

XONTRO Newsletter

MiFID II

Nr. 4

Release 33

Stand: 02.02.2018

Version 1.01 – update 1

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 2
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

Inhalt

1	Einleitung	3
2	Organisatorische Anforderungen.....	4
2.1	Hinterlegung der User-Legitimation.....	4
2.2	Hinterlegung der User-Legitimation des „verantwortlichen Händlers“	4
2.3	Hinterlegung der User-Legitimation für den Systemanschluss Makler	5
3	3270-Berechtigungsdialog	6
3.1	Pflege der User-Legitimationen „BRMI LM“	6
3.2	Teilnehmerlegitimation	8
4	Datenmapping	10
5	Teilnehmersimulation	11
6	Fachlicher und Technischer Support.....	12
6.1	BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH	12
6.2	Deutsche Börse AG	12

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 3
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

1 Einleitung

Dieses Dokument soll Kreditinstitute und Maklerhäuser über relevante XONTRO-Themen im Rahmen der MiFID II Umsetzung zum 03.01.2018 informieren.

Die Mitwirkung aller an XONTRO teilnehmenden orderaufgebenden User ist zwingend erforderlich. Teilnehmer, die ausschließlich OTC- und/oder SNO-Funktionalitäten nutzen, sind von den Legitimationsanforderungen nicht betroffen.

Dieses Dokument behandelt folgende Themenbereiche:

- Hinterlegung der User-Legitimationen
 - User-Identifikation für 3270-Dialog (Kreditinstitut und Makler)
 - User-Identifikation des verantwortlichen Händlers (Kreditinstitut)
 - User-Identifikation (User-Shortcode) für SAM (Systemanschluss Makler)
- Datenmapping
 - Ordereingabe via Systemanschluss KI via Fix
 - Ordereingabe via Systemanschluss Makler
 - Verkürzte Ordereingabe im 3270-Dialog-Orderbuch

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 4
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

2 Organisatorische Anforderungen

2.1 Hinterlegung der User-Legitimation

Jeder XONTRO-Nutzer (Kreditinstitut- und Makler-User), welcher im XONTRO-Dialog in seinem Namen Orders erfassen möchte, muss sich vor Beginn der MiFID II in einem neuen 3270-Berechtigungsdialog (BRMI) legitimieren.

Im Newsletter 03 war bisher nur von „XONTRO-Dialog-Usern“ die Rede. Da die Beschreibung auch für den SAM (Systemanschluss Makler) gültig ist, muss der Adressatenkreis insgesamt größer gefasst werden. Die Legitimierung ist auch von XONTRO-Usern (ID-Kennzeichen) durchzuführen, die via SAM arbeiten. Hierzu reicht es aus, wenn die verwendete User-Identifikation einmalig in BRMI/LM (z.B. mittels CONCAT) legitimiert wird. Nur jeder User selbst kann diese Legitimation durchführen.

In der Zeit **vom 04.12.2017 bis zum 29.12.2017** besteht die Möglichkeit zur Erfassung der eigenen Legitimationsdaten in der Dialogtransaktion „BRMI LM“. Siehe hierzu auch den Abschnitt 3.1 Pflege der User-Legitimationen „BRMI LM“.

Ab dem 03.01.2018 ist bei fehlender Legitimation eine Ordererfassung im eigenen Namen im XONTRO-Dialog nicht möglich. Eine Legitimationserfassung bzw. -änderung kann jedoch für jeden angemeldeten (eigenen) User durch Aufruf der Dialogfunktion „BRMI LM“ jederzeit durchgeführt werden.

2.2 Hinterlegung der User-Legitimation des „verantwortlichen Händlers“

Das Thema ist relevant für alle zugelassenen Kreditinstitute (Dialog- und Systemanschluss), die als Orderaufgeber agieren.

Obwohl die Verpflichtung zur Übermittlung des „verantwortlichen Händlers“ für alle Orderaufgeber bereits seit einigen Jahren besteht und alle relevanten Institute bereits entsprechende Daten hinterlegt haben, hat BrainTrade im Zusammenhang mit der MiFID II den vorhandenen Datenbestand aktualisiert. Die Daten wurden per Fragebogen erhoben. Bei einer Abweichung von den bereits hinterlegten Daten verwendet BrainTrade die jeweils neueste Information.

Das hinterlegte ID-Kennzeichen des verantwortlichen Händlers muss von der jeweiligen Bank persönlich durch den verantwortlichen Händler oder per Mail an trade@xontro.de on behalf von BrainTrade legitimiert werden.

In der Zeit vom 04.12.2017 bis zum 29.12.2017 besteht auch hier die Möglichkeit zur Erfassung der eigenen Legitimationsdaten ebenfalls in der Dialogtransaktion „BRMI LM“.

Teilnehmer, die kein börsliches Orderrouting über das XONTRO-System vornehmen, müssen keinen verantwortlichen Händler benennen.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 5
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

2.3 Hinterlegung der User-Legitimation für den Systemanschluss Makler

Makler können über den Systemanschluss Makler (SAM) User-IDs (ID-Kennzeichen) in den MiFID II relevanten Feldern angeben (siehe SAM Values API „User-Shortcode“). Die ID-Kennzeichen können identisch mit den im 3270-Dialog verwendeten User-Identifikationen sein.

Ab dem **03.01.2018** wird bei einer Ordereinstellung via SAM ohne Belegung von „Execution-within-Firm“ die Legitimation auf den System-User (ID-Kennzeichen) aus dem SAM-Login geprüft. Ist keine Legitimation vorhanden, wird die Ordereinstellung abgelehnt. Der SAM-Login selbst funktioniert weiterhin ohne Hinterlegung einer User-Legitimation.

Die Angabe von Shortcodes über den Systemanschluss Makler ist nur zulässig, wenn der Orderaufgeber ein teilnehmendes Kreditinstitut in XONTRO ist. In diesem Fall muss das benannte Kreditinstitut mittels täglicher Shortcode-File-Lieferung die entsprechenden Longcodes liefern.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 6
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

3 3270-Berechtigungsdialog

3.1 Pflege der User-Legitimationen „BRMI LM“

Jeder XONTRO-User, der ab dem **03.01.2018** Orders eingeben, ändern oder löschen möchte, ist verpflichtet, bereits im Vorfeld seine Legitimation in dem neu geschaffenen Berechtigungsdialog „BRMI LM“ zu hinterlegen. Dabei ist jeder User für die korrekte Hinterlegung seiner Daten verantwortlich.

Die Eingabe der User-Legitimation hat nach den nationalen Vorgaben der MiFID II zu erfolgen. So legitimieren sich beispielsweise deutsche Staatsbürger per CONCAT; spanische Staatsbürger beispielsweise über ihre Steuernummer.

Legitimation via „CONCAT“

```

TRAN: BRMI FC: LM SB:

MIFID II - LEGITIMATION ID-KZ
=====

Daten bitte aus länderspezifischem Ausweisdokument übernehmen:

Vorname                ==> Max
Nachname                ==> Mustermann
Geburtstag (TT.MM.JHJJ) ==> 03.03.1970
Nationalität           ==> DE - Deutschland
Legitimation über CONCAT
J=JA  N=NEIN           ==> J  (siehe www.xontro.de - MiFID)

CONCAT                  ==> DE19700303MAX##MUSTE
                        DE19700303MAX##MUSTE

-- ID-KZ: 1234192799 -- PW:          ----- B9999ABC -- 24/04/17 -- 12:00:00 --
F1 HILFE F3 VERARB F4 ABBR F11 ABMELD

```

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 7
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

Bei einer Legitimation via CONCAT sind zunächst der Vor- und Nachname sowie das Geburtsdatum und die Nationalität anzugeben. Die Nationalitätenschlüssel sind im Format ISO3166-1 (alpha2) zu hinterlegen und können im Internet beauskunftet werden. Danach ist die „Legitimation über CONCAT“ mit „J“ zu bestätigen.

Das System erstellt einen CONCAT-Vorschlag, der vom User überprüft und bei korrekter Darstellung im Feld CONCAT manuell erfasst werden muss. Sollte der vorgeschlagene CONCAT nicht korrekt sein, so ist dieser im Feld „CONCAT“ korrekt (ESMA konform) zu hinterlegen.

Die Verarbeitung der Eingaben wird mit F3 (Verarbeitung) abgeschlossen. Die hinterlegten Daten können jederzeit geändert werden.

Legitimation via länderspezifischem Ausweisdokument

```

TRAN: BRMI FC: LM SB:

MIFID II - LEGITIMATION ID-KZ
=====

Daten bitte aus länderspezifischem Ausweisdokument übernehmen:

Vorname                ==> Mia
Nachname               ==> Musterfrau
Geburtstag (TT.MM.JHJJ) ==> 01.01.1980
Nationalität           ==> ES - Spanien
Legitimation über CONCAT
J=JA  N=NEIN           ==> N (siehe www.xontro.de - MiFID)

Dokumentnummer         ==> ES123456789

Dokumentart            ==> 1          1 = NIDN (National Identifier)
                                   2 = CCPT (Passport Number)

-- ID-KZ: 1234192799 -- PW:          ----- B9999ABC -- 24/04/17 -- 12:00:00 --
F1 HILFE F3 VERARB F4 ABBR F11 ABMELD

```

Bei einer Legitimation via länderspezifischem Ausweisdokument sind zunächst ebenfalls der Vor- und Nachname sowie das Geburtsdatum und die Nationalität anzugeben. Die Nationalitätenschlüssel sind im Format ISO3166-1 (alpha2) zu hinterlegen. Danach ist die „Legitimation über CONCAT“ mit „N“ zu bestätigen.

Nun kann die Dokumentennummer des Ausweisdokumentes erfasst werden. Danach ist noch zu kennzeichnen, ob es sich um eine Passport Number („2“) oder einen anderen National Identifier („1“) handelt, wie im Beispiel der spanischen Steuernummer.

Die Verarbeitung der Eingaben wird mit F3 (Verarbeitung) abgeschlossen. Die hinterlegten Daten können ebenfalls geändert werden.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 8
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

3.2 Teilnehmerlegitimation

Weiterführende Informationen zur Teilnehmerlegitimation sind der jeweils aktuellen ESMA Dokumentation zu RTS 22 (2016-1064_rts_22:annex_ii.pdf) zu entnehmen:

Date: 1 July 2016
ESMA/2016/1064

Annex II¹

National client identifiers for natural persons to be used in transaction reports

ISO 3166 – 1 alpha 2	Country Name	1st priority identifier	2nd priority identifier	3rd priority identifier
AT	Austria	CONCAT		
BE	Belgium	Belgian National Number (Numéro de registre national – Rijksregisternummer)	CONCAT	
BG	Bulgaria	Bulgarian Personal Number	CONCAT	
CY	Cyprus	National Passport Number	CONCAT	
CZ	Czech Republic	National identification number (Rodné číslo)	Passport Number	CONCAT
DE	Germany	CONCAT Personal Identity Card Number (Personalausweisnummer)	National Passport Number	CONCAT
DK	Denmark	Personal identity code 10 digits alphanumerical: DDMMYYXXXX	CONCAT	
EE	Estonia	Estonian Personal Identification Code (Isikukood)		
ES	Spain	Tax identification number (Código de identificación fiscal)		
FI	Finland	Personal identity code	CONCAT	
FR	France	CONCAT		
GB	United Kingdom	UK National Insurance number	CONCAT	
GR	Greece	10 DSS digit investor share	CONCAT	
HR	Croatia	Personal Identification Number (OIB – Osobni identifikacijski broj)	CONCAT	
HU	Hungary	CONCAT		
IE	Ireland	CONCAT		
IS	Iceland	Personal Identity Code National Passport Number (Kennitala)		

¹ This annex was submitted to the European Commission on 1 July 2016 as an amendment to annex II of draft [RTS 22](#) under MiFIR submitted to the European Commission on 28 September 2015.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 9
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

ISO 3166 – 1 alpha 2	Country Name	1st priority identifier	2nd priority identifier	3rd priority identifier
IT	Italy	Fiscal code (Codice fiscale)		
LI	Liechtenstein	National Passport Number	National Identity Card Number	CONCAT
LT	Lithuania	Personal code (Asmens kodas)	National Passport Number	CONCAT
LU	Luxembourg	CONCAT		
LV	Latvia	Personal code (Personas kods)	CONCAT	
MT	Malta	National Identification Number	National Passport Number	
NL	Netherlands	National Passport Number	National identity card number	CONCAT
NO	Norway	11 digit personal id (Foedselsnummer)	CONCAT	
PL	Poland	National Identification Number (PESEL)	Tax Number (Numer identyfikacji podatkowej)	
PT	Portugal	Tax number (Número de Identificação Fiscal)	National Passport Number	CONCAT
RO	Romania	National Identification Number (Cod Numeric Personal)	National Passport Number	CONCAT
SE	Sweden	Personal identity number	CONCAT	
SI	Slovenia	Personal Identification Number (EMŠO: Enotna Matična Številka Občana)	CONCAT	
SK	Slovakia	Personal number (Rodné číslo)	National Passport Number	CONCAT
All other countries		National Passport Number	CONCAT	

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 10
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

4 Datenmapping

Um **ab dem 03.01.2018** eine Ordereinstellung im Fall nicht oder nicht vollständig vorliegender Legitimationsdaten durchführen zu können, werden in Abstimmung mit den Börsenplätzen Berlin, Düsseldorf, Hamburg und Hannover die folgenden Mappings durchgeführt.

Für MAX-ONE, dem Handelssystem der Börse München, erfolgt kein Datenmapping. Teilnehmer des Handelssystems MAX-ONE via XONTRO SAKI-FIX übertragen ihre Legitimationsdaten im Shortcode-Verfahren über die XONTRO-Infrastruktur zu MAX-ONE. Details zum Shortcode-Verfahren können dem MiFID II Newsletter 03 entnommen werden.

- 1) Client-Identification-Code

Wird der Client-Identification-Code nicht explizit übermittelt, so wird der Wert bei Anfragen der Competent Authorities immer mit „PNAL“ reported.

- 2.1) Execution-within-Firm (bei SAKI-Fix)

Wird nur das Feld Client-Identification-Code übermittelt, so wird das Feld Execution-within-Firm bei Anfragen der Competent Authorities mit „NORE“ reported.

Werden nur die Felder Client-Identification-Code und Investment-Decision-within-Firm übermittelt, so wird das Feld Execution-within-Firm bei Anfragen der Competent Authorities mit „NORE“ reported.

Wird nur das Feld Investment-Decision-within-Firm übermittelt, so wird die Order abgelehnt.

Wird keines der Felder Client-Identification-Code, Investment-Decision-within-Firm und Execution-within-Firm übermittelt, **so wird die Ordernummer im Shortcode-Antwortfile mit dem Fehler XO8000E protokolliert**. In diesem Fall wird das Feld Execution-within-Firm bei Anfragen der Competent Authorities mit dem verantwortlichen Händler des Kreditinstituts reported, vorausgesetzt, für diesen liegt eine gültige Legitimation im System vor.

- 2.2) Execution-within-Firm (bei SAM)

Wird nur das Feld Client-Identification-Code übermittelt, so wird das Feld Execution-within-Firm bei Anfragen der Competent Authorities mit „NORE“ reported.

Werden nur die Felder Client-Identification-Code und Investment-Decision-within-Firm übermittelt, so wird das Feld Execution-within-Firm bei Anfragen der Competent Authorities mit „NORE“ reported.

Wird nur das Feld Investment-Decision-within-Firm übermittelt, so wird die Order abgelehnt.

Wird keines der Felder Client-Identification-Code, Investment-Decision-within-Firm und Execution-within-Firm übermittelt, so wird das Feld Execution-within-Firm bei Anfragen der Competent Authorities mit der User-Legitimation aus dem jeweiligen SAM-Login-Kontext belegt, vorausgesetzt, für diese liegt eine gültige Legitimation im System vor.

- 2.3) Execution-within-Firm (verkürzte Eingabe im Dialog-Orderbuch)

Bei der verkürzten Eingabe von Orders durch den SKM im XONTRO Dialog-Orderbuch (BROS/OM) wird automatisch der hinterlegte verantwortliche Händler (ID-Kennzeichen) der Bank für die Belegung von Execution-within-Firm herangezogen.

Liegt kein verantwortlicher Händler der Bank vor, oder soll ein abweichender Händler angegeben werden, kann das legitimierte ID-Kennzeichen über das Zusatzfeld in BROS/OM eingegeben werden (siehe Newsletter 3).

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 11
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

5 Teilnehmersimulation

Alle bislang in den MiFID II Newslettern und den MiFID II Schnittstellenänderungsdokumenten beschriebenen Anpassungen des XONTRO Release 33 können ab dem 09.10.2017 in unserem Testsystem IMS27 getestet werden. Der produktive Einsatz ist für den 04.12.2017 vorgesehen.

Wir bitten, von den Testmöglichkeiten in dieser Zeit regen Gebrauch zu machen.

Während der Testphase stehen die bekannten fachlichen und technischen Ansprechpartner für Fragen und Unterstützungsleistungen gerne zur Verfügung.

Die Simulationsbetreuung ist auf die Zeit von 08:00 bis 17:00 Uhr beschränkt. Darüber hinaus gehende Simulationsanforderungen sind bitte im Vorfeld mit der XONTRO-Helpline terminlich abzustimmen.

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	Seite 12
MiFID II – Newsletter 4 – update 1 XONTRO Release 33	Version 1.01 02.02.2017

6 Fachlicher und Technischer Support

BrainTrade und die Deutsche Börse AG stellen während der Einführungs-, Simulations- und später auch Produktionsphase den fachlichen und technischen Support für die Teilnehmer in allen relevanten Fragestellungen sicher.

6.1 BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH

Aufgaben: Beratung und Support der Teilnehmer in allen **fachlichen** Fragestellungen. First Level Support bei technischen Fragestellungen zu den Themen SAKI-SWIFT, SAKI-FIX und SAM sowie zum Back End Betrieb.
 Fachliche Betreuung der Neuanmeldungen und Änderungen, der File-Transfers, der Connection Tests, der Simulationen und des Produktionsbetriebes.
 Bereitstellung von Dokumentationen.
 Durchführung von Schulungen.

Telefon: ++49 (69) – 58 99 78 – 110 (XONTRO- und SAKI-Helpline)
 ++49 (69) – 58 99 78 – 170 (SAM-Helpline)

Mail: trade@xontro.de
saki@xontro.de
sam@xontro.de

Internet: www.xontro.de

Erreichbarkeit: 07:30 bis 20:40 Uhr (Produktionsbetreuung)
 08:00 bis 17:00 Uhr (Simulationsbetreuung)

6.2 Deutsche Börse AG

Aufgaben: Technische Betreuung bei Fragen des Netzwerkes.

Telefon: ++49 (69) – 211 – 11281

Mail: tmr-zos@deutsche-boerse.com

Erreichbarkeit: 06:00 bis 22:00 Uhr (börsentäglich)