side	M	M	Char Seite des Trades für "contra firm" 1 = Buy 2 = Sell
37	OrderID	M	M	String Mit "[N/A]" belegt.
	<parties>	O	M	
453	NoPartyIDs	O	M	NumInGroup Nur die Werte "2" bis "7" sind zulässig.
	<contra firm>	O	M	KVNr des Kontrahenten.
	<contra firm>	O	O	LEI (Legal Entity Identifier) des Kontrahenten.
	<buyer seller>	O	M	Daten, die den Käufer / Verkäufer beschreiben. Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann Verkäufer. Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy, dann Käufer.
	<settlement location>	O	O	PSET, Vestima-BIC des Place of Settlement.
	<agent>	O	O	DEAG / REAG, Vestima-BIC des Delivering / Receiving Agent. Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann DEAG. Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy, dann REAG.
	<custodian>	O	O	DECU / RECU, Vestima-BIC des Delivering / Receiving Custodian. Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann DECU. Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy, dann RECU.
	<buyer seller>	O	O	BUY / SELL, Vestima-BIC des Käufers / Verkäufers. Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann SELL. Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy, dann BUY.
	end <parties>	O	M	

<Side 3 bis n>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
54	Side	M	M	Char Seite des Trades für <entering firm> 1 = Buy 2 = Sell

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 116 von 139

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
37	OrderID	M	C	String(16) Ordernummer (Ordernummer des Handelssystems) Bankinterne Ordernummer (SecondaryClOrdID) oder Bankinterne OTC-Nummer (SecondaryTradeReportID) oder Eingabenummer ("Halbe Geschäftsnummer" beginnend mit "MAN") Zusammen mit Tag 6141
119	SettlCurrAmt	O	C	Float(10,4) Anteiliger Abrechnungsbetrag
6141	TradeQty	O	C	Qty, Float(12,3) Ausgeführte Nominale Zusammen mit Tag 37 (OrderID).

7.5.5.8 Party Konzept <parties>

Der "Parties" Component Block wird zur Beschreibung sämtlicher Teilnehmer eines Vorgangs verwendet.

Der TradeCaptureReportSno für FIX 4.2 und FIX 4.4 ist eine userdefinierte Message. Sollte ein FIX 4.2 - Teilnehmer auch Trade-Nachrichten beziehen wollen, so muss dieser Teilnehmer die NoPartyIDs Repeating Group vorsehen und auch verarbeiten können.

Der Parties Component Block wird mit <parties> referenziert, die einzelnen Repeating Groups mit <executing firm>, <clearing firm>, <settlement location>, <order origination trader>, <contra firm>, <clearing organization>, <customer account>, <buyer seller>, <custodian>, <agent>, <report originator>, <execution venue>.

Ausgehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 2 – 7 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
448	PartyID	O	M		String PartyRole=1 (Executing Firm) String(4), zugelassene KVNr des Orderaufgebers bzw. Geschäftseingegers PartyRole=4 (Clearing Firm) String(4), KVNr des Clearers PartyRole=10 (Settlement Location) String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (PSET) PartyRole=11 (Order Origination Trader) String(6), Händlernummer PartyRole=17 (Contra Firm) String(4), KVNr des Kontrahenten, wenn PartyIDSource = D String(20), LEI (Legal Entity Identifier) des Kontrahenten, PartyIDSource = N PartyRole=21 (Clearing Organization) String(4) KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei internem Settlement KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei bilaterale Aggregation PartyRole=24 (Customer Account) String(4), KVNr des SNO-Empfängers PartyRole=27 (Buyer Seller) String(4), KVNr des Käufers / Verkäufers, bei PartyIDSource=D String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (SELL/BUY), bei PartyIDSource=B PartyRole=28 (Custodian) String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DECU/RECU) PartyRole=30 (Agent) String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DEAG/REAG)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 117 von 139

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
447	PartyIDSource	O	M		Char muss immer = "D", bei PartyRole 1, 4, 11, 21, 24 oder = "B", bei PartyRole 10, 28, 30 oder = "D" oder "B", bei PartyRole 27 oder = „D“ oder „N“ bei PartyRole 17 sein
452	PartyRole	O	M		Integer wird mit einem der Werte 1 = "Executing Firm" 4 = "Clearing Firm" 10 = "Settlement Location" 11 = "Order Origination Trader" 17 = "Contra Firm" 21 = "Clearing Organization" 24 = "Customer Account" 27 = "Buyer Seller" 28 = "Custodian" 30 = "Agent" belegt
	PtysSubGrp	O	C		Nur für PartyRole 27, 28 und 30 zulässig

7.5.5.9 NoPartySubIDs Repeating Group <PtysSubGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
802	NoPartySubIDs	O	C		NumInGroup wird mit "1" oder "2" belegt. Nur für PartyRole 27, 28 und 30 zulässig
523	PartySubID	O	C		String(35) wird für PartyRole 27, 28 und 30 mit weiteren Identifikationsmerkmal des Safe-Accounts belegt.
803	PartySubIDType	O	C		Integer für PartyRole 27 mit "4050" (Buy/Sell Safe Account) für PartyRole 30 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell mit "4060" (DEAG-Safe-Account), für PartyRole 30 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy mit "4070" (REAG-Safe-Account) , für PartyRole 28 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy mit "4080" (DECU-Safe-Account), für PartyRole 28 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell mit "4090" (RECU-Safe-Account).

7.5.5.10 Regulatory TradeID Repeating Group <RegulatoryTradeIDGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
1907	NoRegulatoryTradeID	O	O		NumInGroup Nur der Wert 1 ist zulässig.
1903	RegulatoryTradeID	O	O		String(52) TVTIC (Trading venue transaction identifier) Der TVTIC setzt sich zusammen aus: Segment MIC (4 Stellen) + ISIN (12 Stellen) + Börsentag (8 Stellen) + Zeit Kursbestätigung (12 Stellen)
1906	RegulatoryTradeIDType	O	O		Integer Art der Regulatory TradeID 5 = TVTIC (Trading venue transaction identifier)

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 118 von 139

8 Anhang A: Beispiele

Auf eine Berechnung der Tags 9 (Nachrichtenlänge) und 10 (Checksum) wurde in den Beispielnachrichten verzichtet. Sie stehen in der Nachricht mit **9=** und **10=**. <SOH> bezeichnet den Trenner (Hexadezimal X'01'). Die Werte des ReturnCodes (5555) ebenso wie die Inhalte von OrderRejectReasonTxt (9320) entsprechen den real vergebenen Werten.

Die nachfolgenden Beispiele verwenden als Zentrale 7766, als Filiale 6766, als CompIDs FS7766I7 und FSRH99I7, das Instrument DE0005810055. Die Nachrichten sind für die FIX-Version 4.4 und der Beispiel-Börsentag ist der 31.08.2011.

Erfolgreiche Anmeldung**Logon**

Die Zentrale 7766 meldet sich an.

```
8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=A <SOH> 34=13 <SOH> 49=FS7766I9 <SOH> 52=20110831-07:00:00.000 <SOH>
56=FSRH99I7 <SOH> 98=0 <SOH> 108=3600 <SOH> 553=7766 <SOH> 554=11111111 <SOH> 10= <SOH>
```

Erfolgreiche Einstellung einer Order**New Order Single Request**

Die Zentrale 7766 gibt für die Filiale 6766 eine Kauf-Limit-Order auf, mit der Order-Nominale 2000, dem Preis 9.85 und der Ordergültigkeit Good-Till-Date 05.09.2011.

```
8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=D <SOH> 34=1342 <SOH> 49=FS7766I7 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH>
56=FSRH99I7 <SOH> 453=2 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=7 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=1
<SOH> 55=[N/A] <SOH> 48=DE0005810055<SOH> 22=4 <SOH> 11=CLORDINS1 <SOH> 38=2000 <SOH> 40=2 <SOH>
44=9.85 <SOH> 54=1 <SOH> 59=6 <SOH> 60=20110831-07:00:01.000<SOH> 100=XSTU<SOH> 432=20110905 <SOH>
526=SECORDID1 <SOH> 10= <SOH>
```

Execution Report

```
8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=8 <SOH> 34=2551342 <SOH> 49=FSRH99I7 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000<SOH> 56=
FS7766I7 <SOH> 453=2 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=7 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=1
<SOH> 55=[N/A] <SOH> 48=DE0005810055<SOH> 22=4 <SOH> 6=0 <SOH> 11=CLORDINS1 <SOH> 14=0 <SOH>
17=20110831000040<SOH> 37=1108314990012 <SOH> 38=2000 <SOH> 39=0 <SOH> 40=2 <SOH> 44=9.85 <SOH> 54=1
<SOH> 59=6 <SOH> 60=20110831-07:00:01.341811<SOH> 100=XSTU <SOH> 150=0 <SOH> 151=2000 <SOH>
432=20110905 <SOH> 526=SECORDID1 <SOH> 10= <SOH>
```

Abgelehnte Orderlöschung**OrderCancelRequest**

Löschung über Tag 41 (OrigClOrdID) mit Angabe eines falschen Wertes im Tag 54 (Side):

```
8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=F <SOH> 34=1343 <SOH> 49=FS7766I7 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000<SOH>
56=FSRH99I7 <SOH> 453=2 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=7 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=1
<SOH> 55=[N/A] <SOH> 48=DE0005810055<SOH> 22=4 <SOH> 11=CLORDDEL1 <SOH> 38=2000 <SOH> 41=CLORDINS1
<SOH> 54=2 <SOH> 60=20110831-07:00:01.000<SOH> 100=XSTU <SOH> 5253=2 <SOH> 10= <SOH>
```

OrderCancelReject

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=9 <SOH> 34=49 <SOH> 49=FSRH9917 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FS776617 <SOH> 11=CLORDDEL1 <SOH> 37=1108314990012 <SOH> 39=8 <SOH> 41=CLORDID001 <SOH> 60=20110831-07:00:01.000 <SOH> 100=XSTU <SOH> 102=99 <SOH> 434=1 <SOH> 5555=2730 <SOH> 9320=PLEASE REVISE SIDE / SIDE (BUY/SELL) <SOH> 9803=212 <SOH> 453=2 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=7 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=1 <SOH> 10= <SOH>

Ereignismitteilung

Rücknahme einer Kursaussetzung für das Instrument DE0005557508

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=B <SOH> 34=254967 <SOH> 43=Y <SOH> 49=FSRH9917 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FS776617 <SOH> 122=20110831-07:00:01.000 <SOH> 148=FIXON <SOH> 6517=20110831 <SOH> 33=1 <SOH> 58=Withdrawal of price fixing suspension <SOH> 146=1 <SOH> 55=[N/A] <SOH> 48=DE0005557508 <SOH> 22=4 <SOH> 215=2 <SOH> 216=1 <SOH> 217=XON <SOH> 216=1 <SOH> 217=XSTU <SOH> 10= <SOH>

Erfolgreiche Einstellung eines OTC-Geschäfts

Die Zentrale 7766 gibt ein OTC-Kauf-Geschäft ein, mit dem Kontrahenten 6766.

TradeCaptureReport

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=AE <SOH> 34=15 <SOH> 49=FS776617 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FSRH9917 <SOH> 22=4 <SOH> 30=XFRA <SOH> 31=9.5 <SOH> 32=1000 <SOH> 48=DE0005810055 <SOH> 55=DB1 <SOH> 60=20110831-07:00:00 <SOH> 75=20110831 <SOH> 487=0 <SOH> 570=N <SOH> 571=OTC_ReplID_1 <SOH> 856=0 <SOH> 5179=070001 <SOH> 552=2 <SOH> 54=1 <SOH> 453=1 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=7 <SOH> 37=[N/A] <SOH> 15=EUR <SOH> 54=2 <SOH> 453=1 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=17 <SOH> 37=[N/A] <SOH> 10= <SOH>

TradeCaptureReportAck

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=AR <SOH> 34=24 <SOH> 49=FSRH9917 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FS776617 <SOH> 22=4 <SOH> 30=XFRA <SOH> 48=DE0005810055 <SOH> 55=[N/A] <SOH> 60=20110831-07:00:01.000 <SOH> 150=0 <SOH> 487=0 <SOH> 571=OTC_ReplID_1 <SOH> 856=0 <SOH> 880=EDF1108310150002 <SOH> 10= <SOH>

OTC-Geschäft als Schlussnote

Die Zentrale 7766 empfängt ein OTC-Kauf-Schlussnote, mit dem Kontrahenten 6766.

TradeCaptureReportSno

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=USN <SOH> 34=25 <SOH> 49=FSRH9919 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FS776619 <SOH> 22=4 <SOH> 30=XFRA <SOH> 31=9.5 <SOH> 32=1000 <SOH> 48=DE0005810055 <SOH> 55=DB1 <SOH> 60=20110831-07:00:01.987 <SOH> 75=20110831 <SOH> 283=XFRA <SOH> 487=0 <SOH> 570=N <SOH> 571=0831130332945860 <SOH> 829=9012 <SOH> 856=0 <SOH> 880=EDF1108310150002 <SOH> 7017=1 <SOH> 7680=1 <SOH> 9954=N <SOH> 454=2 <SOH> 455=DEUTSCHE BOERSE NA O.N. <SOH> 456=8 <SOH> 455=581005 <SOH> 456=B <SOH> 552=2 <SOH> 54=1 <SOH> 37=[N/A] <SOH> 453=4 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=24 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=1 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=27 <SOH> 448=199999 <SOH> 447=D <SOH> 452=11 <SOH> 381=9500 <SOH> 119=9496.2 <SOH> 120=EUR <SOH> 58=FIX/ <SOH> 9471=1 <SOH> 9473=0 <SOH> 9476=-3.8 <SOH> 54=2 <SOH> 37=[N/A] <SOH> 453=3 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=17 <SOH> 448=529900FU4WJ2XT7BVE31 <SOH> 447=N <SOH> 452=17 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=27 <SOH> 768=2 <SOH> 769=20110831-07:00:01.000000 <SOH> 770=1 <SOH> 769=20110831-07:00:01.153521 <SOH> 770=2 <SOH> 10= <SOH>

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 120 von 139

9 Anhang B: Einschränkungen von Formaten und Strukturen**Legende**Sortierung: Nach Namen aufsteigend sortiertÜberschriften: E/A bedeutet eingehende/ausgehende Nachrichten – aus Sicht des BT-FIX Gateway. Die restlichen Angaben sind selbsterklärend.Inhalte: E/A ist nur dann belegt, wenn ein Format **nicht** für beide Richtungen gilt.
Restriktionen/Werte enthält (fallweise) den Verweis auf ein optionales gemeinsames Basisformat, und eine Erläuterung der Restriktionen bzw. Abweichungen vom Standard.
Handelssystem enthält das/die System(e), für welche die Beschreibung gilt. Ist ein Handels- bzw. Abwicklungssystem nicht aufgeführt, dann ist die Verwendung des Tags generell in diesem Handels- bzw. Abwicklungssystem nicht zulässig.

Tag	Format/Struktur	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
	KVNr		Gültige Kassenvereinsnummer	nicht systemspezifisch
	Party		die Gruppe besteht außer für eine Repeating Group vom Typ "session", "Executing System", "Settlement Location", "Buyer Seller", „Execution within firm“ und „Investment Decision Maker“ nur aus den drei Feldern PartyID PartyIDSource PartyRole	nicht systemspezifisch

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 121 von 139

Tag	Format/Struktur	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
		A	<p>für den Typ "session" werden zusätzlich genutzt: NoPartySubIDs (Tag 802), um "1" erhöht PartySubID (Tag 523) = Identifikationsmerkmal PartySubIDType (Tag 803) immer = "4040"</p> <p>für den Typ "Executing System" werden zusätzlich genutzt: NoPartySubIDs (Tag 802, um "1" erhöht) PartySubID (Tag 523) = "[N/A]" PartySubIDType (Tag 803) immer = "3"</p> <p>für den Typ "Settlement Location" werden zusätzlich genutzt: NoPartySubIDs (Tag 802), um "2" erhöht PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal" PartySubIDType (Tag 803) = "4060" PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal" PartySubIDType (Tag 803) = "4080" oder NoPartySubIDs (Tag 802), um "2" erhöht PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal" PartySubIDType (Tag 803) = "4070" PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal" PartySubIDType (Tag 803) = "4090"</p> <p>für den Typ "Buyer Seller" werden zusätzlich genutzt: NoPartySubIDs (Tag 802) um "1" erhöht PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal" PartySubIDType (Tag 803) = "4050"</p> <p>für den Typ „Execution within firm“ wird zusätzlich genutzt: PartyRoleQualifier (Tag 2376) = „22“ (Algorithmus) oder „24“ (Nat. Person)</p> <p>für den Typ „Investment Decision Maker“ wird zusätzlich genutzt: PartyRoleQualifier (Tag 2376) = „22“ (Algorithmus) oder „24“ (Nat. Person)</p> <p>für den Typ "Client Identification Code" wird zusätzlich genutzt: PartyRoleQualifier (Tag 2376) = „23“ (LEI) oder „24“ (Nat. Person)</p>	nicht systemspezifisch
	Price		<p>das FIX Float Format Price (15 signifikante Stellen, zusätzlich optional Dezimalpunkt und Vorzeichen) ist eingeschränkt. Siehe hierzu die Float-Format-Angabe Float (13,5) bei den jeweiligen Tags: 44 Price, 99 StopPx. Besonderheit bei Tag 31 LastPx: Float (13,5) bei den Ordernachrichten. Float (10,4) bei den Trade-Nachrichten.</p>	nicht systemspezifisch
	Qty		<p>das FIX Float Format Qty (15 signifikante Stellen, zusätzlich optional Dezimalpunkt und Vorzeichen) ist eingeschränkt. Das Format ist immer Float (12,3)</p>	nicht systemspezifisch

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 122 von 139

10 Anhang C: Benutzerdefinierte Tags**Legende**Sortierung: Nach Tags aufsteigend sortiertÜberschriften: E/A bedeutet eingehende/ausgehende Nachrichten – aus Sicht des BT-FIX Gateway. Die restlichen Angaben sind selbsterklärend.Inhalte: E/A ist nur dann belegt, wenn ein Format **nicht** für beide Richtungen gilt.
Restriktionen/Werte enthält (fallweise) den Verweis auf ein optionales gemeinsames Basisformat, und eine Erläuterung der Restriktionen bzw. Abweichungen vom Standard.
Handelssystem enthält das/die System(e), für welche die Beschreibung gilt. Ist ein Handels- bzw. Abwicklungssystem nicht aufgeführt, dann ist die Verwendung des Tags generell in diesem Handels- bzw. Abwicklungssystem nicht zulässig.

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
5048	OrdSubStatus	A	Belegung analog SAKI GV-Codes bei Vestima-Aufträgen A = Löschung von Vestima empfangen B = Löschung von Vestima / OHA durchgeführt C = Löschung von Vestima / OHA abgelehnt D = Provisionscheck in Vestima negativ E = Provisionscheck in Vestima positiv F = Einstellung des Auftrages wurde von Vestima Depotbank (OHA) positiv bestätigt G = Auftragslöschung durch Vestima Depotbank H = disabled I = Auftragseinstellung von Vestima empfangen	INVESTRO/Vestima
5053	TradeType2	E	1 (DVP) = FZ	XONTRÖ, für TradeCaptureReport
		A	1 (DVP) = FZ 7 (when issued) = FE	XONTRÖ, für TradeCaptureReportSno
5076	FundReinvestIncome		Y = Kauf zu Wiederanlage Space = sonstiges	INVESTRO
5078	FundSpecialDealDiscount		Y = Kauf zum Rücknahmepreis Space = sonstiges	INVESTRO
5156	UnreleasedDate		LocalMktDate Gültigkeit ab	XONTRÖ, MAX-ONE, INVESTRO
5177	Source	A	<session>	nicht systemspezifisch, nur 4.2
5179	TradeTime	E	Abschlussuhrzeit (hhmmss)	XONTRÖ, für TradeCaptureReport
5253	OrdTypeExt Dieses Feld wird ausschließlich im Order Cancel Request und für EG-Orders verwendet		1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit" K = "Market with Leftover" M = "Midpoint" I = "Iceberg"	Xetra

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 123 von 139

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
			1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit"	Xetra Ffm-2
			E = "EG-Order"	XONTRO, MAX-ONE
5427	IntrAttribType	A	I = Interest (Zinsen) D = Discount (Diskont)	XONTRO, für TradeCaptureReportSno
5458	MDDelayed	E	Delay-Indikator	XONTRO, für TradeCaptureReport
5476	PrivateReference	A	Ergänzung zu OrdSubStatus	INVESTRO/Vestima
5494	LastTrader	A	Hat das Basisformat KVNr. Ist eine in XONTRO zugelassene (Makler)KVNr	XONTRO, für TradeCaptureReportSno
5555	ReturnCode	A	Fehlercode	nicht systemspezifisch
5862	UpdateReason	A	Grund der systemgenerierten Order-Änderung bzw. -Löschung	XONTRO, MAX-ONE, Xetra, Xetra Ffm-2
5665	MKTXPriceDiff	A	Kursdifferenz	XONTRO für TradeCaptureReportSno
5681	ExchangeTradeType	E	Kennzeichnung Emissionsgeschäft.	XONTRO für TradeCaptureReport
5689	VersionID		Integer(18), kein Vorzeichen, nimmt dateLstUpdDat auf nur die von den Handelssystemen gelieferten Werte dürfen in Requests wieder verwendet werden	Xetra, Xetra Ffm-2
5944	InitialDisplayQty	A	Siehe Qty	Xetra
5946	PendingReason	A	1 = "buffered" 2 = "locked stock" 3 = "response delayed (intraday)" 4 = "order status unknown (end of day)"	Xetra, Xetra Ffm-2
		A	2 = "locked stock" 4 = "order status unknown (end of day)"	MAX-ONE
		A	2 = "locked stock" 4 = "order status unknown (end of day)" 5 = "verification pending"	XONTRO
		A	4 = "order status unknown (end of day)" 5 = "verification pending" Nur für Aufträge in Vestima-Gattungen.	INVESTRO/Vestima
6031	EnteringFirm		<entering firm>	nicht systemspezifisch, nur 4.2
6034	ConcessionAmt	A	Bonifikations-Differenz-Betrag	XONTRO für TradeCaptureReportSno
6042	CxlReason	E	1 = Cancel durch Kill-Funktion	XONTRO, MAX-ONE
6126	OrigLeavesQty	E	Siehe Qty	XONTRO
6141	TradeQty	A	Siehe Qty	XONTRO für TradeCaptureReportSno
6255	EndTime		Ende Börsenzeit	XONTRO

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 124 von 139

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
6475	ClientIndicator	A	Y = IW-Geschäft	XONTRO für TradeCaptureReportSno
6489	TriggerIndicator	A	A = Aktivierung einer EG-Order B = Order auf EG zurückgesetzt Y = Trigger Stop Order	XONTRO, MAX-ONE XONTRO XONTRO, MAX-ONE, Xetra, Xetra Ffm-2
6516	NewsValidUntil		Datum bis	XONTRO
6517	NewsEventDate		Datum bzw. Datum ab	XONTRO
6555	OrigTrdMatchID	A	Ursprüngliche Geschäftsnummer	XONTRO für TradeCaptureReportAck
6556	BusinessTransactionType		"1" = TradeAdvice	XONTRO für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportAck
6583	SpreadPremium	A	Bonifikationsbetrag	XONTRO für TradeCaptureReportSno
6584	SpreadPctPremium		Bonifikationsatz	INVESTRO, XONTRO bei EnterOTC
6585	SpreadPctDiscount	A	Wiederanlagerabatt in Prozent	INVESTRO, XONTRO für TradeCaptureReportSno
6586	CashOffset		Wiederanlagerabatt	XONTRO, für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno
6611	TotalAccruedInterestAmt	A	Akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag	INVESTRO, XONTRO für TradeCaptureReportSno
6732	DealerNote	A	diverse Unterfelder mit \ getrennt. Die Beschreibung folgt im Anschluss dieser Tabelle	INVESTRO, XONTRO für TradeCaptureReportSno
6893	Profit	A	Zwischengewinn	INVESTRO, XONTRO für TradeCaptureReportSno
7017	VolumeIndicator	E	1 =Stück 2 = Prozent 3 = Promille 4 = Punkte 9 = Sonstige	XONTRO für TradeCaptureReport
		A	1 =Stück 2 = Prozent 3 = Promille	XONTRO für TradeCaptureReportSno
7491	CustomPrice1		Ausgabepreis wenn Tag 5076 oder 5078 belegt	INVESTRO, XONTRO für TradeCaptureReportSno
7493	CustomRate1	A	Ausgabeaufschlag	XONTRO
7566	TimezoneOffset	E	Abweichung zu UTC	XONTRO für TradeCaptureReport
7567	ReportedPxDiff	E	Y = Abweichender Preis Indikator	XONTRO für TradeCaptureReport
7568	ReportedPxReason	E	N = negotiated Trade	XONTRO für TradeCaptureReport
7680	OTCInd		0 = börslich 1 = außerbörslich (Default)	nicht systemspezifisch
7931	VenueID		<executing system>	nicht systemspezifisch, nur 4.2
9318	MktMkerID		<systematic internaliser> <market maker>	nicht systemspezifisch, nur 4.2

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 125 von 139

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
9320	OrderRejectReasonTxt	A	Fehlertext des Handelssystems	nicht systemspezifisch
9471	NoTransactionCosts		<courtage>	XONTRO für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno
9473	TransactionCostCode		<courtage>	XONTRO für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno
9476	TransactionCostAmt		<courtage>	XONTRO für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno
9583	MIFIDInternalizationIndicator		1 = "Facilitation" 4 = "No"	Xetra
9591	PriceCheckingFlag	A	2 = severe (PriceAlert)	XONTRO für TradeCaptureReportAck
9596	ClientFreeField1		String auf Float(10,3) > 0 eingeschränkt Falls Tag 9597 "PM" enthält, muss der Wert <= 99,999 sein Falls Tag 9597 "PD" enthält, muss der Wert <= 9999999,990 sein (letzte Nachkommastelle = 0)	XONTRO
9597	ClientFreeField2		"PD" = Absolutbetrag "PM" = Promille Space = None	XONTRO
9803	TradingSystemID	A	0 = Gateway 4 = Xetra 5 = Xetra Ffm-2 111 = Connector 112 = Connector 120 = XEO MAX-ONE 121 = XEO Xetra 122 = XEO Xetra Ffm-2 212 = XONTRO 312 = MAX-ONE 313 = MAX-ONE 612 = INVESTRO/Vestima	nicht systemspezifisch
9807	RegFeeFlag	A	Courtage-Schlüssel	XONTRO für TradeCaptureReportSno
9893	DiscountRate	A	Diskontsatz	XONTRO für TradeCaptureReportSno
9933	CombinedOrderType	A	Z = Zeichnungsauftrag H = Fondsegment Hannover In den Fällen, in denen dieses Tag geliefert wird, wird das Gültigkeitsdatum der Order vom Handelssystem gesetzt und im Feld ExpireDate (Tag 432) geliefert.	XONTRO
9938	ClearingHandlingType	A	I = internes Settlement A = bilaterale Aggregation: das, Geschäft welches in die Aggregation einfließt. B = bilaterale Aggregation: das aggregierte Abwicklungs-Geschäft.	XONTRO
9954	NextMsgFlag	A	Y = (weitere) Folgesätze werden geliefert N = keine (weiteren) Folgesätze	XONTRO für TradeCaptureReportSno
20003	PartyIDClientID	E	<client identification code>	XONTRO, MAX-ONE

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 126 von 139

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
21103	PartyIDClientIDQualifier	E	<client identification code>	XONTRO, MAX-ONE
21303	PartyIDClientIDSource	E	<client identification code>	XONTRO, MAX-ONE
20122	PartyIDInvestmentDecisionMaker	E	<Investment Decision Maker>	XONTRO, MAX-ONE
21222	PartyIDInvestmentDecisionMakerQualifier	E	<Investment Decision Maker>	XONTRO, MAX-ONE
21422	PartyIDInvestmentDecisionMakerSource	E	<Investment Decision Maker>	XONTRO, MAX-ONE
20012	PartyIDExecutingTrader	E	<Execution within firm>	XONTRO, MAX-ONE
21112	PartyIDExecutingTraderQualifier	E	<Execution within firm>	XONTRO, MAX-ONE
21312	PartyIDExecutingTraderSource	E	<Execution within firm>	XONTRO, MAX-ONE

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 127 von 139

Beschreibung des Tags 6732 DealerNote

Das Tag 6732 ist in mehrere Unterfelder unterteilt, welche durch \ getrennt sind. Der Initwert dieser Unterfelder ist i.d.R. Spaces, bei dem Unterfeld abweichender Kontrahenten Kurs ist der Init-Wert „000000,0000“.

Tag	Feldname	Unter-Feldname	Format	Restriktionen/Werte
6732	DealerNote	Kennzeichen Lieferfreigabe	Char	J, N
		Trenner	Char	\
		abweichender Kontrahentenkurs	String(11)	6 Vorkomma, 4 Nachkomma
		Trenner	Char	\
		Kennzeichen für Abweichender Schlusstag	String(2)	Konstante "AS"
		Trenner	Char	\
		Art des Wertpapiers	String(3)	Konstante "SHS" = Aktien, "BON" = Renten, "BCE" = zertifikatsähnl. Renten, "WTS" = Warrants, "CER" = Zertifikate, "FUN" = Fonds, "SUB" = Nebenrechte, "RTE" = Genussrechte, "UNT" = Units, "MSC" = Sonstige
		Trenner	Char	\
		Verwahrmöglichkeit	String(3)	
		Trenner	Char	\
		Zinstermin	String(8)	bspw. "21.07.G "
		Trenner	Char	\
		APMT-Konstante	String(4)	"APMT" = gegen Zahlung
		Trenner	Char	\
		Abschlusskurs-Währung	String(3)	
		Trenner	Char	\
Kurswert-Währung	String(3)			
Trenner	Char	\		
Kursdifferenz-Währung	String(3),			
Trenner	Char	\		
Stückzins-Währung	String(3),			
Trenner	Char	\		
Kennzeichen für Courtage	String(6),	Konstante /BROK/		
Trenner	Char	\		
Kennzeichen für Spesen	String(6)	Konstante /FEES/		
Trenner	Char	\		
Kennzeichen Wiederanlagerabatt	String(6)	Konstante /MISC/		
Trenner	Char	\		
Kennzeichen für Bonifikation	String(6)	Konstante /MISC/		
Trenner	Char	\		
Kennzeichen für Boni-Differenz	String(6)	Konstante /MISC/		
Trenner	Char	\		
Kennzeichen für Provision	String(6)	Konstante /COMM/		
Trenner	Char	\		

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 129 von 139

11 Anhang D: Erweiterungen des 4.2 SprachumfangsSortierung: Nach Tags aufsteigend sortiert

Tag	Feldname
447	PartyIDSource
448	PartyID
452	PartyRole
453	NoPartyIDs
454	NoSecAltID
455	SecurityAltID
456	SecurityAltIDSource
487	TradeReportTransType
523	PartySubID
526	SecondaryCIOrdID
552	NoSides
553	Username
554	Password
570	PreviouslyReported
571	TradeReportID
572	TradeReportRefID
625	TradingSessionSubID
691	Pool
751	TradeReportRejectReason
768	NoTrdRegTimestamps
769	TrdRegTimestamp
770	TrdRegTimestampType
789	NextExpectedMsgSeqNum
802	NoPartySubIDs
803	PartySubIDType
818	SecondaryTradeReportID
820	TradeLinkID
829	TrdSubType
856	TradeReportType
880	TrdMatchID
923	UserRequestID
924	UserRequestType
925	NewPassword
926	UserStatus
927	UserStatusText
1094	PegPriceType
1125	OrigTradeDate
1126	OrigTradeID

FAGSE

BT-FIX Gateway

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 130 von 139

Tag	Feldname
1138	DisplayQty
1409	SessionStatus
6042	CxlReason
20003	PartyIDClientID
21103	PartyIDClientIDQualifier
21303	PartyIDClientIDSource
20122	PartyIDInvestmentDecisionMaker
21222	PartyIDInvestmentDecisionMakerQualifier
21422	PartyIDInvestmentDecisionMakerSource
20012	PartyIDExecutingTrader
21112	PartyIDExecutingTraderQualifier
21312	PartyIDExecutingTraderSource

12 Anhang E: Erweiterungen des 4.4 Sprachumfangs

Sortierung: Nach Tags aufsteigend sortiert

Tag	Feldname
1094	PegPriceType
1125	OrigTradeDate
1126	OrigTradeID
1138	DisplayQty
1409	SessionStatus
6042	CxlReason

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 132 von 139

13 Anhang F: Abweichende Belegungen von Standardtags**Legende**Sortierung: Nach Tags aufsteigend sortiertÜberschriften: E/A bedeutet eingehende/ausgehende Nachrichten – aus Sicht des BT-FIX Gateway. Die restlichen Angaben sind selbsterklärend.Inhalte: E/A ist nur dann belegt, wenn ein Format **nicht** für beide Richtungen gilt.
Restriktionen/Werte enthält (fallweise) den Verweis auf ein optionales gemeinsames Basisformat, und eine Erläuterung der Restriktionen bzw. Abweichungen vom Standard.
Handelssystem enthält das/die System(e), für welche die Beschreibung gilt. Ist ein Handels- bzw. Abwicklungssystem nicht aufgeführt, dann ist die Verwendung des Tags generell in diesem Handels- bzw. Abwicklungssystem nicht zulässig.

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
1	Account		Siehe AcctTypCod und AcctTypNo	
	AcctTypCod		"A" = Agent "E" = BEST Executor "I" = Issuer (Quote Provider) "L" = Liquidity Provider "M" = Betreuer "P" = Proprietary "Q" = Liquidity Manager mandatory	Xetra, Xetra Ffm-2
			"A" = Agent "P" = Proprietary optional	XONTRO (Orderfunktionalitäten), MAX-ONE
			optional <i>ignoriert</i>	INVESTRO/Vestima
			"A" = Agent (Kunde) "P" = Proprietary (Banken Eigengeschäft) "E" = Proprietary (Makler Eigengeschäft) optional	XONTRO für Schlussnoten
	AcctTypNo		mandatory	Xetra, Xetra Ffm-2
			Nur "1" ist zulässig optional	XONTRO-Order, MAX-ONE
			"A" = Geschäft des Maklers, aus systemseitiger Aufgabenschließung, nur zusammen mit AcctTypCod="E" möglich "E" = Geschäft des Maklers, nur zusammen mit AcctTypCod="E" möglich "1" = Geschäft der Bank, nur zusammen mit AcctTypCod="A" oder "P" möglich optional	XONTRO für Schlussnoten
			optional <i>ignoriert</i>	INVESTRO/Vestima
8	BeginString		nur "FIX.4.2" und "FIX.4.4" sind zulässig	
11	ClOrdID		String(16), muss für die Laufzeit einer Order eindeutig sein	nicht systemspezifisch

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 133 von 139

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
12	Commission		Das FIX Float Format "Amt" (15 signifikante Stellen, zusätzlich optional Dezimalpunkt und Vorzeichen) muss sich entsprechend der Lage des im String enthaltenen Dezimalpunkts auf das Format Snum(10,2) mit genau 2 Nachkommastellen abbilden lassen. Ist dies nicht möglich, wird die Nachricht als fehlerhaft behandelt	XONTRO
21	HandlInst	E	Char für "FIX.4.2" mandatory für "FIX.4.4." optional <i>ignoriert</i>	nicht systemspezifisch
22	SecurityIDSource		nur der Wert "4" ist zulässig	nicht systemspezifisch
33	LinesOfText	A	Bei Nachrichten des Sessionlevels immer mit "1" belegt. Bei Nachrichten des Applikationslevels sind die Werte "1", "2" zulässig.	nicht systemspezifisch
35	MsgType	E	nur die Werte "0", "1", "2", "4", "5", "A", "D", "F", "G", "BE", "AE" sind zulässig Für 4.2 wird "BE" durch "UBE" und "AE" durch "UAE" ersetzt.	nicht systemspezifisch
		A	nur die Werte "0", "1", "2", "3", "4", "5", "8", "9", "A", "B", "j", "BF", "AR", "USN" sind zulässig Für 4.2 wird "BF" durch "UBF" und "AR" durch "UAR" ersetzt.	nicht systemspezifisch
37	OrderID		String(13), eindeutiger Schlüssel im jeweiligen Handelssystem	nicht systemspezifisch
38	OrderQty		Siehe Qty	nicht systemspezifisch
39	OrdStatus	A	0 = "New" 1 = "Partially filled" 2 = "Filled" 4 = "Canceled" 6 = "Pending Cancel" 8 = "Rejected" A = "Pending New" C = "Expired" E = "Pending Replace"	XONTRO, Xetra, Xetra Ffm-2, MAX-ONE
		A	0 = "New" 2 = "Filled" 4 = "Canceled" 6 = "Pending Cancel" 8 = "Rejected" A = "Pending New"	INVESTRO/Vestima
40	OrdType		1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit" K = "Market with Leftover" P = "Pegged"	Xetra
			1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit"	Xetra Ffm-2, MAX-ONE
			1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop"	XONTRO

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 134 von 139

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
			1 = "Market"	INVESTRO/Vestima
44	Price		Siehe Price	nicht systemspezifisch
55	Symbol	E	ignoriert	nicht systemspezifisch
		A	immer auf "[N/A]" gesetzt	nicht systemspezifisch
58	Text		auf Länge 25 beschränkt An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben	nicht systemspezifisch
59	TimeInForce		0 = "Day" 3 = "Immediate or Cancel" 4 = "Fill or Kill" 6 = "Good till Date"	Xetra
			0 = "Day" 6 = "Good till Date"	Xetra Ffm-2, MAX-ONE, XONTRO
			<i>ignoriert</i>	INVESTRO/Vestima
60	TransactTime	E	<i>ignoriert</i>	nicht systemspezifisch
98	EncryptMethod		nur der Wert "0" ist zulässig	nicht systemspezifisch
99	StopPx		Siehe Price	nicht systemspezifisch
100	ExDestination		MIC Code XBER, XDUS, XETR, XHAN, XHAM, XMUN, XSTU, XFRA XINV adressiert INVESTRO/Vestima	nicht systemspezifisch
110	MinQty		siehe Qty nur bei Midpoint Orders	Xetra
150	ExecType	A	0 = "New" 4 = "Canceled" 5 = "Replace" 6 = "Pending Cancel" 8 = "Rejected" A = "Pending New" C = "Expired" E = "Pending Replace" F = "Trade"	XONTRO, Xetra, Xetra Ffm-2, MAX-ONE
		A	0 = "New" 4 = "Canceled" 6 = "Pending Cancel" 8 = "Rejected" A = "Pending New" D = "Restated" F = "Trade" I = "Order Status"	INVESTRO/Vestima
156	SettlCurrFxRateCalc		nur D = "divide" ist zulässig	XONTRO
336	TradingSessionID		nur 1 = "Day" ist zulässig	nicht systemspezifisch
447	PartyIDSource		Für TradeCaptureReportSno sind die Werte "D", „N" und "B" zulässig, ansonsten ist nur der Wert "D" und „P" zulässig.	nicht systemspezifisch
448	<agent> PartyID		String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DEAG/REAG)	INVESTRO/Vestima
448	<buyer seller> PartyID		In Kombination mit PartyIDSource=D Muss das Basisformat KVNr besitzen. Muss eine in XONTRO zugelassene (Käufer/Verkäufer)KVNr sein In Kombination mit PartyIDSource=B String(11) Vestima-BIC des Kontrahenten (SELL/BUY)	nicht systemspezifisch INVESTRO/Vestima

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 135 von 139

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
448	<clearing firm> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen. Muss eine in XONTRO zugelassene (Clearer)KVNr sein	nicht systemspezifisch
448	<clearing organization> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen. Muss eine in XONTRO zugelassene KVNr sein	nicht systemspezifisch
448	<contra firm> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen. Muss eine in XONTRO zugelassene (Kontrahenten) KVNr sein. Ausnahme: Im TradeCaptureReportSno wird <contra firm> als KVNr und als LEI ausgegeben.	nicht systemspezifisch
448	<custodian> PartyID		String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DECU/RECU)	INVESTRO/Vestima
448	<customer account> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen. Muss eine in XONTRO zugelassene (SNO-Empfänger)KVNr sein	nicht systemspezifisch
448	<entering firm> PartyID		Ist im Gegensatz zum FIX Standard mandatory. Muss das Basisformat KVNr besitzen. Die KVNr muss der Anschlussinhaber für die mitgelieferte SenderCompID sein. Wird nur eine "Party" geliefert, dann müssen auch alle Restriktionen des Formats ExecutingFirm erfüllt sein.	nicht systemspezifisch
448	<executing firm> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen.	
			Muss eine in XONTRO zugelassene KVNr mit entsprechender userID sein.	XONTRO, MAX-ONE
			Muss als zulässige KVNr, die eine MemberID repräsentiert, in Xentric definiert sein.	Xetra, Xetra Ffm-2
448	<executing system> PartyID	A	String folgende Belegung ist möglich: "XETRA" "XETRA-2" "XONTRO" "MAX-ONE" "INVESTRO"	Xetra, Xetra Ffm-2, XONTRO, MAX-ONE, INVESTRO
448	<execution venue> PartyID		String(12), Code zur Identifizierung des gemeldeten Geschäfts. Folgende Belegung ist möglich: <ul style="list-style-type: none"> Konstante "OTC" für OTC-Geschäfte Konstante "SI" für systematische Internalisierer zur Identifizierung einer Plattform: <ul style="list-style-type: none"> "B" plus BIC (ISO 9662, 11-stellig alphanumerisch) "M" plus MIC (ISO 10383, 4-stellig alphanumerisch) "I" plus IBEI (ISO 16327, 10-stellig alphanumerisch) 	INVESTRO/Vestima
448	<intermediary> PartyID		String(10) numerisch, INVESTRO-Vertriebspartner	INVESTRO
448	<market maker> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen.	
			Muss eine in XONTRO zugelassene (Makler)KVNr sein.	XONTRO, MAX-ONE
			nicht erforderlich, ignoriert	INVESTRO/Vestima, Xetra, Xetra Ffm-2

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 136 von 139

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
448	<order origination trader> PartyID		String(6), Händlernummer	XONTRO, MAX-ONE
448	<report originator> PartyID		String(11), Code zur Identifizierung des meldenden Instituts	INVESTRO/Vestima
448	<session> PartyID	A	String(5), Xetra MemberID	Xetra, Xetra Ffm-2
			String(4), KVNr des Eingegers	XONTRO, MAX-ONE, INVESTRO/Vestima
448	<settlement location> PartyID		String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (PSET)	INVESTRO/Vestima
448	<systematic internaliser> PartyID		String(5), Xetra MemberID	Xetra
448	<client identification code> PartyID		String(20), client identification code	XONTRO, MAX-ONE
448	<Execution within firm> PartyID		String(20), Execution within firm	XONTRO, MAX-ONE
448	<Investment Decision Maker> PartyID		String(20), Investment Decision Maker	XONTRO, MAX-ONE
452	PartyRole		Die folgenden Einträge sind zulässig 1 = "Executing Firm" 3 = „Client Identification Code“ 4 = "Clearing Firm" 7 = "Entering Firm" 10 = "SettlementLocation" 12 = "Execution within Firm" 11 = "Order Origination Trader" 16 = "Executing System" 17 = "Contra Firm" 21 = "Clearing Organization" 24 = "Customer Account" 27 = "Buyer Seller" 28 = "Custodian" 29 = "Intermediary" 30 = "Agent" 55 = "Session ID" 62 = "Report Originator" 63 = "Systematic Internaliser" 66 = "Market Maker" 73 = "Execution Venue" 122 = „Investment Decision Maker“	
453	NoPartyIDs		Nur die Werte "1" bis "6" sind zulässig (eingehende Nachrichten) bzw. "1" bis "7" (ausgehende Nachrichten).	nicht systemspezifisch
487	TradeReportTransType		Nur die Werte 0, 1, 2 und 4 sind in TradeCaptureReport und TradeCaptureReportAck zulässig. Nur der Wert 0 ist in TradeCaptureReportSno zulässig.	XONTRO
523	PartySubID	A	String(6) letzte 6 Stellen der UserID für <session>	XONTRO, MAX-ONE, INVESTRO
			String(35) Vestima-Safe-Account	INVESTRO/Vestima
			Subgroup + TraderID für <session>	Xetra, Xetra Ffm-2
			[N/A] für <executing system>	nicht systemspezifisch
526	SecondaryClOrdID		String(16)	nicht systemspezifisch
553	Username		siehe EnteringFirm (Tag 448)	nicht systemspezifisch

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 137 von 139

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
554	Password		auf die Länge 8 beschränkt	nicht systemspezifisch
625	TradingSessionSubID		2 = "Opening auction only" 3 = "Main trading" 4 = "Closing auction only" 6 = "Main auction" 100 = "Auction only" 101 = "End-of-day auction" 102 = "Pending for next auction" 103 = "Closing crossing" 104 = "Accept surplus" 105 = "Special auction"	Xetra, Xetra Ffm-2
			2 = "Opening auction only" (EK - EK-Order) 6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order)	XONTRO
			6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order)	MAX-ONE
			Das Tag wird ignoriert	INVESTRO/Vestima
751	TradeReportRejectReason		Nur 99 = "Other" ist zulässig	XONTRO
768	NoTrdRegTimestamps		Nur der Wert 1 ist in TradeCaptureReport zulässig. Nur die Werte 1 und 2 sind in TradeCaptureReportSno zulässig.	nicht systemspezifisch
770	TrdRegTimestampType		Nur der Wert 1 ist in TradeCaptureReport zulässig. Nur die Werte 1 und 2 sind in TradeCaptureReportSno zulässig.	nicht systemspezifisch
802	NoPartySubIDs	A	Das Tag fehlt oder wird vom GW mit "1" belegt	nicht systemspezifisch
803	PartySubIDType	A	Das Tag wird bei PartyRole = 55 mit "4040" (User Identifier) belegt und bei PartyRole = 16 mit "3" (System)	nicht systemspezifisch
		A	Das Tag wird bei PartyRole = 28 mit "4080" (DECU-Safe-Account oder "4090" (RECU-Safe-Account) belegt und bei PartyRole = 30 mit "4060" (DEAG-Safe-Account) oder "4070" (REAG-Safe-Account) belegt und bei PartyRole = 27 mit "4050" (BUY/Sell-Safe-Account) belegt.	INVESTRO/Vestima
828	TrdType	A	OTC Post-trade indicator 9001 = ACTX (Agency cross transaction) 9002 = CANC (Cancellation) 9101 = ACTX CANC (Agency cross transaction and Cancellation)	XONTRO, MAX-ONE
829	TrdSubType		Siehe Kapitel 14 Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart)	XONTRO
923	UserRequestID		wird auf String(16) gekürzt	nicht systemspezifisch
924	UserRequestType		nur der Wert "3" ist zulässig	nicht systemspezifisch
925	NewPassword		auf die Länge 8 beschränkt	nicht systemspezifisch

FAGSE**BT-FIX Gateway**

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 138 von 139

14 Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart)

TrdSubType	Beschreibung
9011	Kauf - Schlussnote
9012	Kauf - Direktgeschäft
9013	Kauf - Aufgabe
9014	Kauf - Aufgabeschließung
9015	Kauf - Aufgabeweitergabe
9016	Kauf - Durchlieferung
9017	Kauf - INVESTRO
9019	Kauf - EUFO
9021	Verkauf - Schlussnote
9022	Verkauf - Direktgeschäft
9023	Verkauf - Aufgabe
9024	Verkauf - Aufgabeschließung
9025	Verkauf - Aufgabeweitergabe
9026	Verkauf - Durchlieferung
9027	Verkauf - INVESTRO
9029	Verkauf - EUFO
9511	Storno/Kauf - Schlussnote
9512	Storno/Kauf - Direktgeschäft
9513	Storno/Kauf - Aufgabe
9514	Storno/Kauf - Aufgabeschließung
9515	Storno/Kauf - Aufgabeweitergabe
9517	Storno/Kauf - INVESTRO
9519	Storno/Kauf - EUFO
9521	Storno/Verkauf - Schlussnote
9522	Storno/Verkauf - Direktgeschäft
9523	Storno/Verkauf - Aufgabe
9524	Storno/Verkauf - Aufgabeschließung
9525	Storno/Verkauf - Aufgabeweitergabe
9527	Storno/Verkauf - INVESTRO
9529	Storno/Verkauf - EUFO
9611	Tagesstorno/Kauf - Schlussnote
9612	Tagesstorno/Kauf - Direktgeschäft
9613	Tagesstorno/Kauf - Aufgabe
9614	Tagesstorno/Kauf - Aufgabeschließung
9617	Tagesstorno/Kauf - INVESTRO
9621	Tagesstorno/Verkauf - Schlussnote
9622	Tagesstorno/Verkauf - Direktgeschäft
9623	Tagesstorno/Verkauf - Aufgabe
9624	Tagesstorno/Verkauf - Aufgabeschließung

FAGSE

BT-FIX Gateway

27.10.2020

Rules of Engagement

Seite 139 von 139

TrdSubType	Beschreibung
9627	Tagesstorno/Verkauf - INVESTRO
9913	Löschung/Kauf - Aufgabe
9915	Löschung/Kauf - Aufgabenweitergabe
9923	Löschung/Verkauf - Aufgabe
9925	Löschung/Verkauf - Aufgabenweitergabe