

XONTRO Order
Xentric® Order S.W.I.F.T.
Xentric® Order Xetra Frankfurt 2

Kreditinstitute

Technische Anbindung

Änderungen gültig ab 04.12.17

Version: 5.55

Stand: 31.05.17

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Inhaltsverzeichnis

1	EINFÜHRUNG	4
1.1	ALLGEMEINES.....	4
1.2	XONTRO – ANBINDUNG AN DIE XONTRO-BÖRSEN	5
1.3	INVESTRO – ANBINDUNG AN DAS FONDSABWICKLUNGSSYSTEM	6
1.4	XENTRIC ORDER S.W.I.F.T. – ANBINDUNG AN XETRA	7
1.5	XENTRIC ORDER FRANKFURT 2 – ANBINDUNG AN XETRA FRANKFURT 2	8
1.6	MAX-ONE – ANBINDUNG AN DIE BÖRSE MÜNCHEN.....	9
1.7	ANBINDUNGSARTEN	10
1.7.1	Dezentrale Anbindung	10
1.7.2	Zentrale Anbindung.....	11
2	ZUSAMMENSTELLUNG DER KONVENTIONEN FÜR DIE NACHRICHTENÜBERMITTLUNG	12
2.1	GRUNDSTRUKTUR EINER NACHRICHT	12
2.2	NACHRICHTENTYPEN	14
2.3	NACHRICHTENSYNTAX.....	15
2.3.1	Beschränkungen in der Länge	15
2.3.2	Art der erlaubten Zeichen	15
2.3.3	Besondere Formate.....	15
2.3.4	ISO-Codes.....	16
2.3.5	Wahlfreie Unterfelder	16
2.3.6	Code-Wörter	16
2.3.7	Auftragsnummern.....	16
2.3.8	Einteilung und Bestandteile der Felder	16
2.3.9	Pflicht- und Kann-Felder.....	17
2.3.10	Besonderheiten für die einzelnen Handelssysteme	17
2.4	NACHRICHTENAUFBAU	18
2.4.1	Blockstruktur.....	18
2.4.2	Grundstruktur einer S.W.I.F.T.-Adresse.....	23
2.4.3	Folgenummern.....	23
2.5	RESEND-FUNKTIONALITÄT	25
3	NACHRICHTENFORMATE.....	25
3.1	SYSTEMNACHRICHTEN.....	28
3.1.1	Anmeldung (MT 000)	30
3.1.2	Anmeldungsbestätigung, Passwortänderung und Änderung des Nachrichtenumfangs (MT 001)	33
3.1.3	Abmeldung (MT 002)	35
3.1.4	Abmeldungsbestätigung (MT 003)	36
3.1.5	Retrieval-Anforderung (MT 020).....	37
3.1.6	Antwort auf Retrieval (MT 021).....	39
3.2	WERTPAPIERBEZOGENE NACHRICHTEN	40
3.2.1	Kauforder / INVESTRO Kaufauftrag (MT 500).....	40
3.2.2	Verkauforder / INVESTRO Verkaufauftrag (MT 501)	56

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.3	Bankdirektgeschäft (MT 511).....	71
3.2.4	Schlussnote (MT 512).....	78
3.2.5	OTC Trade Report (MT 513).....	80
3.2.6	Orders zur Schlussnote (MT 599).....	84
3.2.7	Ausführungsbestätigung für Ausführung eines Fondsauftrages (MT 515).....	85
3.2.8	Ausführungsbestätigung (MT 519).....	89
3.2.9	Ereignisse im WP-Geschäft (MT 551).....	99
3.2.10	Anfrage: Änderung / Streichung / Storno / Durchlieferung (MT 595).....	113
3.2.11	Antwort (MT 596).....	133
3.2.12	Übersicht über Felder und Systeme.....	143
3.2.13	Nachricht für eigene Anwendung (MT 598).....	150
4	FEHLERHINWEISE	151
4.1	FEHLER IM NACHRICHTENKOPF / FORMATFEHLER.....	151
4.2	FEHLER IN DER NACHRICHT (MNN).....	151
4.3	FEHLER IM TEXT (TNN).....	151
4.4	PLAUSIBILITÄTS-FEHLER (CNN).....	152
4.5	RETRIEVAL-KONTINGENT-FEHLER (KNN).....	152
4.6	XONTRO - FEHLERMELDUNGEN / HINWEISE.....	152
4.7	XETRA - FEHLERMELDUNGEN / HINWEISE.....	157
5	BEISPIELE ZUR NACHRICHTENÜBERMITTLUNG	160
5.1	KAUFORDER (MT 500).....	160
5.2	VERKAUFORDER (MT 501).....	161
5.3	AUSFÜHRUNGSBESTÄTIGUNG (MT 519).....	163
5.4	EREIGNIS IM WERTPAPIERGESCHÄFT (MT 551).....	165
5.4.1	Kassakursmitteilung.....	165
5.4.2	Kursaussetzung für VW-Aktien in Frankfurt.....	165
5.5	SONSTIGE EREIGNISSE (MT 551).....	166
5.5.1	XONTRO Buchungsschnitt Ende.....	166
5.5.2	Handelsende MAX-ONE.....	166
5.5.3	Nachricht für SAKI-Ende vorläufig.....	167
5.5.4	Nachricht für SAKI-Ende.....	167
5.6	ANFRAGE (MT 595).....	167
5.6.1	Orderänderung.....	167
5.6.2	Orderstreichung.....	169
5.7	BANKDIREKTGESCHÄFT (MT 511) / STORNO UND DURCHLIEFERUNG (MT 595).....	170
5.7.1	Einstellung Bankdirektgeschäft.....	170
5.7.2	Storno Bankdirektgeschäft.....	170
5.7.3	Durchlieferung Bankdirektgeschäft.....	171
5.8	OTC TRADE REPORT (MT 513) / STORNO OTC TRADE REPORT (MT 595).....	172
5.8.1	Einstellung OTC Trade-Report.....	172
5.8.2	Storno OTC Trade Report.....	172
5.9	ANTWORT (MT 596).....	173
5.9.1	Bestätigung der Orderannahme.....	173

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

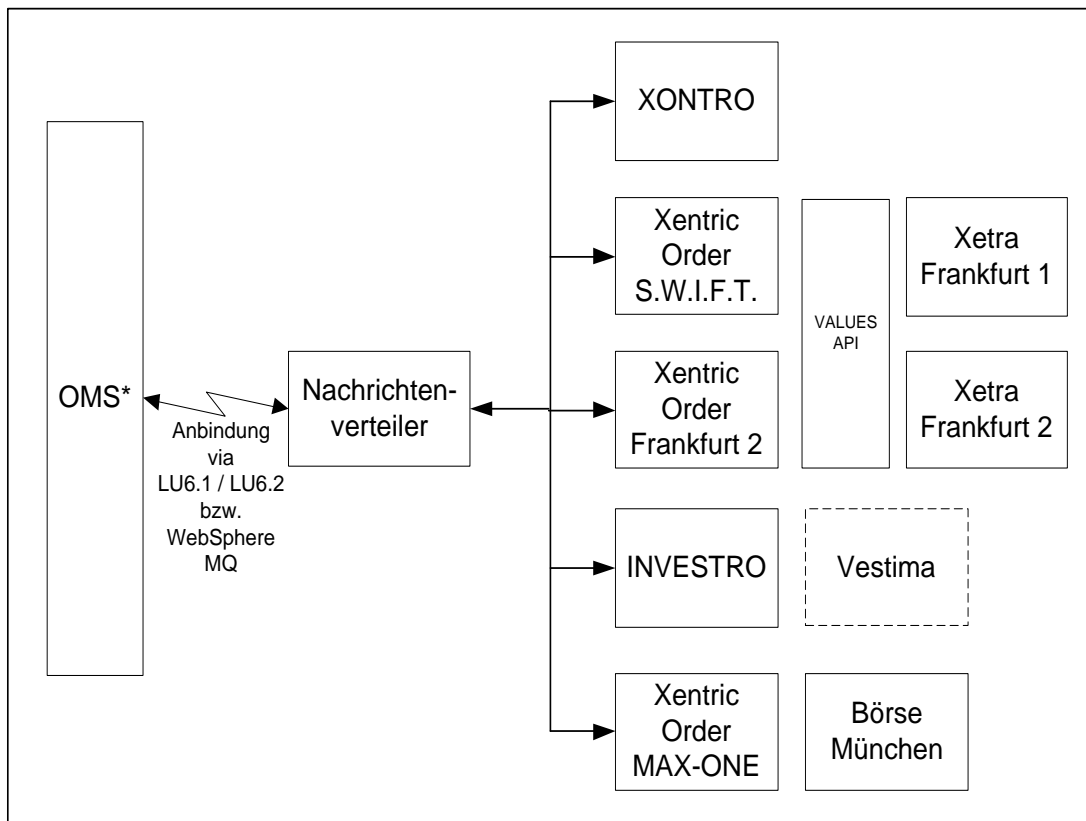
5.9.2	<i>Ablehnung wegen Datenfehler</i>	174
5.9.3	<i>Bestätigung einer Änderung</i>	176
5.9.4	<i>Bestätigung einer Streichung</i>	177
5.9.5	<i>Bestätigung eines Bankdirektgeschäfts</i>	178
5.9.6	<i>Bestätigung Storno eines Bankdirektgeschäfts</i>	178
5.9.7	<i>Bestätigung Durchlieferung eines Bankdirektgeschäfts</i>	179
5.9.8	<i>Bestätigung eines OTC-Trade-Reports</i>	180
5.9.9	<i>Bestätigung Storno eines OTC-Trade-Reports</i>	180
5.10	NACHRICHT FÜR EIGENE ANWENDUNG (MT 598)	181
5.10.1	<i>Login</i>	181
5.10.2	<i>Bestätigung Login</i>	181
5.10.3	<i>Rückmeldung fehlerhafter Nachrichten durch Kreditinstitut</i>	182
5.10.4	<i>Retrieval-Anforderung, Anfangs-OSN</i>	183
5.10.5	<i>Antwort auf Anforderung</i>	184
5.11	SCHLUSSNOTE (MT 512) / ORDERS ZUR SCHLUSSNOTE (MT 599)	185
5.11.1	<i>Schlussnote</i>	185
5.11.2	<i>Orders zur Schlussnote</i>	185
5.12	AUSFÜHRUNGSBESTÄTIGUNG FÜR EINEN FONDSAUFTRAG (MT 515)	186
5.12.1	<i>Ausführungsbestätigung für Investro-Depotbank, wenn der Orderaufgeber von Vestima+ ist</i>	186
5.12.2	<i>Ausführungsbestätigung für Investro-Orderaufgeber, wenn der OHA von Vestima+ ist</i>	187

Kreditinstitute - Technische Anbindung

1 Einführung

1.1 Allgemeines

Dieses Dokument beschreibt die Anbindung der Ordermanagementsysteme der Kreditinstitute an das Börsenhandelssystem XONTRO, an INVESTRO, an das Orderrountingsystem Xentric^{®1} Order Xetra (Frankfurt 1 und Frankfurt 2) der Deutsche Börse AG und an das Handelssystem MAX-ONE der Börse München.



* OMS = Ordermanagementsystem der Kreditinstitute

¹ Xentric[®] ist eine eingetragene Marke der Deutsche Börse AG.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

1.2 XONTRO – Anbindung an die XONTRO-Börsen

Seit Dezember 1992 wird XONTRO an der FWB und seit September 1993 an allen deutschen Börsen erfolgreich eingesetzt. Die zugelassenen Marktteilnehmer haben die Möglichkeit, XONTRO börsentäglich von ca. 02:00 Uhr bis derzeit 22:15 Uhr zu nutzen. Dabei richtet sich die bereitgestellte Funktionalität nach den individuellen Handelszeiten der jeweiligen Börse.

Insgesamt nehmen bundesweit über 150 Kreditinstitute mit ihren Filialen an XONTRO teil.

XONTRO ist für alle am Handel beteiligten Kreditinstitute, Makler und skontroführenden Freimakler konzipiert.

XONTRO Order

Der XONTRO Systemanschluss KI bietet ein professionelles Orrerrouting zu den sechs deutschen Skontroführerbörsen (XONTRO Börsen).

Der XONTRO Systemanschluss KI ermöglicht den zum Börsenhandel an den jeweiligen Börsenplätzen zugelassenen Kreditinstituten nach erfolgreicher elektronischer Anmeldung ihres hauseigenen Ordermanagementsystems (OMS) die Übermittlung von Order- und Auftragsinformationen (Einstellung, Änderung und Löschung) direkt in das Skontro des entsprechenden skontroführenden Maklers. Die Preisfeststellung wird durch das dem Makler zur Verfügung stehende Skontro (elektronisches Orderbuch) unterstützt.

Jeder Nachrichtenerhalt wird von dem Börsensystem XONTRO bestätigt. Darüber hinaus werden die Teilnehmerapplikationen auch über jede Orderausführung per Einzelnachricht informiert.

XONTRO Trade

Der XONTRO Systemanschluss KI ermöglicht des Weiteren die Eingabe von Bankdirektgeschäften (Platz und PÜEV), sowie deren Storno bzw. Durchlieferung. Diese Nachrichten werden an XONTRO Trade weitergeleitet.

Darüber hinaus werden die Teilnehmerapplikationen auch über jede Schlussnote per Einzelnachricht informiert.

Um die Konsistenz des Nachrichtenflusses auf der Teilnehmerseite sicherzustellen, können alle von den Börsen zu den Teilnehmersystemen geschickten Nachrichten mit Hilfe einer Retrievalfunktionalität während des laufenden Börsentages abgerufen werden.

Auf Wunsch des Teilnehmers werden die File-Transfers "Orderbestandsabgleich" und "File Historische Nachrichten" nach einem Börsentag übermittelt.

Rechtliche Rahmenbedingungen für die Teilnahme

An den jeweiligen Börsen dürfen nur Kreditinstitute handeln, die zum Börsenhandel zugelassen sind und eine CBF-Konto-Nr. am gleichen Platz besitzen.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

1.3 **INVESTRO – Anbindung an das Fondsabwicklungssystem**

INVESTRO ist das Fondsabwicklungssystem von XONTRO. Mit INVESTRO erweitert BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH das Anwendungsgebiet ihres Kernprodukts XONTRO.

Die teilnehmenden Kreditinstitute haben die Möglichkeit, INVESTRO werktäglich (Clearing-Kalender) von ca. 01:00 Uhr bis ca. 20:30 Uhr zu nutzen.

Der INVESTRO Systemanschluss ist technisch identisch mit dem XONTRO Systemanschluss für Kreditinstitute.

Er ermöglicht den Kreditinstituten über ihr hausinternes Ordermanagementsystem den Datenaustausch von Auftragsinformationen (Einstellung, Löschung und Preisauszeichnung). Die Auftragsinformationen werden an das empfangende Institut weitergeleitet.

Die bei der Preisauszeichnung entstehenden Schlussnoten können zusätzlich über den Systemanschluss bezogen werden.

Um die Konsistenz des Nachrichtenflusses sicherzustellen, können alle zu den Teilnehmersystemen gesendeten Nachrichten mit der Retrievalfunktionalität während des laufenden Tages abgerufen werden.

Auf Wunsch des Teilnehmers werden die File-Transfers "Orderbestandsabgleich" und "File Historische Nachrichten" aus der abendlichen INVESTRO-Batchverarbeitung heraus übermittelt.

Abhängig von Annahmeschluss und Preislieferung des jeweiligen Instruments werden offene Aufträge im halbstündlichen Rhythmus ausgezeichnet.

Rahmenbedingungen für die Teilnahme

An INVESTRO können alle Kreditinstitute teilnehmen, die eine CBF-Konto-Nr. besitzen, an einer Börse zugelassen sind und als INVESTRO Teilnehmer von der BrainTrade zugelassen wurden.

Mit Einsatz des XONTRO Releases 27 können von INVESTRO-Teilnehmern auch Aufträge an das Abwicklungssystem Vestima+ geroutet werden. Nach Ausführung des Auftrages durch Vestima+ erhält der INVESTRO-Aufgeber eine Ausführungsbestätigung im SWIFT-Format ISO 15022.

Ebenso können dann Auftragsaufgeber aus Vestima+ Aufträge in Gattungen aufgeben, die in INVESTRO abgewickelt werden. Nach Ausführung des Auftrages in einer Preisfeststellung erhält die INVESTRO-Depotbank eine Kopie der Ausführungsbestätigung im SWIFT-Format ISO 15022.

Hinweis:

Die im Folgenden für INVESTRO beschriebenen Nachrichtenformate und Feldbelegungen gelten ebenfalls für VESTIMA+. Abweichungen hiervon, die nur für den Nachrichtenaustausch mit Beteiligung von Vestima+ gelten, sind mit INVESTRO/VESTIMA+ gekennzeichnet.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

1.4 **Xentric Order S.W.I.F.T. – Anbindung an Xetra**

Die Deutsche Börse bietet über Xentric Order S.W.I.F.T. die Möglichkeit des Order routings nach Xetra^{®1} über die hier beschriebene Schnittstelle (S.W.I.F.T.-Formate). Die Deutsche Börse übernimmt bei dieser Anbindungsvariante den Betrieb der Xetra-MISS für den Teilnehmer. Ferner ist es erforderlich, dass der Teilnehmer die Software Xentric Order S.W.I.F.T. bei der Deutsche Börse lizenziert.

Xentric Order bietet ein professionelles Order routing zu den elektronischen Handelssystemen der Deutsche Börse AG. Es nimmt Nachrichten vom Ordermanagementsystem des Kreditinstituts aus dem in diesem Handbuch beschriebenen Systemanschluss entgegen und sendet diese an das Handelssystem Xetra. Die vom Handelssystem Xetra erhaltenen Antworten werden verarbeitet und über die Schnittstelle an das Ordermanagementsystem des Kreditinstituts weitergeleitet.

Um die Konsistenz des Nachrichtenflusses auf der Teilnehmerseite sicherzustellen, können alle von den Börsen zu den Teilnehmersystemen geschickten Nachrichten mit der Retrievalfunktionalität während des laufenden Börsentages abgerufen werden.

Rahmenbedingungen für die Teilnahme

Voraussetzungen für die Teilnahme am Börsenplatz Xetra sind die Xetra-Mitgliedschaft und die Xetra-Member-ID. Es erfolgt eine Zuordnung der CBF-Konto-Nr. zur Xetra-Member-ID.

Der Betrieb der Xetra-MISS des Teilnehmers erfolgt im Rechenzentrum der Deutsche Börse AG. Die Lizenzierung des Produktes Xentric Order S.W.I.F.T. erfolgt ebenfalls über die Deutsche Börse AG.

¹ Xetra[®] ist eine eingetragene Marke der Deutsche Börse AG.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

1.5 Xentric Order Frankfurt 2 – Anbindung an Xetra Frankfurt 2

Die Deutsche Börse bietet über Xentric Order Frankfurt 2 die Möglichkeit des Order routings nach Xetra Frankfurt 2 über die hier beschriebene Schnittstelle (S.W.I.F.T.-Formate). Die Deutsche Börse übernimmt bei dieser Anbindungsvariante den Betrieb der Xetra-MISS für den Teilnehmer.

Xentric Order bietet ein professionelles Order routing zu den elektronischen Handelssystemen der Deutsche Börse AG. Es nimmt Nachrichten vom Ordermanagementsystem des Kreditinstituts aus dem in diesem Handbuch beschriebenen Systemanschluss entgegen und sendet diese an das Handelssystem Xetra Frankfurt 2. Die vom Handelssystem Xetra Frankfurt 2 erhaltenen Antworten werden verarbeitet und über die Schnittstelle an das Ordermanagementsystem des Kreditinstituts weitergeleitet.

Um die Konsistenz des Nachrichtenflusses auf der Teilnehmerseite sicherzustellen, können alle von den Börsen zu den Teilnehmersystemen geschickten Nachrichten mit der Retrievalfunktionalität während des laufenden Börsentages abgerufen werden.

Rahmenbedingungen für die Teilnahme

Voraussetzungen für die Teilnahme am Börsenplatz Xetra Frankfurt 2 sind die Xetra-Mitgliedschaft und die Xetra-Member-ID. Es erfolgt eine Zuordnung der CBF-Konto-Nr. zur Xetra-Member-ID.

Der Betrieb der Xetra-MISS des Teilnehmers erfolgt im Rechenzentrum der Deutsche Börse AG.

Hinweis:

Die im Folgenden für Xetra beschriebenen Nachrichtenformate und Feldbelegungen gelten ebenfalls für Xetra Frankfurt 2.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

1.6 MAX-ONE – Anbindung an die Börse München

Das Ordermanagementsystem des Kreditinstituts hat die Möglichkeit, über die hier beschriebene Schnittstelle (S.W.I.F.T.-Formate) und Xentric Order MAX-ONE Orders an das Handelssystem MAX-ONE der Börse München zu übermitteln.

Die vom Handelssystem erhaltenen Antworten werden verarbeitet und über die Schnittstelle an das Ordermanagementsystem des Kreditinstituts weitergeleitet.

Des Weiteren besteht die Möglichkeit der Eingabe von Bankdirektgeschäften (Platz und PÜEV). Diese werden an XONTRO Trade weitergeleitet.

Der Erhalt von Schlussnoten ist ebenfalls möglich.

Um die Konsistenz des Nachrichtenflusses auf der Teilnehmerseite sicherzustellen, können alle von den Börsen zu den Teilnehmersystemen geschickten Nachrichten mit der Retrievalfunktionalität während des laufenden Börsentages abgerufen werden.

Rahmenbedingungen für die Teilnahme:

Voraussetzungen für die Teilnahme am Handelssystem MAX-ONE ist die Mitgliedschaft an der Börse München und das Vorhandensein einer CBF-Konto-Nr. an der Börse München.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

1.7 Anbindungsarten

1.7.1 Dezentrale Anbindung

Jede CBF-Konto-Nr. eines Instituts wird als eigenständiger Systemanschluss behandelt. Es können von einem Rechenzentrum Nachrichten für alle Niederlassungen (CBF-Konto-Nr./Börsenplätze) eines Instituts ausgetauscht werden. Dabei können für alle CBF-Konto-Nr. die gleichen Leitungsverbindungen genutzt werden. Folgende Aktionen müssen jedoch pro CBF-Konto-Nr. durchgeführt bzw. beachtet werden:

- Generierung von Sets von Logical-Units (LUs; siehe Technische Anbindung / Anhänge)
- Anmeldung:
 - Für jedes LTERM (Sender/Empfänger) erfolgt eine Anmeldung durch die Bank, gekennzeichnet durch die CBF-Konto-Nr.
 - Für jedes LTERM erhält das Kreditinstitut eine Anmeldebestätigung.
- Abmeldung:
 - Für jedes LTERM (Sender/Empfänger) erfolgt eine Abmeldung durch die Bank, gekennzeichnet durch die CBF-Konto-Nr.
 - Für jedes LTERM erhält das Kreditinstitut eine Abmeldebestätigung. Bei der jeweils letzten Abmeldung (pro CBF-Konto-Nr.) erfolgt die Angabe der höchsten vergebenen OSN pro CBF-Konto-Nr.
- ISN/OSN-Vergabe:
 - Die ISN/OSN-Vergabe bzw. Prüfung erfolgt sowohl bei der Deutsche Börse AG als auch bei den angeschlossenen Kreditinstituten pro Niederlassung bzw. Zentrale d.h. pro CBF-Konto-Nr.
- Bundesweit gültige Ereignismitteilungen (MT551) werden pro CBF-Konto-Nr. erstellt.
z.B.:
 - BOEND
 - NOT02
- Die Belegung des Benutzerprofile in der Verarbeitungssteuerung erfolgt pro CBF-Konto-Nr.
- S.W.I.F.T.-Adresse der Nachrichtenformate:
 - Jede CBF-Konto-Nr. muss eine eigene S.W.I.F.T.-Adresse im Header angeben.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

1.7.2 Zentrale Anbindung

Ein Institut wählt eine CBF-Konto-Nr. als Zentrale und weitere Niederlassungen (CBF-Konto-Nr./Börsenplätze) als Filialen des Systemanschlusses aus. Die Zentrale mit allen Filialen eines Kreditinstituts wird wie ein Institut behandelt. Der Datenaustausch erfolgt zwingend über ein Rechenzentrum. Folgende Aktionen werden lediglich einmal für die CBF-Konto-Nr. der Zentrale durchgeführt und gelten damit für alle CBF-Konto-Nr. analog:

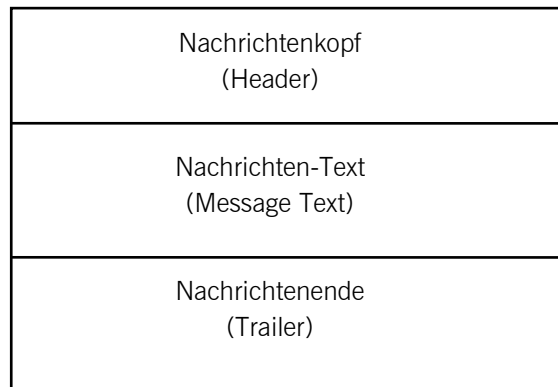
- Generierung eines Sets von Logical-Units (LUs; siehe Technische Anbindung / Anhänge) für die Zentrale
- Anmeldung:
 - Für jedes LTERM (Sender/Empfänger) erfolgt lediglich für die Zentrale, gekennzeichnet durch die CBF-Konto-Nr. der Zentrale, eine Anmeldung.
 - Für jedes LTERM erhält die Zentrale eine Anmeldebestätigung.
- Abmeldung:
 - Für jedes LTERM (Sender/Empfänger) der Zentrale erfolgt, gekennzeichnet durch die CBF-Konto-Nr., eine Abmeldung durch die Bank.
 - Für jedes LTERM erhält das Kreditinstitut eine Abmeldebestätigung; bei der letzten Abmeldung der Zentrale erfolgt die Angabe der höchsten pro Nummerkreis vergebenen OSN der Zentrale.
- ISN/OSN-Vergabe:
 - Die ISN/OSN-Vergabe bzw. Prüfung erfolgt für alle Niederlassungen in nur einem Nummernkreis (Nummernkreis der Zentrale). Somit ist eine Retrieval-Anforderung für alle Sätze einer Niederlassung nicht möglich, da pro Niederlassung keine ISN/OSN-Vergabe stattfindet.
- Bundesweit gültige Ereignismitteilungen (MT551) werden nur einmal an die Zentrale des Kreditinstitutes übermittelt. Beispiele hierfür sind:
 - BOEND
 - NOT02
- Die Belegung des Benutzerprofile in der Verarbeitungssteuerung erfolgt nur einmal für die Zentrale des Kreditinstituts und gilt analog für alle Filialen.
- S.W.I.F.T.-Adresse der Nachrichtenformate:
 - Alle Nachrichten enthalten die S.W.I.F.T.-Adresse der Zentrale im Header. Die Identifizierung der CBF-Konto-Nr. des Instituts (Zentrale bzw. Filiale) erfolgt in den Nachrichtenformaten MT500/MT501 über Feld F:82D und MT595 im Feld F:75.

Bemerkung: Für File-Transfer ist sowohl die dezentrale als auch die zentrale Anbindung realisiert.

2 Zusammenstellung der Konventionen für die Nachrichtenübermittlung

In diesem Abschnitt werden die relevanten Konventionen der Nachrichtenübermittlung dargestellt. Die Nachrichten wurden von ihrem Aufbau her an das S.W.I.F.T.-Format angelehnt.

2.1 Grundstruktur einer Nachricht



Nachrichtenkopf und Nachrichtenende bilden zusammen den "Briefumschlag" (Envelope).

Die einzelnen Felder werden mittels Steuerzeichen voneinander getrennt (Field Separator):

- Nachrichtenanfang (Start of Message) = SOH (Hex '01')
- Feldbegrenzung (Field Separator within Text) = CrLf: (Hex '0D257A')
- Textende (End of Text) = CrLf- (Hex '0D2560')
- Ende der gesamten Nachricht (End of Message) = ETX (Hex '03')
- Neue Zeile (New Line) = CrLf (Hex '0D25')

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Die Felder im Nachrichten-Text beginnen jeweils mit einem Etikett (Tag) gefolgt von einem ":"

Doppelpunkt = Begrenzung Feldetikett

Neue Zeile = Feldbegrenzung
+ Doppelpunkt Jedes Feld beginnt mit einem Doppelpunkt

Bindestrich = Textende

Doppelpunkt und Bindestrich dürfen deshalb nicht als erstes Zeichen einer Zeile verwendet werden.

Der **Nachrichtenkopf** (Header) beinhaltet die Bestimmungs- und Sendeadresse, die fortlaufende Nummer, den Nachrichtentyp und die Priorität.

Der **Nachrichten-Text** (Message-Text) besteht aus einer Folge von Feldern, die bestimmten Konventionen unterliegen. Unterfelder (Subfields) werden gekennzeichnet durch Schrägstrich(e) = Slash (/, //).

Entsprechend des Nachrichtentyps kann sich der Text aus einem geschlossenen Block oder aus mehreren Abschnitten (Sections) zusammensetzen. Einige Abschnitte können innerhalb einer Nachricht mehrfach auftreten (Sequence). Dabei darf allerdings die Maximallänge einer Nachricht von 2000 Zeichen nicht überschritten werden.

Das **Nachrichtenende** (Trailer) kann als Bestandteil der Nachricht fehlen.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.2 Nachrichtentypen

Jede Nachricht wird durch den Nachrichtentyp eindeutig spezifiziert. Der **Nachrichtentyp** besteht aus drei Ziffern.

Nachrichtentyp	
500	Kauforder / INVESTRO Kaufauftrag
501	Verkauforder / INVESTRO Verkaufauftrag
511	Bankdirektgeschäft
512	Schlussnote
513	OTC Trade Report
515	Ausführungsbestätigung bei Beteiligung von Vestima+ (im ISO-SWIFT Format 15022)
519	Ausführungsbestätigung
551	Nachricht über ein Ereignis
595	Anfrage: Änderung / Streichung (Order / INVESTRO Auftrag) / Storno / Durchlieferung
596	Antwort
598	Nachricht für eigene Anwendung
599	Orders einer Schlussnote

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.3 Nachrichtensyntax

2.3.1 Beschränkungen in der Länge

nn	maximale Länge
nn-nn	minimale und maximale Länge
<u>nn</u>	feste Länge
nn*nn	maximale Anzahl von Zeilen mal maximale Zeilenlänge

2.3.2 Art der erlaubten Zeichen

n	nur Ziffern
a	nur Buchstaben
c	nur Buchstaben und Ziffern
b	nur Leerzeichen
x	jedes Zeichen aus dem zugelassenen Zeichenvorrat einschließlich Blanks: a - z A - Z 0 - 9 Sonderzeichen: / - ? : () . , ' + \$ % & (nur für F35B Unterfeld Wertpapierkurzbezeichnung zulässig)

2.3.3 Besondere Formate

<u>6</u> n	Datum in der ISO-Norm (JJMMTT)
nn....n,	Wertzahlen (z.B.: Beträge)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.3.4 ISO-Codes

z.B.: Währungs-Code (EUR, USD)

2.3.5 Wahlfreie Unterfelder

Wahlfreie Unterfelder erscheinen in [...]

2.3.6 Code-Wörter

z.B. ISIN, DWZ-USER, ...

2.3.7 Auftragsnummern

Nicht zugelassen ist ein Schrägstrich "/" als erstes oder letztes Zeichen des Feldes oder zwei aufeinander folgende Schrägstriche "/" innerhalb des Feldes.

2.3.8 Einteilung und Bestandteile der Felder

Die Felder sind in Gruppen eingeteilt, die durch das erste Zeichen des Etiketts gekennzeichnet sind.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.3.9 Pflicht- und Kann-Felder

Das Format jedes Nachrichtentyps unterscheidet eine Anzahl von Feldern fester und variabler Länge, deren Vorhandensein zwingend vorgeschrieben oder freigestellt sein kann.

O = Kann-Feld (Optional)

M = Pflicht-Feld (Mandatory)

Ein zwingend vorgeschriebenes Feld muss bei jeder Anwendung vorhanden sein.

Ein nicht zulässiges Feld, oder ein Feld, das in der Formatbeschreibung für einen einzelnen Typ nicht erscheint, darf niemals vorkommen.

2.3.10 Besonderheiten für die einzelnen Handelssysteme

Die für die einzelnen Handelssysteme relevanten Felder sind in einer tabellarischen Übersicht im Kapitel Nachrichtenformate aufgeführt.

Ungültige Sonderzeichen in Textfeldern bzw. im Feld "Bankinterne Ordernummer" werden bei der Eingabe über eine Frontend-Applikation in das Zeichen "?" konvertiert.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.4 Nachrichtenaufbau

2.4.1 Blockstruktur

Die Transaktionen (Nachrichten) bestehen aus maximal fünf Blöcken:

NACHRICHT	BASIC HEADER
	ANWENDUNGS-HEADER
	TEXT
	[TRAILER]
	([] = Wahlfrei)

Die Hauptblöcke beginnen mit einem Kennzeichen aus einer Ziffer gefolgt von einem Doppelpunkt:

1:	=	Basic-Header
2:	=	Anwendungs-Header
4:	=	Textblock
5:	=	Trailer-Block

Zwingend vorgeschriebene Blöcke sind der Basic-Header, der Anwendungs-Header und der Textblock. Jeder Block einer Nachricht beginnt und endet mit einer geschweiften Klammer '{' und '}' (HEX 'CO' bzw. HEX 'DO').

Jede Nachricht wird als fortlaufende Zeichenkette übertragen.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.4.1.1 Beschreibung: Basic-Header

Blockkennzeichen	=	1:	
Anwendungs-Kennzeichen	=	F	
Kennung Dateneinheit	=	01	
S.W.I.F.T.-Adresse	=	<u>4a2a2c1c3c</u>	
		Eingabenachrichten:	S.W.I.F.T.-Adresse des Senders
		Ausgabenachrichten:	S.W.I.F.T.-Adresse des Empfängers
Sitzungsnummer	=	0000	
		Eingabenachrichten:	Nicht relevant
		Ausgabenachrichten:	Überlauf für OSN-Bereiche
Folgenummer	=	<u>6</u> n	
			ISN / OSN

Beispiel:

{1:F01BANKDEFFAXX0000123456}

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.4.1.2 Beschreibung: Anwendungs-Header

Blockkennzeichen	=	2:
Kennzeichen für	=	<u>1</u> a Ein- / Ausgabe I für Eingabe (Bank → System) O für Ausgabe (System → Bank)
Transaktionstyp	=	<u>3</u> n Nachrichten-Typ
<i>Nur bei Eingabe:</i>		
Bestimmungsadresse	=	4a <u>2</u> a <u>2</u> c <u>1</u> c <u>3</u> c S.W.I.F.T.-Adresse des Empfängers
Priorität	=	N S für System U für Eilig N für Normal (für das Orderübermittlungssystem nicht relevant)
Überwachung der Zustellung	=	2 1 Warnmeldung bei Nichtzustellung 2 Meldung bei Zustellung 3 sowohl 1 als auch 2 (für das Orderübermittlungssystem nicht relevant)
Periode für Überfälligkeit	=	005 Einheiten von 5 Min (für das Orderübermittlungssystem nicht relevant)

Beispiel: Anwendungs-Header (Eingabe)**{2:1500DWZXDEFFABOSN2005}**

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Nur bei Ausgabe:

Uhrzeit der Eingabe	=	HHMM
Eingabereferenz	=	Eingabedatum (JJMMTT) S.W.I.F.T.-Adresse des Senders Sitzungsnummer ISN der zu referenzierenden Eingabenachricht bzw. '000000'
Ausgabedatum	=	JJMMTT
Uhrzeit der Ausgabe	=	HHMM
Priorität	=	N S für System U für Eilig N für Normal (für das Orderübermittlungssystem nicht relevant)

Beispiel: Anwendungs-Header (Ausgabe)

{2:05961200010430DWZXDEFFABOS00001234560104301201N}

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.4.1.3 Textblock

Siehe Kapitel 3 Nachrichtenformate.

2.4.1.4 Nachrichtenende (Trailer)

Der Trailer setzt sich aus einer Folge von Trailer-Bestandteilen zusammen. Eine Trailer-Komponente besteht aus einem dreistelligen Identikator, danach folgt wahlweise eine Information, welche Aussage über die einzelne Ursache gibt.

Das Orderübermittlungssystem überliert sämtliche Trailer-Angaben mit Ausnahme des TNG-Trailers (Training). Nachrichten mit TNG-Trailer werden von der Deutsche Börse AG geprüft und entsprechend bestätigt (MT596; DWZ-Ordernummer = 000000000000), jedoch nicht im System gespeichert. Rückmeldungen zu Trainingsnachrichten werden ebenfalls mit TNG-Trailer, alle anderen jedoch ohne Trailer-Block in die Ausgangs-DB geschrieben.

Damit werden Leitungstest und Tests der Formatprüfungsroutinen jederzeit im laufenden System ermöglicht.

XONTRO: Diese Funktion existiert für die Eingabe von Bankdirektgeschäften sowie deren Storno bzw. Durchlieferung nicht.

Xetra: Diese Funktion existiert in Xetra nicht.

MAX-ONE: Diese Funktion existiert in MAX-ONE nicht.

Beispiel: Nachrichtenende (Trailer)

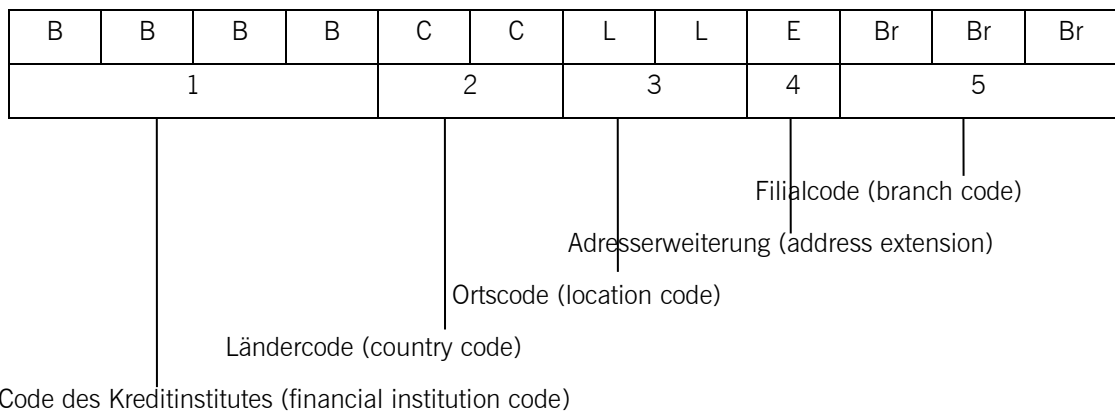
{5:{TNG:}}

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.4.2 Grundstruktur einer S.W.I.F.T.-Adresse

Die S.W.I.F.T.-Adresse besteht aus folgenden Unterfeldern:



Für das Börsensystem enthält die Adresserweiterung die Art des Transfers.

Mögliche Werte:

DWZXDEFFAXXX	=	Rechner-Rechner-Verbindung
DWZXDEFFBXXX	=	File-Transfer
DWZX	=	Adress-Code der Deutsche Börse AG
XXX	=	BOS: XONTRO (vormals BOSS-CUBE)

2.4.3 Folgenummern

2.4.3.1 Eingabefolgesteuerung (ISN: Input-Sequence-Number)

Jede Nachricht, die von der Bank versandt wird, muss eine 6-stellige Eingabefolgenummer (ISN) enthalten, die von der Bank vergeben wird und pro Tag eindeutig sein muss.

Bei eventuellen Störungen der Verbindung muss die Bank Nachrichten, die seitens der Deutsche Börse AG nicht quittiert wurden, nochmals mit der gleichen Eingabefolgenummer versenden. Bei der Deutsche Börse AG wird sichergestellt, dass Nachrichten mit gleicher Eingabefolgenummer nur einmal verarbeitet und quittiert werden.

Eine Nachricht mit der Kennzeichnung „Resend / Possibly Duplicate“ (vgl. MT500/MT501) muss mit einer neuen, eindeutigen ISN und identischen Orderdaten wie die Originalorder gesendet werden.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.4.3.2 **Ausgabefolgesteuerung (OSN: Output-Sequence-Number)**

Jede Nachricht, die von XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE in die Ausgangs-DB gesendet wurde und an die Bank übertragen bzw. zur Übertragung bereitgestellt wird, enthält eine Ausgabefolgennummer (OSN), die pro Bank fortlaufend und eindeutig von der Deutsche Börse AG pro Tag vergeben wird. Diese Ausgabefolgennummer muss von der Bank auf Eindeutigkeit geprüft werden, da nach Störungen ggf. Nachrichten von der Deutsche Börse AG doppelt versandt werden können (gleiche Ausgabefolgennummer).

Doppelte Nachrichten müssen von der Bank ignoriert werden. Die Nachrichten müssen auf der Bankenseite nicht zwingend mit fortlaufenden Ausgabefolgennummern ankommen (bei Nutzung mehrerer Empfangs-LTERMs).

Die OSN wird von der Deutsche Börse AG pro Bank in drei verschiedenen Nummernkreisen vergeben:

Rückmeldungen zu Orders und Anmeldungen	(000001 bis 299999)
Ereignisse / Ausführungsbestätigungen	(300001 bis 599999)
Rückmeldungen zu Bankdirektgeschäften, Storno und Durchlieferung	(600001 bis 999999)
Schlussnoten und Orders zu Schlussnoten	

Zum Tagesende müssen die bei der Bank eingetroffenen Nachrichten pro Nummernkreis in lückenloser Folge vorliegen.

Bei einem Überlauf der Nummernkreise wird mit dem ersten Wert des jeweiligen Nummernkreises fortgefahren und das Feld Sitzungsnummer im BASIC-Header hochgezählt. Retrievalanforderungen sind für diese Überlaufbereiche derzeit nicht möglich.

2.4.3.3 **Verfügbarkeit**

Der Systemanschluss Kreditinstitute ist derzeit an Börsentagen ab 01.00 Uhr verfügbar.

Die einzelnen Handelssysteme versenden am Ende des Börsentages eine entsprechende Ereignismitteilung. Der Systemanschluss Kreditinstitute ist nach Erhalt der letzten dieser Ereignismitteilungen derzeit noch 5 Minuten verfügbar. Nach diesem Zeitpunkt sollten von der Bank keine Nachrichten mehr übermittelt werden.

In der anschließenden Tagesendeverarbeitung wird vom System die Ereignismitteilung „SAKI-ENDE“ (siehe Kapitel 3.2.9) versendet und die Folgenummern werden auf Initialwert zurückgesetzt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2.5 Resend-Funktionalität

Die Resend-Funktionalität ermöglicht, eine bereits verschickte Ordereinstellung noch einmal zu senden, wenn auf die Originalnachricht keine Antwort angekommen ist. Sie steht ausschließlich für MT500/501 (Bank an System) nach Xetra zur Verfügung.

Beim Resend enthält die Nachricht identische Orderdaten wie der ursprüngliche MT500/501. Zusätzlich ist im Feld 23 das Unterfeld „Automatische Lieferfreigabe“ mit „D“ (Duplicate) belegt. Die BI-Ordernummer muss belegt und in Kombination mit den Orderattributen eindeutig sein. Die ISN ist neu und eindeutig.

Ein Resend für eine Ordereinstellung kann mehrfach versendet werden. Bei Nutzung der Resend-Funktionalität ist sichergestellt, dass eine Order nur einmal im Handelssystem erfasst wird.

Kann die Originalorder zu einem Resend nicht eindeutig bestimmt werden, wird die Nachricht mit der Fehlermeldung XK0050F „Orderdaten nicht eindeutig für Resend-Nachricht“ abgelehnt.

Die Antwort auf einen Resend wird mit der ISN der Resend-Nachricht referenziert. Eine ggf. noch ausstehende Orderbestätigung für die Originalorder wird mit der ISN des ursprünglichen MT500/501 im Feld „Eingabereferenz“ des Anwendungsheaders übertragen.

3 Nachrichtenformate

Im Folgenden werden zur Übersicht alle innerhalb des Order routings für alle Handelssysteme definierten Nachrichtentypen aufgezeigt.

(1) Von den Banken zum System

(1.1) Programm-Verbindung (LU 6.1 / LU 6.2)

- (1.1.1) Anmeldung an das System (MT000)
- (1.1.2) Passwortänderung (MT001)
- (1.1.3) Änderung Nachrichtenumfang (MT001)
- (1.1.4) Abmeldung vom System (MT002)
- (1.1.5) Retrieval-Anforderung (MT020)
- (1.1.6) Orderzugänge (MT500/MT501)
- (1.1.7) Einstellung Bankdirektgeschäft (MT511)
- (1.1.8) Änderungen / Streichungen von Orders, Storno bzw. Durchlieferung von Bankdirektgeschäften (MT595)
- (1.1.9) Rückmeldung von fehlerhaften Nachrichten (MT021)

Hinweis:

Der Empfangstransaktionscode auf Seiten der Deutsche Börse AG ist für alle Nachrichtentypen:

BC\$nnnnA (nnnn = CBF-Konto-Nr. des Kreditinstituts)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

(2) Von dem System zu den Banken:

(2.1) Programm-Verbindung (LU 6.1 / LU 6.2)

- (2.1.1) Anmeldungsbestätigung (MT001)
- (2.1.2) Bestätigung der Passwortänderung (MT001)
- (2.1.3) Bestätigung der Änderung des Nachrichtenumfangs (MT001)
- (2.1.4) Abmeldungsbestätigung (MT003)
- (2.1.5) Bestätigung der Retrieval-Anforderung (MT021)
- (2.1.6) Bestätigung bzw. Fehlermeldung bei maschinell übermittelten Orderzugängen, -änderungen, -streichungen, sowie Einstellungen, Storno und Durchlieferung von Bankdirektgeschäften (MT596)

Hinweis: Die detaillierte Beschreibung der Fehlermeldungen erfolgt im Abschnitt 4.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

- (2.1.7) Übermittlung / Protokollierung aller Orderzugänge (MT500/MT501), -änderungen und -löschungen (MT595), die in XONTRO über Terminal Eingaben der Bank oder von Maklern eingegeben wurden.
Übermittlung / Protokollierung aller Orderzugänge (MT500/MT501), -änderungen und -löschungen (MT595), die in Xetra über eine VALUES basierte Frontend-Applikation (mit einer Orderrouting Trader-ID) eingegeben wurde.
Übermittlung / Protokollierung aller INVESTRO Auftragszugänge (MT500/MT501) und -löschungen (MT595), die über Terminal Eingaben durch die Bank in das System eingegeben wurden.
Übermittlung / Protokollierung aller Orderzugänge (MT500/MT501), -änderungen und -löschungen (MT595), die in MAX-ONE über Terminal Eingaben der Bank bzw. über eine Frontend-Applikation eingegeben wurden.
- (2.1.8) Ausführungsbestätigungen für Fondaufträge mit Beteiligung von Vestima+ (MT515)
- (2.1.9) Ausführungsbestätigungen (MT519)
- (2.1.10) Ausführungsbestätigungen auf Gattungsebene für Kassakursfeststellungen (nur 'Bezahlt'-Kurse) (MT551)
- (2.1.11) Orderänderungen/-löschungen durch das System
- auf Gattungsebene (MT551)
 - auf Einzelorderebene (MT595)
- (2.1.12) Ereignismitteilungen (MT551)
- Einfügen, Ändern und Löschen eines Kurses
 - Allgemeine Information
 - Unterbrechung und Freigabe der Börsenversammlung
 - Änderung der Börsenzeit
 - Betriebsstörung wegen technischer Probleme
 - Wiederaufnahme des normalen Betriebes nach einer Betriebsstörung
 - Handelsunterbrechung in einer Gattung
- (2.1.13) Schlussnoten (MT512) und Orders zur Schlussnote (MT599)

Hinweis:

- Empfangstransaktionscodes für Banken mit LU6.1-Anbindung und IMS:
 - **BC01nnnn-BC04nnnn** (nnnn = CBF-Konto-Nr.)
- Empfangstransaktionscodes für Banken mit LU6.1-Anbindung und CICS:
 - **BC01-BC04**
- Zuordnung von Nachrichten zu Transaktionscodes:
 - **BC01nnnn bzw. BC01:** 2.1.1.; 2.1.2.; 2.1.3.; 2.1.4.; 2.1.5.
 - **BC02nnnn bzw. BC02:** 2.1.6.; 2.1.7.
 - **BC03nnnn bzw. BC03:** 2.1.8.; 2.1.9., 2.1.10., 2.1.13.
 - **BC04nnnn bzw. BC04:** 2.1.11.; 2.1.12.
- Empfangstransaktionscodes für Banken mit LU6.2-Anbindung
 - **BC01**
- Für Banken mit Anbindung über IBM WebSphere MQ gibt es keine Empfangstransaktionscodes

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

(2.2) File-Transfer

(2.2.1) Bestandsabgleich (XONTRO, INVESTRO und MAX-ONE / **nicht** Xetra):

Enthält alle noch ausführbaren Orders von XONTRO und MAX-ONE sowie INVESTRO-Aufträge zu Kontrollzwecken (MT500/MT501) und evtl. dazugehörige Folgesätze (MT596).

Enthält zusätzlich alle Orders (MT500/MT501), die wegen Einstellung der Notierung in der Tagesendverarbeitung von XONTRO gestrichen wurden und evtl. dazugehörige Folgesätze (MT596).

Xetra: Ein Bestandsabgleich kann über die eigene MISS aus den Reports (und den darin enthaltenen Informationen) durchgeführt werden.

(2.2.2) Historische Nachrichten:

Falls die Leitungsverbindung zwischen Bank und der Deutsche Börse AG bis zum Online-Ende gestört ist, kann ein FT/Datenträger der am Tage angefallenen Nachrichten aller Systeme telefonisch bei der Deutsche Börse AG (069-211-11000) angefordert werden.

(2.2.3) Schlussnoten-Datenträger aus XONTRO Trade:

Enthält Geschäftsbestätigungen und Schlussnoten (MT512), sowie Orders zu Schlussnoten (MT599)

Im Folgenden werden die einzelnen Nachrichtentypen detailliert beschrieben.

Anmerkung:

- (1) Die Satzaufbauten der einzelnen Nachrichtentypen sind bei Programm-Verbindung und File-Transfer identisch.
- (2) Bei File-Transfers ist die zu übertragende Datei wie folgt aufzubauen:
 - Vorsatz (MT000 bzw. MT598)
 - 1. Datensatz
 - 2. Datensatz
 - ...
 - n. Datensatz
 - Nachsatz (MT002 bzw. MT598)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Die Systemnachrichten werden in den MT598 eingebettet.

Da die nachfolgend beschriebenen Systemnachrichten als Textstring dargestellt werden, können die Formate nach den Bedürfnissen der Deutsche Börse AG individuell angepasst werden. Dies gilt z.B. für den Geschäftsvorfallcode oder andere Darstellungen der User-ID. Dabei darf jedoch die Gesamtlänge von 73x nicht überschritten werden.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.1.1 Anmeldung (MT 000)

Urheber:	Benutzer (Bank) und Systeme (XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE)	
Bank:	Das logische Terminal (LTERM) gibt sich gegenüber dem System der Deutsche Börse AG zu erkennen. Mit der Anmeldung des Empfänger LTERMS wird der Umfang des Nachrichtenaustauschs für das betreffende LTERM definiert. Dieser Umfang kann durch MT001 modifiziert werden. Erst nach erfolgreicher Anmeldung kann die Bank weitere Nachrichten an das System senden bzw. Nachrichten vom System erhalten. Ausnahme: Passwortänderung und Retrieval ist ohne vorherige Anmeldung möglich.	
System:	Vorsatz bei File-Transfers	
Format:	10x/[8x1a]/[5a]/[6n6n]/	
Inhalt:	<p>User-ID, 10x</p> <p>bei File-Transfer = "BOSSnnn":</p> <p style="padding-left: 20px;">Anwendungskennung ("BOSS")</p> <p style="padding-left: 20px;">GV-Code</p> <p style="padding-left: 40px;">- 011 Orderbestandsabgleich</p> <p style="padding-left: 40px;">- 016 Historische Nachrichten (ab Anfangs OSN)</p> <p>Passwort (entfällt bei File-Transfer) /[8x</p> <p>KZ Sender/Empfänger (entfällt bei File-Transfer) 1a]</p> <p style="padding-left: 20px;">S: Bank sendet Nachrichten über entspr. LTERM</p> <p style="padding-left: 20px;">E: Bank empfängt Nachrichten über entspr. LTERM</p> <p>Umfang Nachrichtenaustausch: (entfällt bei File-Transfer; nur bei Anmeldung durch Bank und KZ Sender/Empfänger = 'E') /[5a]</p> <p style="padding-left: 20px;">1. Stelle: Bestätigung/Rückmeldung von Orderübermittlung Y/N/D</p> <p style="padding-left: 20px;">2. Stelle: Ausführungsbestätigung Y/N/D</p> <p style="padding-left: 20px;">3. Stelle: Ereignismitteilung Y/N/D</p> <p style="padding-left: 40px;">Für INVESTRO ist dieses Feld nicht relevant.</p> <p style="padding-left: 20px;">4. Stelle: Veränderung Orderbestand wegen Nebenrechten Y/N/D</p> <p style="padding-left: 40px;">Für Xetra ist dieses Feld nicht relevant.</p> <p style="padding-left: 40px;">Für INVESTRO ist dieses Feld nicht relevant.</p>	

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5. Stelle:	XONTRO: Übermittlung der Terminaleingaben Xetra: Übermittlung der Eingaben über eine VALUES basierte Frontend-Applikation INVESTRO: Übermittlung der Terminaleingaben MAX-ONE: Übermittlung der Terminaleingaben und der Eingaben über eine Frontend-Applikation (D)Default: Benutzerprofile (muss vor Einsatztermin schriftlich mitgeteilt werden).	Y/N/D
------------	---	-------

Das im Default-Benutzerprofile (siehe Anwendungsbeschreibung) nicht definierte Ereignis '**Betriebsstörung**' wird den Banken generell und unabhängig von der Parametrierung mitgeteilt.

Der Empfang von Schlussnoten (MT512, MT599) kann ebenfalls nicht über den Umfang Nachrichtenaustausch beeinflusst werden.

Der Empfang von Ausführungen von Aufträgen in Investro/Vestima+ (MT515) kann ebenfalls nicht über den Umfang Nachrichtenaustausch beeinflusst werden.

Alle im Benutzerprofile mit '**INFO ...**' beginnenden Nachrichten werden hier unter dem Begriff '**Ereignismitteilung**' zusammengefasst parametrierung.

Erstellungsdatum (JJMMTT)

/[6n

nur bei File-Transfer:

der Bestandsabgleich wird am Ende des Börsentages erstellt und enthält hier generell das Datum des abgelaufenen Börsentages, auch wenn der Datenträger am Folgetag erstellt wird.

Erstellungsuhrzeit (HHMMSS)

6n]/

nur bei File-Transfer

Zu Anmeldung:

Die Bank muss pro LTERM eine Anmeldung senden.

Es wird pro Bank eine Anmeldung über **zwei** LTERMs (LUs) empfohlen:

- ein LTERM zum Senden von Nachrichten (max. 4 LTERMS möglich)
- ein LTERM zum Empfangen von Nachrichten (max. 4 LTERMS möglich)

Hinweis: Die Rückmeldungen auf Anmeldung, Abmeldung, Passwortänderung, Änderung des Nachrichtenumfangs und Retrieval-Anforderung (MTO NN) werden jeweils über den LTERM versandt, auf dem die entsprechende Anfrage erfolgte (also auch über den Send-LTERM).

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Die Anmeldung erfolgt durch Angabe von USER-ID und PASSWORT. Eine Anmeldung über beide LTERMs mit der gleichen USER-ID ist möglich. Es sollte daher für jede Bank eine USER-ID definiert werden, die die Berechtigung erhält, über Programm-Programm-Verbindung Nachrichten zu senden.

Die Einrichtung der USER-ID inkl. Berechtigungen kann durch den Security-Beauftragten der Bank über Terminaleingabe durchgeführt werden.

Bei der Einrichtung einer USER-ID wird ein Ersterfassungs-Passwort vergeben. Dieses muss **vor** der ersten Anmeldung mit der USER-ID geändert werden (MT001). Das PASSWORT hat nur für einen gewissen Zeitraum (**z.Z. 1 Monat**) Gültigkeit. Nach Ablauf dieser Zeitspanne wird eine Anmeldung mit dem Hinweis BC1230F: 'PASSWORT ABGELAUFEN' abgelehnt. Eine gültige Anmeldung ist erst nach Änderung des Passworts möglich.

Weitere Informationen sind der Beschreibung des Security-Systems für Online-Anwendungen der Deutsche Börse AG zu entnehmen.

Treffen Nachrichten von Banken ein, ohne dass eine gültige Anmeldung erfolgt ist, so werden diese Nachrichten abgewiesen und den Kreditinstituten eine entsprechende Rückmeldung mit Fehlermeldung BC1330F gesandt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.1.2 Anmeldungsbestätigung, Passwortänderung und Änderung des Nachrichtenumfangs (MT 001)

Urheber:	Benutzer (Bank) und Systeme (XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE)	
Bank:	<p>(1) Änderung des Passworts: In zyklischen Abständen verlangt das System eine Änderung des Passworts durch den Benutzer. Eine Änderung des Passworts ist ohne vorherige erfolgreiche Anmeldung an das System möglich.</p> <p>(2) Änderung des Nachrichtenumfangs: Der in der Anmeldung spezifizierte Umfang kann hierüber modifiziert werden.</p>	
Systeme:	<p>(1) Bestätigung/Ablehnung der Anmeldung (MT000)</p> <p>(2) Bestätigung/Ablehnung der Passwortänderung (MT001)</p> <p>(3) Bestätigung/Ablehnung der Änderung des Nachrichtenumfangs (MT001)</p>	
Format:	[10x]/[8x][1a]/[8x]/[5a]/3n/[3x7x]	
Inhalt:	<p>User-ID, 10x</p> <p>Altes Passwort, /[8x]</p> <p>KZ Sender/Empfänger (vgl. MT000) [1a] (nur bei GV-Code = 102; 001; 002; 005; 006)</p> <p>Neues Passwort, /[8x]</p> <p>Umfang Nachrichtenaustausch (nur bei Empfangs-LTERM möglich; siehe MT000), Default: aktuellen Status beibehalten /[5a]</p> <p>Geschäftsvorfallcode von der Bank an System: /3n</p> <p>101 Passwortänderung</p> <p>102 Änderung Nachrichtenumfang</p> <p>Geschäftsvorfallcode von System an Bank</p> <p>001 Anmeldung akzeptiert</p> <p>002 Anmeldung abgelehnt</p> <p>003 Passwortänderung akzeptiert</p> <p>004 Passwortänderung abgelehnt</p> <p>005 Änderung Nachrichtenumfang akzeptiert</p> <p>006 Änderung Nachrichtenumfang abgelehnt</p> <p>007 ungültiger Nachrichtentyp (MT) bzw. Geschäftsvorfallcode</p> <p>Fehlercode: /[3x7x] Feldetikett, Fehlerhinweis (siehe Abschnitt Fehlerhinweise)</p>	

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Hinweis:

Die hier definierten Nachrichten, die an die Banken gesendet werden, enthalten die von der Bank gelieferten Datenfelder wie User-ID und Umfang Nachrichtenaustausch inkl. Geschäftsvorfallcode und ggf. Fehlercode. Ausnahme: GV-Code = 007 oder Datenfelder in S.W.I.F.T.-Nachricht nicht identifizierbar.

Die Felder altes Passwort und bei Passwortänderung auch das neue Passwort werden in der Antwort an die Banken anonymisiert, indem sie mit XXXXXXXX unkenntlich gemacht werden. Zu Auswertungszwecken dürfen diese beiden Felder aus der Antwort vom System damit nicht verwendet werden.

Die Rückmeldungen auf Anmeldung (MT000), Passwortänderung (MT001) und Änderung des Nachrichtenumfangs (MT001) werden jeweils über den LTERM versandt, auf dem die entsprechende Anfrage erfolgte (also auch über den Sende-LTERM).

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

3.1.3 Abmeldung (MT 002)

Urheber:	Benutzer (Bank) und Systeme (XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE)	
Bank:	Abmeldung des logischen Terminals (LTERM) gegenüber dem System	
Systeme:	Nachsatz bei File-Transfers	
Format:	10x/[6n]	
Inhalt:	User-ID	10x
	bei File-Transfer: "BOSS" (Anwendungskennung)	
	nur bei File-Transfer:	
	Anzahl übertragener Sätze (inkl. Vor- und Nachsatz)	/[6n]

Hinweis:

Bei Banken mit LU6.2-Anbindung wird bei der ersten Abmeldung der Sende-LTERM der Bank, bei der zweiten Abmeldung der Empfangs-LTERM der Bank abgemeldet.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.1.4 Abmeldungsbestätigung (MT 003)

Urheber:	Systeme (XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE)	
Systeme:	Bestätigung der Abmeldung (MT002) durch das System oder automatische Abmeldung durch das System	
Format:	10x/6n/3n/[6n]/[6n]/[3x7x]	
Inhalt:	User-ID	10x
	Uhrzeit	/6n
	Geschäftsvorfallcode:	/3n
	021 Abmeldung akzeptiert	
	022 Abmeldung abgelehnt	
	023 automatische Abmeldung; Orderannahme wegen technischer Probleme nicht möglich	
	letzte OSN des 2. Nummernkreises (Ereignisse/Ausführungsbestätigungen)	/[6n]
	letzte OSN des 3. Nummernkreises (Schlussnoten, Bankdirektgeschäfte)	/[6n]
	Fehlercode:	/[3x7x]
	Feldetikett, Fehlerhinweis (siehe Abschnitt Fehlerhinweise)	

Hinweis:

Die letzte von der Deutsche Börse AG vergebene OSN für Orderrückmeldungen / Systemmeldungen (1. Nummernkreis) ist generell die OSN der Abmeldebestätigung.

Die letzten OSN des 2. bzw. 3. Nummernkreises sind nur bei der Abmeldungsbestätigung des letzten (falls mehrere LTERMs zulässig) Banken-Empfänger-LTERMs mit GV-Code = 021 oder 023 belegt.

Die Rückmeldung auf eine Abmeldung (MT002) wird jeweils über den LTERM versandt, auf dem die entsprechende Anfrage erfolgte (also auch über den Sende-LTERM).

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.1.5 Retrieval-Anforderung (MT 020)

Urheber: Benutzer (Bank)

Funktion (Bank): Anforderung von am gleichen Tage gesendeten Nachrichten ab einer bestimmten OSN (Output-Sequence-Number). Es werden, unabhängig von einer erfolgten Anmeldung, alle der Bank nach dem entsprechenden Benutzerprofile zustehenden Nachrichten auf einer Ausgangs-Datenbank zur Verfügung gestellt. Die Bank kann über diesen Nachrichtentyp alle aufgelaufenen Nachrichten anfordern (bei verspäteter Anmeldung, Systemausfall der Bank, etc.). Aufgrund dieser Anforderung werden nur Nachrichten gesendet, die bei der Anmeldung im Nachrichtenumfang vorgegeben wurden. Die Anzahl der Nachrichten eines übertragenen Nachrichtenblocks ist pro Anforderung auf 5000 Nachrichten begrenzt. Daher muss das Kreditinstitut gegebenenfalls weitere fehlende Nachrichten erneut anfordern.

Da die OSN für drei verschiedene Nummernkreise vergeben wird, muss pro Nummernkreis eine Retrieval-Anforderung erfolgen (d.h. bei Anforderung ab OSN = 17 werden keine Meldungen aus dem bei 300001 beginnenden Nummernkreis übermittelt).

Eine Anforderung der Nachrichten ist bis mindestens 30 Minuten nach Erstellung des Ereignisses BOEND (XONTRO-Ende Buchungsschnitt) und bis zum Online-Ende möglich.

Ist eine Bank bis zu diesem Zeitpunkt nicht in der Lage, die Nachrichten zu empfangen, so kann ein Datenträger mit den entsprechenden Informationen angefordert werden (File-Transfer Historische Nachrichten: siehe MT000/GV-Code = 016).

MT 020 Retrieval-Anforderung			
O / M	Block	Blockbezeichnung	Format
O	153:	Anfangs-OSN	<u>6</u> n
O	254:	Anfangs-Referenz / Ende-Referenz	<u>28c28c</u>

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Regel: Die Angabe eines der beschriebenen Blöcke ist Pflicht.

Block 153 (Anfangs-OSN)

Bei der Retrieval-Anforderung über Block 153 (Anfangs-OSN) werden von der angeforderten OSN beginnend alle zum Zeitpunkt der Anforderung vorliegenden Nachrichten übermittelt. Zwischen dem Eingang der Retrieval-Anforderung und dem Versenden des Nachrichtenblockes neu entstehende Nachrichten werden sofort übermittelt.

Block 254 (Anfangs-Referenz / Ende-Referenz)

Bei der Retrieval-Anforderung über Block 254 können Nachrichten für einen zusammenhängenden Bereich von OSN angefordert werden (von OSN, bis OSN).

Aufbau der Referenz:

Ausgabedatum	(JJMMTT)	<u>6n</u>
Empfänger-LT	(lt. Header)	<u>12c</u>
Sitzungs-Nr.	(lt. Header)	<u>4n</u>
OSN		<u>6n</u>

(Die Felder Ausgabedatum, Empfänger-LT, Sitzungs-Nr. werden vom Orderübermittlungssystem nicht geprüft).

Hinweis:

Die angeforderten Nachrichten werden jeweils über den LTERM versandt, auf dem die entsprechende Anfrage erfolgte (also auch über den Sende-LTERM).

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.1.6 Antwort auf Retrieval (MT 021)

Urheber:	Benutzer (Bank) und Systeme (XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE)
Bank:	Rückmeldung von fehlerhaften Übertragungen der Deutsche Börse AG
System:	(1) Beantwortung der Retrieval-Anforderung (2) Beginn-/Endemitteilung der Nachrichten-Übertragung

MT 021 Retrieval-Antwort			
O / M	Block	Blockbezeichnung	Format
0	---	Original-Header	
0	---	Originaltext	
0	421:	Fehlercode / Hinweiscode ANF - Beginn der Nachrichten-Übertragung END - Ende der Nachrichten-Übertragung alle Fehlerhinweise	<u>3c</u>

Regel: Die Retrieval-Anforderung (MT020) wird wie folgt behandelt:

Bei korrektem Aufbau der Nachricht (MT020) wird dem Kreditinstitut eine Bestätigung der Anforderung übermittelt (MT021).

Falls keine Nachrichten bzgl. der vorausgegangenen Anforderung (MT020) vorhanden sind, wird lediglich eine Bestätigung der Anforderung übermittelt (MT021 / Block 421:END).

Falls Nachrichten vorhanden sind, wird zunächst eine Bestätigung (MT021 / Block 421:ANF), danach die angeforderten Nachrichten (MT5xx) übermittelt. Den Abschluss der Nachrichtenübertragung bildet eine entsprechende Ende-Mitteilung (MT021 / Block 421:END).

Der gesamte Nachrichtenblock, sowie die Bestätigungen (MT021) werden über die gleiche LU (LTERM) gesendet, auf der die Anforderung (MT020) bei der Deutsche Börse AG eingetroffen ist.

Block 421: Bei der Rückmeldung von fehlerhaften Übertragungen durch das Kreditinstitut können alle definierten Fehlerhinweise verwendet werden.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2 Wertpapierbezogene Nachrichten

3.2.1 Kauforder / INVESTRO Kaufauftrag (MT 500)

Urheber: Benutzer (Bank) und Systeme (XONTRO, Xetra, INVESTRO, Vestima+ und MAX-ONE)

Bank: (1) Übermittlung von Kauforders

Bei Orderzugängen während einer laufenden Kursfeststellung in XONTRO, bei Marktausgleichsphase in Xetra bzw. bei Orderbuchsperrung in MAX-ONE (Zeitraum zwischen Preisfeststellung und Ausführung der Orders) erfolgt zunächst eine vorläufige Meldung (MT596). Der Zugang der Order wird im System vorgetragen und nach Entsperren des Orderbuchs, nach Ende der Marktausgleichsphase bzw. nach Orderbuchsperrung automatisch verarbeitet.

Die Bank erhält eine endgültige Meldung (MT596), in der die Orderannahme bzw. Ablehnung inkl. Uhrzeit der definitiven Annahme / Ablehnung mitgeteilt wird.

(2) Übermittlung von INVESTRO Kaufaufträgen. Bei Kaufaufträgen, die von INVESTRO an das Abwicklungssystem Vestima+ übertragen wurden, erhält die Bank zunächst eine vorläufige Meldung (MT596). Nach der Antwort aus Vestima+ erhält die Bank eine endgültige Meldung (MT596), in der die Auftragsannahme bzw. Ablehnung mitgeteilt wird.

XONTRO: (1) Übermittlung / Protokollierung der Kauforders, die über Terminal Eingaben von Bank und vom Makler in das System eingegeben wurden.

(2) Übermittlung aller noch ausführbaren und aller wegen Einstellung der Notierung in der Tagesendverarbeitung gestrichenen Kauforders zu Kontrollzwecken (Orderbestandsabgleich).
Diese Übermittlung erfolgt nur über File-Transfer.

(3) Übermittlung / Protokollierung der Kauforders eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank.

(4) Übermittlung aller noch ausführbaren und aller wegen Einstellung der Notierung in der Tagesendverarbeitung gestrichenen Kauforders eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank zu Kontrollzwecken (Orderbestandsabgleich).
Diese Übermittlung erfolgt nur über File-Transfer.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

- Xetra:
- (1) Übermittlung / Protokollierung aller Kauforders, die über eine VALUES basierte Frontend-Applikation (Notfall-Prozedere) eingegeben wurden. Hinweis: Die Anmeldung in der VALUES basierten Frontend-Applikation muss mit einer Orderrouting Trader-ID durchgeführt werden.
 - (2) Übermittlung / Protokollierung aller Kauforders, die „on behalf“ für den Händler (z.B. von der Market Supervision) eingegeben wurden.
- INVESTRO:
- (1) Übermittlung aller noch ausführbaren und aller wegen Einstellung der Notierung in der Tagesendverarbeitung gestrichenen INVESTRO Kaufaufträge zu Kontrollzwecken (Orderbestandsabgleich). Diese Übermittlung erfolgt nur über File-Transfer.
 - (2) Übermittlung / Protokollierung von INVESTRO Kaufaufträgen an die empfangende Bank. Kaufaufträge für Gattungen, die im System Vestima+ gehandelt werden, werden von INVESTRO an Vestima+ übertragen, falls nicht eine andere Depotbank als Empfänger eingegeben wurde.
 - (3) Übermittlung / Protokollierung von INVESTRO Kaufaufträgen, die über Terminal Eingaben durch die Bank in das System eingegeben wurden, an die auftraggebende Bank und die empfangende Bank.
- MAX-ONE:
- (1) Übermittlung / Protokollierung der Kauforders, die über Terminal Eingaben durch die Bank bzw. über eine Frontend-Applikation in das System eingegeben wurden.
 - (2) Übermittlung aller noch ausführbaren Kauforders zu Kontrollzwecken (Orderbestandsabgleich). Diese Übermittlung erfolgt nur über File-Transfer.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

MT 500 Kauforder			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
M	20:	Bankinterne Ordernummer, falls nicht vorhanden: /NONREF (bei Bank an System) DWZnnnnnnnnnnnn (bei System an Bank)	16x
O	23:	Geschäftsart: – Geschäftsvorfallcode – Geschäftsartergänzung R = Kauf zum Rücknahmepreis (nur INVESTRO) W = Kauf zur Wiederanlage (nur INVESTRO) – Automatische Lieferfreigabe J = Ja N = Nein D = Resend / possibly duplicate (nur Xetra) – KZ-Eigengeschäft – Netting Type / Netting Category	[3n][1a][b1a] [/2x][1a]
M	30:	Order gültig bis (JJMMTT)	6n
M	35A:	Art des Wertpapiers (Codewörter werden nicht geprüft) Stück oder Nennwert Peak-Size-Qty	3a10n,3n [/10n,3n]
M	35B:	1. Zeile: Internationale Kenn-Nr. 2. Zeile: Wertpapierkurzbezeichnung (wird nicht geprüft) Xetra an Bank: 3. Zeile: Versionsnummer (lastUpdateDat)	ISINb12c 35x [18n]
M	32L:	1. Zeile: Währung der Notierung (ISO-Code) Preis-/Kurslimit Discretionary Range mit Vorzeichen 2. Zeile: Börsenplatz Empfänger der Order (CBF-Konto-Nr.) Handelshinweis Limitzusatz exePrc-Stop-Order exec-Id	3a6n,4n[b1x8n,5n] /3x[4n][b2x][2a] [/16n,4n][5x]]
O	82D:	Order-/Auftragsaufgeber	/4n

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

MT 500 Kauforder (Fortsetzung 1)			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
O	83C:	CBF-Konto-Nr. der "wegen Bank" (Korrespondenzbank)	/4n
O	50:	Kennzeichnung des Handelssystems	3c
O	60:	RegulatoryID	10x
O	53C:	INVESTRO Vertriebspartner	/10n
O	71D:	Einzelheiten zu Gebühren Spesen wenn negativ: Konstante /N Provision Provisionsbetrag (PD) oder Provisionsatz (PM) oder Standardprovision (PS) wenn negativ: Konstante /N	[7n,2n[/N]] [2a7n,3n[/N]]
O	72:	1. Zeile: freier Text 2. Zeile: ID-KZ bei Terminaleingabe über System (nur bei System an Bank) 3. Zeile: Erstellungszeit der Nachricht (HHMMSSHS) (nur bei System an Bank)	[25x] [DWZ-USERb10x] [EIN-ZEITb8n]

Regeln:**Feld 20 (Bankinterne Ordernummer):**

Datentransfers vom System zum Kreditinstitut:

Feld F:20 wird mit der bankinternen Ordernummer belegt. In einem Folgesatz (MT596) wird die Ordernummer des Handelssystems in Feld F:20 geliefert, die Referenzierung erfolgt über Feld F:21 (bankinterne Ordernummer). Ist keine bankinterne Ordernummer vorhanden, so wird die Ordernummer des Handelssystems in Feld F:20 des MT500 eingestellt (mit Präfix 'DWZ'). In diesem Fall wird **kein** Folgesatz (MT596) geliefert. Die Nachricht an die Abwicklungsbank enthält immer die Ordernummer des Handelssystems (mit Präfix 'DWZ'). In diesem Fall wird **kein** Folgesatz (MT596) geliefert.

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 531/538) wird generell die DWZ-Auftragsnummer eingestellt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 23 (Geschäftsvorfallcode):

Im Folgenden ist aufgeführt, welche Geschäftsvorfallcodes von welchem System unterstützt werden:

Code	Bedeutung
Bank an System:	
121	XONTRO: Order gültig ab Folgetag MAX-ONE: Order gültig ab Folgetag
System an Bank:	
031	XONTRO: Orderzugang durch Bankterminal Xetra: Orderzugang durch VALUES basierte Frontend-Applikation INVESTRO: Auftragszugang durch Bankterminal MAX-ONE: Orderzugang durch Bankterminal oder Frontend-Applikation Bank
032	XONTRO: Orderzugang durch Makler MAX-ONE: Orderzugang durch Spezialist
033	XONTRO: Bestandsabgleich (ausführbare Orders) INVESTRO: Bestandsabgleich (ausführbare Aufträge) MAX-ONE: Bestandsabgleich (ausführbare Orders)
034	XONTRO: Orderzugang während Sperre durch Bankterminal MAX-ONE: Orderzugang während Preisauszeichnung durch Bankterminal oder Frontend-Applikation Bank Xetra: Orderzugang während Sperre durch VALUES basierte Frontend-Applikation INVESTRO/Vestima+: Auftragzugang an Vestima+ (vorläufig)
035	XONTRO: Orderzugang während Sperre durch Makler MAX-ONE: Orderzugang während Preisauszeichnung durch Frontend-Applikation Spezialist
036	XONTRO: Ablehnung eines über GV-Code = 034 bestätigten Orderzugangs nach Kursfeststellung Xetra: Ablehnung eines über GV-Code = 034 bestätigten Orderzugangs nach Preisfeststellung INVESTRO/Vestima+: Ablehnung eines über GV-Code = 034 bestätigten Auftragzugangs nach Vestima+
037	XONTRO: Ablehnung eines über GV-Code = 035 bestätigten Orderzugangs nach Kursfeststellung
038	XONTRO: Orderzugang durch Bankterminal gültig ab Folgetag (maschinell) INVESTRO: Auftragszugang durch Bankterminal gültig ab Folgetag (maschinell)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Code	Bedeutung
	MAX-ONE: Orderzugang durch Bankterminal oder Frontend-Applikation Bank gültig ab Folgetag (maschinell)
039	XONTRO: Orderzugang durch Makler gültig ab Folgetag (maschinell) MAX-ONE: Orderzugang durch Spezialist gültig ab Folgetag (maschinell)
040	XONTRO: Orderzugang durch Bankterminal gültig ab Folgetag (manuell) MAX-ONE: Orderzugang durch Bankterminal oder Frontend-Applikation Bank gültig ab Folgetag (manuell)
041	Xetra: Orderzugang einer Stop-Limit Order
042	Xetra: Orderzugang „on behalf“ (z.B. durch Market Supervision)
043	Xetra: Orderzugang einer Order mit Trading Restriction (außer EK, KS, SK)
044	Xetra: Orderzugang einer Iceberg Order
045	Xetra: Orderzugang einer Market-to-Limit Order
061	XONTRO: Zeichnungsauftrag eingestellt
062	XONTRO: Fondssegment, Gültigkeit angepasst.
063	XONTRO: Fondssegment, Gültigkeit angepasst. Gültig ab Folgetag.
233	XONTRO: Bestandsabgleich (in der Tagesendeverarbeitung gestrichene Orders wegen Einstellung der Notierung sowie Löschung nicht bestätigter EG-Orders)
333	XONTRO: Bestandsabgleich (ausführbare Orders eines Handelsteilnehmers) an die Abwicklungsbank
433	XONTRO: Bestandsabgleich (in der Tagesendeverarbeitung für den Handelsteilnehmer gestrichene Orders wegen Einstellung der Notierung sowie Löschung nicht bestätigter EG-Orders) an die Abwicklungsbank
531	INVESTRO: Auftragszugang / Nachricht für Empfänger
538	INVESTRO: Auftragszugang für Folgetag / Nachricht für Empfänger
631	XONTRO: Orderzugang eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank
638	XONTRO: Orderzugang eines Handelsteilnehmers für Folgetag (manuell / maschinell) an die Abwicklungsbank
662	XONTRO: Orderzugang eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank im Fondssegment, Gültigkeit angepasst.
663	XONTRO: Orderzugang eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank im Fondssegment, Gültigkeit angepasst. Gültig ab Folgetag.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 23 (Geschäftsvorfallcode = 121):

Wegen hausinterner Orderannahmeschlüsse bei Banken können Orders zum nächsten Börsentag aufgegeben werden. Diese Orders werden am Eingabetag nicht ausgeführt und bleiben auch von der Nebenrechtsverarbeitung unberücksichtigt. Die positive Bestätigung im MT596 erfolgt mit dem GV-Code 300 (Zugang fehlerfrei durchgeführt).

XONTRO: Folgetagorders mit Limitzusatz „EG“ (d.h. EG-Orders mit Gültigkeit ab Folgetag) sind nicht zulässig.

Xetra: Funktion nicht zulässig.

INVESTRO: Funktion nicht zulässig.

Feld 23 (Geschäftsvorfallcode = 041):

Xetra: Bei der Eingabe einer Stop-Limit Order über eine VALUES basierte Frontend-Applikation wird der GV-Code 041 an die Bank gesendet. Im Feld Preis-/Kurslimit (Feld F:32L, 1. Zeile) wird das Limit, bei dem die Order umgesetzt wird, geliefert.

Im Feld exePrc-Stop Order wird das Limit, auf das die Order umgesetzt wird, mitgeteilt.

Feld 23 (Geschäftsvorfallcode = 043):

Xetra: Bei der Eingabe von Orders mit Trading Restriction ungleich EK (= opening auction), KS (= auction only) oder SK (= closing auction) über eine VALUES basierte Frontend-Applikation wird der GV-Code 043 an die Bank gesendet. Das Feld Handelshinweis (F:32L, 2. Zeile) wird mit der Trading Restriction belegt.

Feld 23 (Geschäftsartergänzung):

INVESTRO / VESTIMA+: Aufträge für VESTIMA+ mit Geschäftsartergänzung werden von INVESTRO abgelehnt.

Feld 23 (automatische Lieferfreigabe):

XONTRO: Der Defaultwert aus den Profile-Angaben der Bank kann hier überschrieben werden. Das Feld wird z.Z. ignoriert.

Xetra: Die Belegung des Feldes mit "D" kennzeichnet eine Nachricht als erneute Übertragung einer bereits zuvor gesendeten Ordereinstellung. Die Orderdaten sind identisch mit der Originalnachricht (Resend-Funktionalität).

INVESTRO: Das Feld wird ignoriert.

MAX-ONE: Das Feld wird ignoriert.

Feld 23 (KZ-Eigengeschäft):

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Das Feld enthält in der ersten Stelle den acctTypCod und in der zweiten Stelle die acctTypNo.

Möglicher Wertebereich:

Ausprägung	Bedeutung	XONTRO	Xetra	MAX-ONE
A1	Agent	Ja	Ja	Ja
P1	Proprietary	Ja	Ja	Ja
M1	Betreuer	Nein	Ja	Nein
I1	Issuer	Nein	Ja	Nein
L1	Liquidity-Provider	Nein	Ja	Nein
Q1	Liquidity-Manager	Nein	Ja	Nein
E1	Best Executor	Nein	Ja	Nein

Dieses Feld dient der Trennung von Eigen- und Kundengeschäft. Defaultwert bei Nicht-eingabe ist „A1“.

Feld 23 (Netting Type / Netting Category):

Xetra: Es wird generell der im Xetra Member Setup definierte Netting Type herangezogen.

Feld 30 (Order gültig bis):

Xetra lehnt im Gegensatz zu XONTRO alle Verfallsdaten, die nicht den gültigen Handelsusancen entsprechen, ab.

INVESTRO: (Bank an System) Dieses Feld wird nicht geprüft. Da es ein Pflichtfeld ist, ist es mit einem gültigen Datum zu belegen.

(System an Bank) Das Feld wird mit der maximalen Gültigkeit (360 Tage) belegt.

Feld 35B / 2. Zeile (Wertpapierkurzbezeichnung):

Xetra: Falls die Wertpapierkurzbezeichnung bei einer Eingabe über eine VALUES basierte Frontend-Applikation nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „???“ an den Teilnehmer geliefert.

MAX-ONE: Falls die Wertpapierkurzbezeichnung bei einer Eingabe über Bankterminal oder Frontend-Applikation nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „???“ an den Teilnehmer geliefert.

Feld 35B / 3. Zeile (Versionsnummer lastUpdateDat):

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Xetra: Wenn eine Kauforder über eine VALUES basierte Frontend-Applikation erfasst wird, erhält der Teilnehmer einen Nachrichtensatz MT500. In diesem Fall transferiert Xetra die aktuelle Versionsnummer. Diese Versionsnummer sollte für zukünftige Ordermodifikationen verwendet werden.

Feld 32L / 1. Zeile (Währung der Notierung):

XONTRO:

(Bank an System) Das Feld muss einen gültigen Währungsschlüssel im ISO-Code enthalten. Weitere Prüfungen finden nicht statt.

(System an Bank) Das Feld wird mit der Währung der Notierung belegt.

Xetra: Die Währung wird von Xetra nicht geprüft.

INVESTRO:

(Bank an System) Die Währung wird von INVESTRO nicht geprüft.

(System an Bank) Das Feld wird mit der INVESTRO Abrechnungswährung belegt.

Feld 32L / 1. Zeile (Preis-/Kurslimit):

Bei unlimitierten Orders („billigst“ Orders) ist das Feld mit „0“ zu belegen.

Xetra: Bei der Eingabe einer Stop Order enthält dieses Feld das Limit, bei dem die Order umgesetzt wird.

INVESTRO: Das Feld ist mit „0“ zu belegen.

MAX-ONE: Bei der Eingabe einer Stop Order enthält dieses Feld das Limit, bei dem die Order umgesetzt wird.

Feld 32L / 1. Zeile (Discretionary Range):

Xetra: Beim Ordertyp „Discretionary Order“ die Spanne zwischen dem „sichtbaren“ und dem „discretionary“ (unsichtbaren) Limit.

Es gilt: Discretionary Limit = Limit + discretionary Range

Übrige Systeme: Das Feld wird ignoriert.

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

Feld 32L / 2. Zeile (Börsenplatz):

Börse, an der die Order auszuführen ist (lt. WM-Schlüssel GD621). Möglicher Wertebereich:

100 – Berlin	160 – Börse München
120 – Düsseldorf	170 – Stuttgart
130 – Frankfurt	183 – INVESTRO
140 – Hamburg	194 – Xetra Frankfurt
150 – Hannover	944 – Xetra Wien

Feld 32L / 2. Zeile (Empfänger der Order bzw. des Auftrags):

XONTRO: Angabe des empfangenden Maklers. Falls das Feld nicht eingegeben wurde, wird die Order dem skontroführenden Makler zugeteilt.

Xetra: Ein Eintrag in diesem Feld wird ignoriert.

INVESTRO: Angabe der empfangenden Bank. Falls das Feld nicht eingegeben wurde, wird der Auftrag der depotführenden Bank zugeteilt.

INVESTRO / VESTIMA+: Wird die Gattung im System Vestima+ gehandelt und wurde das Feld nicht eingegeben bzw. ist es mit der KV-Nummer von Vestima+ gefüllt, so wird der Auftrag an VESTIMA+ übertragen.

MAX-ONE: Angabe des Spezialisten. Falls das Feld nicht eingegeben wurde, wird die Order automatisch dem Spezialisten zugeteilt.

Feld 32L / 2. Zeile (exePrc-Stop-Order):

XONTRO: In XONTRO gibt es keine Stop-Limit Orders. Entsprechende Eingaben werden ignoriert.

Xetra: Bei der Eingabe einer Stop-Limit Order enthält dieses Feld das Limit, auf das die Order umgesetzt wird. Bei der Eingabe einer Stop-Market Order kann dieses Feld entfallen oder muss mit „0“ belegt werden.

INVESTRO: In INVESTRO werden Eingaben in diesem Feld ignoriert.

MAX-ONE: Bei der Eingabe einer Stop-Limit Order enthält dieses Feld das Limit, auf das die Order umgesetzt wird. Bei der Eingabe einer Stop-Market Order kann dieses Feld entfallen oder muss mit „0“ belegt werden.

Feld 32L / 2. Zeile (exec-Id):

Xetra: Member-ID des BEST Executors für Xetra BEST.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 32L / 2. Zeile (Handelshinweis):

Im Folgenden sind die einzelnen Ausprägungen des Handelshinweises in XONTRO und MAX-ONE aufgeführt.

Schlüssel	XONTRO	MAX-ONE
KS	Kassakurs	Kassakurs (single auction)
EK	Eröffnungskurs	Eröffnungskurs
	nicht belegt: gemäß Usancen	nicht belegt: gemäß MAX-ONE Marktmodell

In diesem Feld können auch alle Xetra Trading Restrictions verschlüsselt werden. Zu diesem Zweck können folgende Schlüssel genutzt werden. In diesem Fall findet eine Transformation in die korrespondierenden Xetra Trading Restrictions statt (siehe Tabelle).

Schlüssel	Xetra Trading restriction	Bemerkung
KS	AU	Auction only
EK	OA	Opening Auction
SK	CA	Closing Auction
SA	SA	Special Auction
		nicht belegt: gemäß Xetra Marktmodell

XONTRO: Bei Ordererfassung über Terminal wird bei Kassaorders generell „KS“ eingestellt.

Orders mit Handelshinweis „EK“ sind für den Börsenplatz Stuttgart nicht zugelassen.

Xetra: Xetra stellt Orders, bei denen das Feld Handelshinweis (Trading Restriction) keinen Eintrag enthält, mit der Default Trading Restriction gemäß Xetra Marktmodell für das betreffende Instrument ein.

Falls im Rahmen des Notfall-Prozedere (Eingabe einer Order über eine VALUES basierte Frontend-Applikation) eine Kauforder von Xetra an die Bank geschickt wird, erfolgt eine Transformation der Xetra Trading Restrictions AU, OA und CA in die oben aufgeführten Ausprägungen. Alle anderen Trading Restrictions werden nicht transformiert.

INVESTRO: In INVESTRO gibt es keine Handelshinweise. Entsprechende Eingaben werden ignoriert.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 32L / 2. Zeile (Limitzusatz):

Möglicher Wertebereich:

Ausprägung	Bedeutung	XONTRO	Xetra	MAX-ONE
SB	Stop Buy	Ja	Ja	Ja
SL	Stop Loss	Ja	Ja	Ja
EG	Ereignisgesteuerte Order	Ja	Nein	JA
FK	Fill-or-Kill	Nein	Ja	Nein
IC	Immediate-or-Cancel	Nein	Ja	Nein
ML	Market-to-Limit	Nein	Ja	Nein
IB	Iceberg	Nein	Ja	Nein
MP	Midpoint	Nein	Ja	Nein
MI	Midpoint Immediate-or-Cancel	Nein	Ja	Nein
MF	Midpoint Fill-or-Kill	Nein	Ja	Nein
DI	Discretionary Order	Nein	Ja	Nein
HI	Hidden Order	Nein	Ja	Nein

XONTRO: Wenn der Limitzusatz „EG“ geliefert wird, dann muss der freie Text (Etikett 72, 1. Zeile) regelkonform gefüllt sein (vgl. Etikett 72).

INVESTRO: In INVESTRO gibt es keinen Limitzusatz. Entsprechende Eingaben werden ignoriert.

Feld 82D (Orderaufgeber):

Falls das Feld nicht belegt ist, wird die CBF-Konto-Nr. des Orderaufgebers aus der S.W.I.F.T.- Adresse ermittelt. Für Banken mit zentraler Anbindung muss das Feld für Orders, die nicht an den Börsenplatz der Zentrale geroutet werden sollen, mitgeliefert werden.

Empfehlung: Das Feld sollte generell gepflegt werden (auch für Banken mit dezentraler Anbindung).

XONTRO: (System an Bank) Beim Datensatz an die Abwicklungsbank (GV-Code 631/638) wird die CBF-Konto-Nr. des Handelsteilnehmers hinterlegt.

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 531/538) wird die CBF-Konto-Nr. des Auftraggebers hinterlegt.

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

Feld 35A (Art des Wertpapiers):

Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen der Wertpapierart aufgeführt:

Wertpapierart	Bedeutung
SHS	Aktien
BON	Renten
BCE	Zertifikatsähnliche Renten
WTS	Warrants
CER	Zertifikate
FUN	Fonds
SUB	Nebenrechte
RTE	Genussrechte
UNT	Units
MSC	Sonstige

Im Unterfeld 'Art des Wertpapiers' wird generell die Art des Wertpapiers angegeben (durch ein entsprechendes Codewort).

Xetra: Falls die Art des Wertpapiers bei einer Eingabe über eine VALUES basierte Frontend-Applikation nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „MSC“ an den Teilnehmer geliefert.

MAX-ONE: Falls die Art des Wertpapiers bei einer Eingabe über Bankterminal oder Frontend-Applikation nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „MSC“ an den Teilnehmer geliefert.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 35A (Stück oder Nennwert):

Xetra: Bei der Eingabe einer FOK bzw. IOC Kauforder über eine VALUES basierte Front-end-Applikation (Notfall-Prozedere), die nicht oder nur teilweise ausgeführt wird, wird in diesem Feld die ursprüngliche Nominale geliefert. Der Anteil der Order, der nicht ausgeführt, sondern gelöscht wurde, wird als Teillöschung im Nachrichtentyp MT595 geliefert. Eine Beschreibung des Ablaufs bei Eingabe einer FOK / IOC Order findet sich im Nachrichtentyp MT596.

Feld 35A (Peak-Size-Qty):

Xetra: maximal im Orderbuch sichtbares Ordervolumen einer Iceberg Order bzw. die Mindestausführungsmenge einer Midpoint Order.

Feld 50 (Kennzeichnung des Handels- bzw. Abwicklungssystems):

Das Feld ist gefüllt bei Nachrichten *System an Bank*.

Bei Nachrichten *Bank an System* wird das Feld ignoriert.

Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen aufgeführt:

Feldinhalt	Bedeutung
XON	Xontro
MAX	MAX-ONE
INV	Investro
XET	Xetra Frankfurt
FF2	Xetra Frankfurt 2

Feld 60 (RegulatoryID):

XONTRO, MAX-ONE:

Bei Nachrichten *Bank an System* enthält das Feld die Nummer des Algorithmus, auf Basis dessen die Order eingestellt wurde. Das Feld ist kein Order-Attribut, sondern ein Identifier einer Order-Transaktion.

Gültig sind nur numerische Werte von 1 bis 4294967294.

Bei Nachrichten *System an Bank* wird das Feld nicht geliefert.

Investro: Das Feld wird ignoriert.

Xetra: Das Feld wird ignoriert.

Feld 53C (INVESTRO Vertriebspartner):

Die Vertriebspartnernummer ist ein Teil der Konditionspflege. Mit dieser Nummer können auch innerhalb einer Aufgebnummer (CBF-Konto-Nr.) unterschiedliche Bonifikationen hinterlegt werden. Die Konditionen werden von den Depotbanken gepflegt. Die Nummer des Vertriebspartners muss von den Aufgebern mit den Auftragsdaten gesendet werden.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 83C (CBF-Konto-Nr. der "wegen Bank"):

CBF-Konto-Nr. der Korrespondenzbank, in deren Auftrag die Order aufgegeben wird. Für Handelsteilnehmer gibt es diese Funktionalität nicht. Orders mit Eingaben hierzu werden abgelehnt.

Xetra: Diese Funktionalität (und die damit zusammenhängenden Felder Provision und Spesen: Feld F:71D) existiert in Xetra nicht. Orders mit Eingaben hierzu werden abgelehnt.

INVESTRO: In INVESTRO gibt es keine Korrespondenzbank. Entsprechende Eingaben werden ignoriert.

MAX-ONE: Diese Funktionalität (und die damit zusammenhängenden Felder Provision und Spesen: Feld F:71D) existiert in MAX-ONE nicht. Orders mit Eingaben hierzu werden abgelehnt.

Feld 71D (Einzelheiten zu Gebühren):

Nur bei Aufträgen einer Korrespondenzbank möglich (Feld F:83C muss belegt sein). Die Provision kann als Provisionsbetrag (in Währung der Notierung), als Provisionsatz (in Promille des Kurswertes) oder als Standardprovision eingegeben werden. Das 2a-Feld kennzeichnet die Art der Provision; des Weiteren sind die unterschiedlichen Definitionen zu beachten:

Provisionsbetrag (2a7n,2n):

z.B.: PD100,5 ^ Provision = 100,50
PD,0 ^ keine Provision

Provisionsatz (2a2n,3n):

z.B.: PM5,725 ^ Provision = 5,725 Promille des Kurswertes

Standardprovision (BOEGA)

z.B.: PS,0 oder
keine Eingabe des Provisionsfeldes

Für Handelsteilnehmer gibt es diese Funktionalität nicht. Orders mit Eingaben hierzu werden abgelehnt.

Xetra: vgl. Feld F:83C

INVESTRO: vgl. Feld F:83C

MAX-ONE: vgl. Feld F:83C

Feld 72 / 1. Zeile (freier Text):

XONTR0: (System an Bank) Beim Datensatz an die Abwicklungsbank (GV-Code 631/638) wird das Feld nicht belegt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

XONTRO: (Bank an System) Beim Limitzusatz „EG“ muss das Feld gemäß der Feldbeschreibung des unter www.xontro.de abrufbaren Dokumentes EG-Ordertypen der Börse Stuttgart AG belegt werden.

Xetra: Von den erlaubten 25 Zeichen werden von Xetra nur 12 Zeichen unterstützt. Längere Eingaben werden abgeschnitten.

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 531/538) wird das Feld nicht belegt.

Feld 72 / 2. Zeile (ID-KZ):

XONTRO: (System an Bank) Beim Datensatz an die Abwicklungsbank (GV-Code 631/638) wird das Feld nicht belegt.

Xetra: Das ID-KZ enthält die letzten sechs Stellen der Orderrouting Trader-ID.

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 531/538) wird das Feld nicht belegt.

Feld 72 / 3. Zeile (Erstellungszeit der Nachricht):

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 531/538) wird das Feld nicht belegt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.2 Verkauforder / INVESTRO Verkaufauftrag (MT 501)

- Urheber: Benutzer (Bank) und Systeme (XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE)
- Bank:
- (1) Übermittlung von Verkauforders
Bei Orderzugängen während einer laufenden Kursfeststellung in XONTRO, bei Marktausgleichsphase in Xetra bzw. Orderbuchsperrung in MAX-ONE (Zeitraum zwischen Preisfeststellung und Ausführung der Orders) erfolgt zunächst eine vorläufige Meldung (MT596). Der Zugang der Order wird im System vorgetragen und nach Entsperren des Orderbuchs, nach Ende der Marktausgleichsphase bzw. nach Orderbuchsperrung automatisch verarbeitet.
Die Bank erhält eine endgültige Meldung (MT596), in der die Orderannahme bzw. Ablehnung inkl. Uhrzeit der definitiven Annahme / Ablehnung mitgeteilt wird.
 - (2) Übermittlung von INVESTRO Verkaufaufträgen. Bei Verkaufaufträgen, die von INVESTRO an das Handelssystem Vestima+ übertragen wurden, erhält die Bank zunächst eine vorläufige Meldung (MT596). Nach der Antwort aus Vestima+ erhält die Bank eine endgültige Meldung (MT596), in der die Auftragsannahme bzw. Ablehnung mitgeteilt
- XONTRO:
- (1) Übermittlung / Protokollierung der Verkauforders, die über Terminal Eingaben von Bank und vom Makler in das System eingegeben wurden.
 - (2) Übermittlung aller noch ausführbaren und aller wegen Einstellung der Notierung in der Tagesendverarbeitung gestrichenen Verkauforders zu Kontrollzwecken (Orderbestandsabgleich).
Diese Übermittlung erfolgt nur über File-Transfer.
 - (3) Übermittlung / Protokollierung der Verkauforders eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank.
 - (4) Übermittlung aller noch ausführbaren und aller wegen Einstellung der Notierung in der Tagesendverarbeitung gestrichenen Verkauforders eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank zu Kontrollzwecken (Orderbestandsabgleich).
Diese Übermittlung erfolgt nur über File-Transfer.
- Xetra:
- (1) Übermittlung / Protokollierung aller Verkauforders, die über VALUES basierte Frontend-Applikationen (Notfall-Prozedere) eingegeben wurden.
Hinweis: Die Anmeldung in der VALUES basierten Frontend-Applikation muss mit einer Orderrouting Trader-ID durchgeführt werden.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

- (2) Übermittlung / Protokollierung aller Verkauforders, die „on behalf“ für den Händler (z.B. von der Market Supervision) eingegeben wurden.

INVESTRO:

- (1) Übermittlung aller noch ausführbaren und aller wegen Einstellung der Notierung in der Tagesendverarbeitung gestrichenen INVESTRO Verkaufsaufträge zu Kontrollzwecken (Orderbestandsabgleich).
Diese Übermittlung erfolgt nur über File-Transfer.
- (2) Übermittlung / Protokollierung von INVESTRO Verkaufsaufträgen an die empfangende Bank. Verkaufsaufträge für Gattungen, die im System Vestima+ gehandelt werden, werden von INVESTRO an Vestima+ übertragen, falls nicht eine andere Depotbank als Empfänger eingegeben wurde.
- (3) Übermittlung / Protokollierung von INVESTRO Verkaufsaufträgen, die über Terminal Eingaben durch die Bank in das System eingegeben wurden, an die auftraggebende Bank und die empfangende Bank.

MAX-ONE:

- (1) Übermittlung / Protokollierung der Verkauforders, die über Terminal Eingaben durch die Bank bzw. über eine Frontend-Applikation in das System eingegeben wurden.
- (2) Übermittlung aller noch ausführbaren Verkauforders zu Kontrollzwecken (Orderbestandsabgleich).
Diese Übermittlung erfolgt nur über File-Transfer.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

MT 501 Verkauforder			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
M	20:	Bankinterne Ordernummer, falls nicht vorhanden: /NONREF (bei Bank an System) DWZnnnnnnnnnnnn (bei System an Bank)	16x
O	23:	Geschäftsart: <ul style="list-style-type: none"> – Geschäftsvorfallcode – Automatische Lieferfreigabe J = Ja N = Nein D = Resend / possibly duplicate (nur Xetra) – Referenz-Nummer zum Verdichten von Serien (wird z.Z. ignoriert) – KZ-Eigengeschäft – Netting Type / Netting Category 	[3n][1a][3n] [2x][1a]
M	30:	Order gültig bis (JJMMTT)	6n
M	35A:	Art des Wertpapiers (Codewörter werden nicht geprüft) Stück oder Nennwert Peak-Size-Qty	3a10n,3n [10n,3n]
M	35B:	1. Zeile: Internationale Kenn-Nr. 2. Zeile: Wertpapierkurzbezeichnung (wird nicht geprüft) Xetra an Bank: 3. Zeile: Versionsnummer (lastUpdateDat)	ISINb12c 35x [18n]
M	32L:	1. Zeile: Währung der Notierung (ISO-Code) Preis-/Kurslimit Discretionary Range mit Vorzeichen 2. Zeile: Börsenplatz Empfänger der Order (CBF-Konto-Nr.) Handelshinweis Limitzusatz exePrc-Stop-Order exec-Id	3a6n,4n[b1x8n,5n] /3x[4n][b2x][2a] [16n,4n][5x]
O	82D:	Order-/Auftragsaufgeber	/4n
O	83C:	CBF-Konto-Nr. der "wegen Bank" (Korrespondenzbank)	/4n

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

MT 501 Verkauforder (Fortsetzung 1)			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
O	50:	Kennzeichnung des Handelssystems	<u>3</u> c
O	60:	RegulatoryID	10x
O	53C:	INVESTRO Vertriebspartner	/10n
O	71D:	Einzelheiten zu Gebühren Spesen wenn negativ: Konstante /N Provision Provisionsbetrag (PD) oder Provisionsatz (PM) oder Standardprovision (PS) wenn negativ: Konstante /N	[7n,2n[/N]] [/ <u>2</u> a7n,3n[/N]]
O	72:	1. Zeile: freier Text 2. Zeile: ID-KZ bei Terminaleingabe über Börsen-System (nur bei System an Bank) 3. Zeile: Erstellungszeit der Nachricht (HHMMSSHS) (nur bei System an Bank)	[25x] [<u>DWZ-USER</u> b10x] [<u>EIN-ZEIT</u> b8n]

Regeln:**Feld 20 (Bankinterne Ordernummer):**

Datentransfers vom System zum Kreditinstitut:

Feld F:20 wird mit der bankinternen Ordernummer belegt. In einem Folgesatz (MT596) wird die Ordernummer des Handelssystems in Feld F:20 geliefert, die Referenzierung erfolgt über Feld F:21 (bankinterne Ordernummer). Ist keine bankinterne Ordernummer vorhanden, so wird die Ordernummer des Handelssystems in Feld F:20 des MT501 eingestellt (mit Präfix 'DWZ'). In diesem Fall wird **kein** Folgesatz (MT596) geliefert. Die Nachricht an die Abwicklungsbank enthält immer die Ordernummer des Handelssystems (mit Präfix 'DWZ'). In diesem Fall wird **kein** Folgesatz (MT596) geliefert.

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 531/538) wird generell die DWZ-Auftragsnummer eingestellt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 23 (Geschäftsvorfallcode):

Im Folgenden ist aufgeführt, welche Geschäftsvorfallcodes von welchem System unterstützt werden:

Code	Bedeutung
Bank an System:	
121	XONTRO: Order gültig ab Folgetag MAX-ONE: Order gültig ab Folgetag
System an Bank:	
031	XONTRO: Orderzugang durch Bankterminal Xetra: Orderzugang durch VALUES basierte Frontend-Applikation INVESTRO: Auftragszugang durch Bankterminal MAX-ONE: Orderzugang durch Bankterminal oder Frontend-Applikation Bank
032	XONTRO: Orderzugang durch Makler MAX-ONE: Orderzugang durch Spezialist
033	XONTRO: Bestandsabgleich (ausführbare Orders) INVESTRO: Bestandsabgleich (ausführbare Aufträge) MAX-ONE: Bestandsabgleich (ausführbare Orders)
034	XONTRO: Orderzugang während Sperre durch Bankterminal MAX-ONE: Orderzugang während Preisauszeichnung durch Bankterminal oder Frontend-Applikation Bank Xetra: Orderzugang während Sperre durch VALUES basierte Frontend-Applikation INVESTRO/Vestima+: Auftragzugang an Vestima+ (vorläufig)
035	XONTRO: Orderzugang während Sperre durch Makler MAX-ONE: Orderzugang während Preisauszeichnung durch Frontend-Applikation Spezialist
036	XONTRO: Ablehnung eines über GV-Code = 034 bestätigten Orderzugangs nach Kursfeststellung Xetra: Ablehnung eines über GV-Code = 034 bestätigten Orderzugangs nach Preisfeststellung INVESTRO/Vestima+: Ablehnung eines über GV-Code = 034 bestätigten Auftragzugangs nach Vestima+
037	XONTRO: Ablehnung eines über GV-Code = 035 bestätigten Orderzugangs nach Kursfeststellung

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Code	Bedeutung
038	XONTRO: Orderzugang durch Bankterminal gültig ab Folgetag (maschinell) INVESTRO: Auftragszugang durch Bankterminal gültig ab Folgetag (maschinell) MAX-ONE: Orderzugang durch Bankterminal oder Frontend-Applikation Bank gültig ab Folgetag (maschinell)
039	XONTRO: Orderzugang durch Makler gültig ab Folgetag (maschinell) MAX-ONE: Orderzugang durch Spezialist gültig ab Folgetag (maschinell)
040	XONTRO: Orderzugang durch Bankterminal gültig ab Folgetag (manuell) MAX-ONE: Orderzugang durch Bankterminal oder Frontend-Applikation Bank gültig ab Folgetag (manuell)
041	Xetra: Orderzugang einer Stop-Limit Order
042	Xetra: Orderzugang „on behalf“ (z.B. durch Market Supervision)
043	Xetra: Orderzugang einer Order mit Trading Restriction (außer EK, KS, SK)
044	Xetra: Orderzugang einer Iceberg Order
045	Xetra: Orderzugang einer Market-to-Limit Order
061	XONTRO: Zeichnungsauftrag eingestellt
062	XONTRO: Fondssegment, Gültigkeit angepasst.
063	XONTRO: Fondssegment, Gültigkeit angepasst. Gültig ab Folgetag.
233	XONTRO: Bestandsabgleich (in der Tagesendeverarbeitung gestrichene Orders wegen Einstellung der Notierung sowie Löschung nicht bestätigter EG-Orders)
333	XONTRO: Bestandsabgleich (ausführbare Orders eines Handelsteilnehmers) an die Abwicklungsbank
433	XONTRO: Bestandsabgleich (in der Tagesendeverarbeitung für den Handelsteilnehmer gestrichene Orders wegen Einstellung der Notierung sowie Löschung nicht bestätigter EG-Orders) an die Abwicklungsbank
531	INVESTRO: Auftragszugang / Nachricht für Empfänger
538	INVESTRO: Auftragszugang für Folgetag / Nachricht für Empfänger
631	XONTRO: Orderzugang eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank
638	XONTRO: Orderzugang eines Handelsteilnehmers für Folgetag (manuell / maschinell) an die Abwicklungsbank
662	XONTRO: Orderzugang eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank im Fondssegment, Gültigkeit angepasst.
663	XONTRO: Orderzugang eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank im Fondssegment, Gültigkeit angepasst. Gültig ab Folgetag.

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

Feld 23 (Geschäftsvorfallcode = 121):

Wegen hausinterner Orderannahmeschlüsse bei Banken können Orders zum nächsten Börsentag aufgegeben werden. Diese Orders werden am Eingabetag nicht ausgeführt und bleiben auch von der Nebenrechtsverarbeitung unberücksichtigt. Die positive Bestätigung im MT596 erfolgt mit dem GV-Code 300 (Zugang fehlerfrei durchgeführt).

XONTRO: Folgetagorders mit Limitzusatz „EG“ (d.h. EG-Orders mit Gültigkeit ab Folgetag) sind nicht zulässig.

INVESTRO: Funktion nicht zulässig

Xetra: Funktion nicht zulässig.

Feld 23 (Geschäftsvorfallcode = 041):

Xetra: Bei der Eingabe einer Stop-Limit Order über eine VALUES basierte Frontend-Applikation wird der GV-Code 041 an die Bank gesendet. Im Feld Preis-/Kurslimit (Feld F:32L, 1. Zeile) wird das Limit, bei dem die Order umgesetzt wird, geliefert.

Im Feld exePrc-Stop-Order (Feld F:32L, 2. Zeile) wird das Limit, auf das die Order umgesetzt wird, mitgeteilt.

Feld 23 (Geschäftsvorfallcode = 043):

Xetra: Bei der Eingabe von Orders mit Trading Restriction ungleich EK (= opening auction), KS (= auction only) oder SK (= closing auction) über eine VALUES basierte Frontend-Applikation wird der GV-Code 043 an die Bank gesendet. Das Feld Handelshinweis (F:32L, 2. Zeile) wird mit der Trading Restriction belegt.

Feld 23 (automatische Lieferfreigabe):

XONTRO: Der Defaultwert aus den Profile-Angaben der Bank kann hier überschrieben werden. Das Feld wird z.Z. ignoriert.

Xetra: Die Belegung des Feldes mit "D" kennzeichnet eine Nachricht als erneute Übertragung einer bereits zuvor gesendeten Ordereinstellung. Die Orderdaten sind identisch mit der Originalnachricht (Resend-Funktionalität).

INVESTRO: Das Feld wird ignoriert.

MAX-ONE: Das Feld wird ignoriert.

Feld 23 (Referenz-Nummer):

XONTRO: Die Angabe dieses Feldes ist nur bei Seriennummern möglich; Orders über Seriennummern mit gleicher Stammgattung und gleicher Referenz-Nummer werden dem Makler verdichtet eingestellt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 23 (KZ-Eigengeschäft):

Das Feld enthält in der ersten Stelle den acctTypCod und in der zweiten Stelle die acctTypNo.

Möglicher Wertebereich:

Ausprägung	Bedeutung	XONTRO	Xetra	MAX-ONE
A1	Agent	Ja	Ja	Ja
P1	Proprietary	Ja	Ja	Ja
M1	Betreuer	Nein	Ja	Nein
I1	Issuer	Nein	Ja	Nein
L1	Liquidity-Provider	Nein	Ja	Nein
Q1	Liquidity-Manager	Nein	Ja	Nein
E1	Best Executor	Nein	Ja	Nein

Dieses Feld dient der Trennung von Eigen- und Kundengeschäft. Defaultwert bei Nicht-eingabe ist „A1“.

Feld 23 (Netting Type / Netting Category):

Xetra: Es wird generell der im Xetra Member Setup definierte Netting Type herangezogen.

Feld 30 (Order gültig bis):

Xetra lehnt im Gegensatz zu XONTRO alle Verfallsdaten, die nicht den gültigen Handelsusancen entsprechen, ab.

INVESTRO: (Bank an System) Dieses Feld wird nicht geprüft. Da es ein Pflichtfeld ist, ist es mit einem gültigen Datum zu belegen.

(System an Bank) Das Feld wird mit der maximalen Gültigkeit (360 Tage) belegt.

Feld 35B / 2. Zeile (Wertpapierkurzbezeichnung):

Xetra: Falls die Wertpapierkurzbezeichnung bei einer Eingabe über eine VALUES basierte Frontend-Applikation nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „???“ an den Teilnehmer geliefert.

MAX-ONE: Falls die Wertpapierkurzbezeichnung bei einer Eingabe über Bankterminal oder Frontend-Applikation nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „???“ an den Teilnehmer geliefert.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 35B / 3. Zeile: (Versionsnummer lastUpdateDat):

Xetra: Wenn eine Verkauforder über eine VALUES basierte Frontend-Applikation erfasst wird, erhält der Teilnehmer einen Nachrichtensatz vom Typ MT501. In diesem Fall transferiert Xetra die aktuelle Versionsnummer. Diese Versionsnummer sollte für zukünftige Ordermodifikationen verwendet werden.

Feld 32L / 1. Zeile (Währung der Notierung):

XONTRO:

(Bank an System) Das Feld muss einen gültigen Währungsschlüssel im ISO-Code enthalten. Weitere Prüfungen finden nicht statt.

(System an Bank) Das Feld wird mit der Währung der Notierung belegt.

Xetra: Die Währung wird von Xetra nicht geprüft.

INVESTRO:

(Bank an System) Die Währung wird von INVESTRO nicht geprüft.

(System an Bank) Das Feld wird mit der INVESTRO Abrechnungswährung belegt.

Feld 32L / 1. Zeile (Preis-/Kurslimit):

Bei unlimitierten Orders („bestens“ Orders) ist das Feld mit „0“ zu belegen.

Xetra: Bei der Eingabe einer Stop Order enthält dieses Feld das Limit, bei dem die Order umgesetzt wird.

INVESTRO: Das Feld ist mit „0“ zu belegen.

MAX-ONE: Bei der Eingabe einer Stop Order enthält dieses Feld das Limit, bei dem die Order umgesetzt wird.

Feld 32L / 1. Zeile (Discretionary Range):

Xetra: Beim Ordertyp „Discretionary Order“ die Spanne zwischen dem „sichtbaren“ und dem „discretionary“ (unsichtbaren) Limit.

Es gilt: Discretionary Limit = Limit - discretionary Range

Übrige Systeme: Das Feld wird ignoriert

Feld 32L / 2. Zeile (Börsenplatz):

Börse, an der die Order auszuführen ist (lt. WM-Schlüssel GD621). Möglicher Wertebereich:

100 – Berlin	160 – Börse München
120 – Düsseldorf	170 – Stuttgart
130 – Frankfurt	183 – INVESTRO
140 – Hamburg	194 – Xetra Frankfurt
150 – Hannover	944 – Xetra Wien

Feld 32L / 2. Zeile (Empfänger der Order):

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

XONTRO: Falls das Feld nicht angegeben ist, wird die Order dem skontroführenden Makler zugeteilt.

Xetra: Ein Eintrag in diesem Feld wird ignoriert.

INVESTRO: Angabe der empfangenden Bank. Falls das Feld nicht eingegeben wurde, wird der Auftrag der depotführenden Bank zugeteilt.

INVESTRO / VESTIMA+: Wird die Gattung im System Vestima+ gehandelt und wurde das Feld nicht eingegeben bzw. ist es mit der KV-Nummer von Vestima+ gefüllt, so wird der Auftrag an VESTIMA+ übertragen.

MAX-ONE: Angabe des Spezialisten. Falls das Feld nicht eingegeben wurde, wird die Order automatisch dem Spezialisten zugeordnet.

Feld 32L / 2. Zeile (exePrc-Stop-Order):

XONTRO: In XONTRO gibt es keine Stop-Limit Orders. Entsprechende Eingaben werden ignoriert.

Xetra: Bei der Eingabe einer Stop-Limit Order enthält dieses Feld das Limit, auf das die Order umgesetzt wird. Bei der Eingabe einer Stop-Market Order kann dieses Feld entfallen oder mit ‚0‘ belegt werden.

INVESTRO: In INVESTRO gibt es keine Stop-Limit Orders. Entsprechende Eingaben werden ignoriert.

MAX-ONE: Bei der Eingabe einer Stop-Limit Order enthält dieses Feld das Limit, auf das die Order umgesetzt wird. Bei der Eingabe einer Stop-Market Order kann dieses Feld entfallen oder mit ‚0‘ belegt werden.

Feld 32L / 2. Zeile (exec-Id):

Xetra: Member-ID des BEST Executors für Xetra BEST.

Feld 32L / 2. Zeile (Handelshinweis):

Im Folgenden sind die einzelnen Ausprägungen des Handelshinweises in XONTRO und MAX-ONE aufgeführt.

Schlüssel	XONTRO	MAX-ONE
KS	Kassakurs	Kassakurs (single auction)
EK	Eröffnungskurs	Eröffnungskurs
	nicht belegt: gemäß Usancen	nicht belegt: gemäß MAX-ONE Marktmodell

In diesem Feld können auch alle Xetra Trading Restrictions verschlüsselt werden. Zu diesem Zweck können folgende Ausprägungen genutzt werden. In diesem Fall findet eine Transformation in die korrespondierenden Xetra Trading Restrictions statt (s. Tabelle).

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Schlüssel	Xetra Trading restriction	Bemerkung
KS	AU	Auction only
EK	OA	Opening Auction
SK	CA	Closing Auction
SA	SA	Special Auction
		nicht belegt: gemäß Xetra Marktmodell

XONTRO: Bei Ordererfassung über Terminal wird bei Kassaorders generell „KS“ eingestellt.

Orders mit Handelshinweis „EK“ sind für den Börsenplatz Stuttgart nicht zugelassen.

Xetra: Xetra stellt Orders, bei denen das Feld Handelshinweis (Trading Restriction) keinen Eintrag enthält, mit der Default Trading Restriction gemäß Xetra Marktmodell für das betreffende Instrument ein.

Falls im Rahmen des Notfall-Prozedere (Eingabe einer Order über eine VALUES basierte Frontend-Applikation) eine Verkauforder von Xetra an die Bank geschickt wird, erfolgt eine Transformation der Xetra Trading Restrictions AU, OA und CA in die oben aufgeführten Ausprägungen. Alle anderen Trading Restrictions werden nicht transformiert.

INVESTRO: In INVESTRO gibt es keine Handelshinweise. Entsprechende Eingaben werden ignoriert.

Feld 32L / 2. Zeile (Limitzusatz):

Möglicher Wertebereich:

Ausprägung	Bedeutung	XONTRO	Xetra	MAX-ONE
SB	Stop Buy	Ja	Ja	Ja
SL	Stop Loss	Ja	Ja	Ja
EG	Ereignisgesteuerte Order	Ja	Nein	JA
FK	Fill-or-Kill	Nein	Ja	Nein
IC	Immediate-or-Cancel	Nein	Ja	Nein
ML	Market-to-Limit	Nein	Ja	Nein
IB	Iceberg	Nein	Ja	Nein
MP	Midpoint	Nein	Ja	Nein
MI	Midpoint Immediate-or-Cancel	Nein	Ja	Nein

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

MF	Midpoint Fill-or-Kill	Nein	Ja	Nein
DI	Discretionary Order	Nein	Ja	Nein
HI	Hidden Order	Nein	Ja	Nein

XONTRO: Wenn der Limitzusatz „EG“ geliefert wird, dann muss der freie Text (Etikett 72, 1.Zeile) regelkonform gefüllt sein (vgl. Etikett 72).

INVESTRO: In INVESTRO gibt es keinen Limitzusatz. Entsprechende Eingaben werden ignoriert.

Feld 82D (Orderaufgeber):

Falls das Feld nicht belegt ist, wird die CBF-Konto-Nr. des Orderaufgebers aus der S.W.I.F.T.- Adresse ermittelt. Für Banken mit zentraler Anbindung muss das Feld für Orders, die nicht an den Börsenplatz der Zentrale geroutet werden sollen, mitgeliefert werden.

Empfehlung: Das Feld sollte generell gepflegt werden (auch für Banken mit dezentraler Anbindung).

XONTRO: (System an Bank) Beim Datensatz an die Abwicklungsbank (GV-Code 631/638) wird die CBF-Konto-Nr. des Handelsteilnehmers hinterlegt.

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 531/538) wird die CBF-Konto-Nr. des Auftraggebers hinterlegt.

Feld 35A (Art des Wertpapiers):

Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen der Wertpapierart aufgeführt:

Wertpapierart	Bedeutung
SHS	Aktien
BON	Renten
BCE	Zertifikatsähnliche Renten
WTS	Warrants
CER	Zertifikate
FUN	Fonds
SUB	Nebenrechte
RTE	Genussrechte
UNT	Units
MSC	Sonstige

Im Unterfeld 'Art des Wertpapiers' wird generell die Art des Wertpapiers angegeben (durch entsprechendes Codewort).

Xetra: Falls die Art des Wertpapiers bei einer Eingabe über eine VALUES basierte Front-end-Applikation nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „MSC“ an den Teilnehmer geliefert.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

MAX-ONE: Falls die Art des Wertpapiers bei einer Eingabe über Bankterminal oder Frontend-Applikation nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „MSC“ an den Teilnehmer geliefert.

Feld 35A (Stück oder Nennwert):

Xetra: Bei der Eingabe einer FOK bzw. IOC Verkauforder über eine VALUES basierte Frontend-Applikation (im Rahmen des Notfall-Prozedere), die nicht oder nur teilweise ausgeführt wird, wird in diesem Feld die ursprüngliche Nominale geliefert. Der Anteil der Order, der nicht ausgeführt, sondern gelöscht wurde, wird als Teillöschung im Nachrichtentyp MT595 geliefert. Eine Beschreibung des Ablaufs bei Eingabe einer FOK / IOC Order findet sich im Nachrichtentyp MT596.

Feld 35A (Peak-Size-Qty):

Xetra: maximal im Orderbuch sichtbares Ordervolumen einer Iceberg Order bzw. die Mindestausführungsmenge einer Midpoint Order.

Feld 50 (Kennzeichnung des Handelssystems):

Das Feld ist gefüllt bei Nachrichten *System an Bank*.
Bei Nachrichten *Bank an System* wird das Feld ignoriert.

Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen aufgeführt:

Feldinhalt	Bedeutung
XON	Xontro
MAX	MAX-ONE
INV	Investro
XET	Xetra Frankfurt
FF2	Xetra Frankfurt 2

Feld 60 (RegulatoryID):

XONTRO, MAX-ONE:

Bei Nachrichten *Bank an System* enthält das Feld die Nummer des Algorithmus, auf Basis dessen die Order eingestellt wurde. Das Feld ist kein Order-Attribut, sondern ein Identifier einer Order-Transaktion.

Gültig sind nur numerische Werte von 1 bis 4294967294.

Bei Nachrichten *System an Bank* wird das Feld nicht geliefert.

Investro: Das Feld wird ignoriert.

Xetra: Das Feld wird ignoriert.

Feld 53C (INVESTRO Vertriebspartner):

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Die Vertriebspartnernummer ist ein Teil der Konditionspflege. Mit dieser Nummer können auch innerhalb einer Aufgebnummer (CBF-Konto-Nr.) unterschiedliche Bonifikationen hinterlegt werden. Die Konditionen werden von den Depotbanken gepflegt. Die Nummer des Vertriebspartners muss von den Aufgebern mit den Auftragsdaten gesendet werden.

Feld 83C (CBF-Konto-Nr. der "wegen Bank"):

CBF-Konto-Nr. der Korrespondenzbank, in deren Auftrag die Order aufgegeben wird. Für Handelsteilnehmer gibt es diese Funktionalität nicht. Orders mit Eingaben hierzu werden abgelehnt.

Xetra: Diese Funktionalität (und die damit zusammenhängenden Felder Provision und Spesen: Feld F:71D) existiert in Xetra nicht. Orders mit Eingaben hierzu werden abgelehnt.

INVESTRO: In INVESTRO gibt es keine Korrespondenzbank. Entsprechende Eingaben werden ignoriert.

MAX-ONE: Diese Funktionalität (und die damit zusammenhängenden Felder Provision und Spesen: Feld F:71D) existiert in MAX-ONE nicht. Orders mit Eingaben hierzu werden abgelehnt.

Feld 71D (Einzelheiten zu Gebühren):

Nur bei Aufträgen einer Korrespondenzbank möglich (Feld F:83C muss belegt sein). Die Provision kann als Provisionsbetrag (in Währung der Notierung), als Provisionssatz (in Promille des Kurswertes) oder als Standardprovision eingegeben werden. Das 2a-Feld kennzeichnet die Art der Provision; des Weiteren sind die unterschiedlichen Definitionen zu beachten:

Provisionsbetrag (2a7n,2n):

z.B.: PD100,5 → Provision = 100,50
PD,0 → keine Provision

Provisionssatz (2a2n,3n):

z.B.: PM5,725 → Provision = 5,725 Promille des Kurswertes

Standardprovision (BOEGA)

z.B.: PS,0 oder
keine Eingabe des Provisionsfeldes

Für Handelsteilnehmer gibt es diese Funktionalität nicht. Orders mit Eingaben hierzu werden abgelehnt.

Xetra: vgl. Feld F:83C

INVESTRO: vgl. Feld F:83C

MAX-ONE: vgl. Feld F:83C

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 72 / 1. Zeile (freier Text):

XONTRO: (System an Bank) Beim Datensatz an die Abwicklungsbank (GV-Code 631/638) wird das Feld nicht belegt.

XONTRO: (Bank an System) Beim Limitzusatz „EG“ muss das Feld gemäß der Feldbeschreibung des unter www.xontro.de abrufbaren Dokumentes EG-Ordertypen der Börse Stuttgart AG belegt werden.

Xetra: Von den erlaubten 25 Zeichen werden von Xetra nur 12 Zeichen unterstützt. Längere Eingaben werden abgeschnitten.

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 531/538) wird das Feld nicht belegt.

Feld 72 / 2. Zeile (ID-KZ):

XONTRO: (System an Bank) Beim Datensatz an die Abwicklungsbank (GV-Code 631/638) wird das Feld nicht belegt.

Xetra: Das ID-KZ enthält die letzten sechs Stellen der Orderrouting Trader-ID.

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 531/538) wird das Feld nicht belegt.

Feld 72 / 2. Zeile (Erstellungszeit der Nachricht):

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 531/538) wird das Feld nicht belegt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.3 Bankdirektgeschäft (MT 511)

Urheber: Benutzer (Bank)

Bank: Übermittlung von Bankdirektgeschäften (Platz und PÜEV)

Für die Eingabe von Bankdirektgeschäften muss sich die Bank in ihrem Benutzerprofil durch die BrainTrade GmbH freischalten lassen.

Die Eingabe eines Bankdirektgeschäfts wird sofort an XONTRO Trade weitergeleitet.

Die Bank erhält eine Bestätigung (MT596), in der die Annahme bzw. die Ablehnung des Bankdirektgeschäfts mitgeteilt wird.

Falls für den Teilnehmer sowohl die Übermittlung (Eingabe) von Bankdirektgeschäften als auch die realtime Übermittlung (Ausgabe) der Schlussnoten (MT512) eingerichtet wurde, erhält der Teilnehmer nach der erfolgreichen Einstellung eines MT511 auch eine Schlussnote im MT512-Format.

Die Stornierung sowie die Durchlieferung von Bankdirektgeschäften ist über die Systemschnittstelle mittels MT595 möglich.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

MT 511 Direktgeschäft			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
O	20:	Bankinterne OTC-Nummer	<u>13</u> x
M	23:	Satzart (Geschäftsart) Kennzeichen Börslich: BS börslich	<u>3n</u> / <u>2x</u>]
M	31P:	Börsenplatz Abschlussdatum (JJMMTT) Abschlussuhrzeit (HHMMSS) (Abweichender) Schlusstag (JJMMTT) Kennzeichen Festvaluta FZ Valuta Zug-um-Zug Datum Festvaluta Kennzeichen Emissionsgeschäft EM Emissionsgeschäft Zinstage mit Vorzeichen Diskonttage	<u>3x</u> / <u>6n</u> / <u>6n</u> / <u>6n</u> [/ <u>2a6n</u>][<u>2a</u>][<u>1x3n</u>] [<u>3n</u>]
M	35A:	Art des Wertpapiers (wird nicht geprüft) Nominale	<u>3a10n</u> , <u>3n</u>
M	35B:	Wertpapierkennnummer	<u>ISINb12c</u>
M	33T:	Währung der Notierung (wird nicht geprüft) Kurs	<u>3a6n</u> , <u>4n</u>
M	82D:	Eingeber des Geschäfts Kontrahent	<u>4n</u> / <u>4n</u>
O	71B:	Wiederanlagerabatt (Betrag) Bonifikationssatz in Prozent wenn negativ: Konstante /N	[<u>7n</u> , <u>2n</u>]/[<u>2n</u> , <u>3n</u> [/N]]
O	71C:	Courtage wenn negativ: Konstante /N Kennzeichen Courtage AC abweichende Courtage FC Franco Courtage FR Franco Courtage, Spesen und Provision HC Halbe Courtage	[<u>7n</u> , <u>2n</u> [/N]}/[<u>2x</u>]]
O	71D:	Einzelheiten zu Gebühren: Spesen wenn negativ: Konstante /N Provision Kennzeichen Provision: PD: Provisionsbetrag PM: Prozentsatz wenn negativ: Konstante /N	[<u>7n</u> , <u>2n</u> [/N]] [/ <u>2a7n</u> , <u>3n</u> [/N]]

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

MT 511 Direktgeschäft			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
0	72:	freier Text	30x
0	36:	Devisenkurs	7n,11n

Feld 20 (Bankinterne OTC-Nummer):

Das Kreditinstitut kann bei Bedarf eine bankinterne OTC-Nummer vergeben. Diese wird in der Bestätigung und in der Schlussnote zurückgeliefert.

Feld 23 (Satzart):

Möglicher Wertebereich:

012 Kauf – Direktgeschäft
022 Verkauf – Direktgeschäft

Die Satzart definiert die Rolle des Kontrahenten. Die Satzart 012 ist zu verwenden, wenn der Kontrahent Käufer ist, die Satzart 022 ist zu verwenden, wenn der Kontrahent Verkäufer ist.

Feld 23 (Kennzeichen börslich):

Kennzeichen, ob es sich um ein börsliches Geschäft handelt.

Möglicher Wertebereich:

BS – börslich

Default bei Nichteingabe ist 'außerbörslich'.

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

Feld 31P (Börsenplatz):

Börse, an der das Geschäft gehandelt wird. Das Feld muss dem Börsenplatz des Eingebers (Feld 82D) entsprechen.

Möglicher Wertebereich:

100 – Berlin	150 – Hannover
120 – Düsseldorf	160 – Börse München
130 – Frankfurt	170 – Stuttgart
140 – Hamburg	

Feld 31P (Abschlussdatum):

Das Feld enthält das Datum des Abschlusses des Geschäfts im Format JJMMTT.

Feld 31P (Abschlussuhrzeit):

Das Feld muss bei meldepflichtigen Wertpapieren die Uhrzeit des Abschlusses des Geschäfts im Format HHMMSS enthalten.

Feld 31P ((Abweichender) Schlusstag):

Das Feld enthält den (abweichenden) Schlusstag des Geschäfts im Format JJMMTT. Ist das Feld nicht belegt, wird das Geschäft mit dem Datum des aktuellen Börsentags abgeschlossen.

Feld 31P (Kennzeichen Festvaluta):

Das Feld enthält das Kennzeichen für die Wertstellung des Geschäfts. Im Folgenden ist die gültige Ausprägung des Feldes aufgeführt:

Kennzeichen	Bedeutung
FZ	Valuta Zug-um-Zug

Feld 31P (Datum Festvaluta):

Das Feld enthält die Angabe des Valutadatum des Geschäfts. Das Feld ist bei Angabe des 'Kennzeichen Festvaluta' Mussfeld.

Feld 31P (Kennzeichen Emissionsgeschäft):

Kennzeichen, dass es sich bei dem Geschäft um ein Emissionsgeschäft handelt.

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

Feld 31P (Zinstage):

Das Feld enthält die Zinstage. Eine Eingabe ist nur bei festverzinslichen Wertpapieren möglich. Ist das Feld bei festverzinslichen Wertpapieren nicht belegt, werden die Zinstage vom System berechnet.

Die Eingabe des Feldes ist nicht mehr erlaubt.

Feld 31P (Diskonttage):

Das Feld enthält die Diskonttage. Eine Eingabe ist nur bei Finanzierungsschätzen möglich. Ist das Feld bei Finanzierungsschätzen nicht belegt, werden die Diskonttage vom System berechnet.

Die Eingabe des Feldes ist nicht mehr erlaubt.

Feld 35A (Art des Wertpapiers):

In diesem Feld wird die Art des Wertpapiers durch ein entsprechendes Codewort angegeben. Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen der Wertpapierart aufgeführt:

Wertpapierart	Bedeutung
SHS	Aktien
BON	Renten
BCE	Zertifikatsähnliche Renten
WTS	Warrants
CER	Zertifikate
FUN	Fonds
SUB	Nebenrechte
RTE	Genussrechte
UNT	Units
MSC	Sonstige

Das Feld wird nicht geprüft.

Feld 35A (Nominale):

Das Feld enthält die Nominale oder die Stückzahl des Geschäfts. Die Eingabe des Feldes Nominale ist zur Zeit nur im Format 9n,3n möglich.

Feld 35B (Wertpapierkennnummer):

Das Feld enthält die 12stellige internationale Kennnummer (ISIN) des Wertpapiers.

Feld 33T (Währung der Notierung):

Das Feld enthält die Währung der Notierung im ISO-Format. Das Feld wird nicht geprüft.

Feld 33T (Kurs):

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Das Feld enthält den Kurs des Geschäfts.

Feld 82D (Eingaber des Geschäfts):

Das Feld enthält die vierstellige CBF-Konto-Nr. des Eingabers des Geschäfts. Diese muss dem Börsenplatz im Feld 31P entsprechen.
Es besteht die Möglichkeit, Bankdirektgeschäfte für dazu berechnigte CBF-Konto-Nr. fremd zu erfassen.

Feld 82D (Kontrahent):

Das Feld enthält die vierstellige CBF-Konto-Nr. des Kontrahenten des Geschäfts.

Feld 71B (Wiederanlagerabatt):

Das Feld enthält den Wiederanlagerabatt als Betrag. Eine Eingabe ist nur bei Investmentzertifikaten möglich.

Feld 71B (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. Ist der Bonifikationssatz negativ, ist die Konstante mit '/N' zu belegen.

Feld 71C (Courtagebetrag):

Das Feld enthält den Courtagebetrag. Ist die Courtage negativ, ist die Konstante mit '/N' zu belegen. Die Eingabe eines Courtagebetrags ist nur bei Kennzeichen Courtage 'AC' erlaubt.

Feld 71C (Kennzeichen Courtage):

Das Feld enthält zusätzliche Angaben zur Courtage. Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen des Feldes aufgeführt:

Kennzeichen	Bedeutung
AC	Abweichende Courtage
FC	Franco Courtage
FR	Franco Courtage, Spesen und Provision
HC	Halbe Courtage

Bei Eingabe von 'AC' ist das Feld Courtagebetrag Mussfeld.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 71D (Spesen):

Das Feld enthält die Angabe des Spesenbetrags. Bei Finanzierungsschätzen ist die Angabe nicht erlaubt. Sind die Spesen negativ, ist die Konstante mit '/'N' zu belegen.

Feld 71D (Provision):

Das Feld enthält die Angabe der Provision als Betrag oder als Promillesatz. Das Kennzeichen Provision kennzeichnet die Art der Provision. Dabei sind die unterschiedlichen Definitionen zu beachten:

Provisionsbetrag	2a7n,2n	z.B. PD100,5
------------------	---------	--------------

Provisionsatz	2a2n,3n	z.B. PM5,275
---------------	---------	--------------

Ist die Provision negativ, ist die Konstante mit '/'N' zu belegen.

Feld 72 (Text):

Das Feld enthält einen frei wählbaren Text.

Feld 36 (Devisenkurs):

Das Feld enthält den Devisenkurs des Geschäfts.

Die Eingabe des Feldes Devisenkurs ist zur Zeit nur im Format 5n,5n möglich.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.4 Schlussnote (MT 512)

Urheber: Systeme XONTRO, INVESTRO und MAX-ONE

Für den Bezug von Schlussnoten über den Systemanschluss KI ist eine gesonderte Freischaltung durch die BrainTrade GmbH notwendig.

Empfänger der Schlussnoten kann ein beliebiges Institut mit Systemanschluss KI sein. Der Versand an mehr als einen Empfänger ist jedoch nicht möglich.

Der Bezug der Schlussnoten über andere Wege wie beispielsweise SNO-Datenträger ist zusätzlich möglich.

Hinweis für Bezieher des SNO-Datenträgers: Die OSN (Output Sequence Number) einer Nachricht aus dem Systemanschluss KI steht in keiner Beziehung zu der OSN im SNO-Datenträger.

- XONTRO:
- (1) Übermittlung von Schlussnoten aus den Abruf-Gruppen
 - A – Aufgaben
 - G – Xontro-Geschäfte (incl. Aufgabe-Schließungen und Durchlieferungen)
 - S – Storni
 - (2) Liegen der Schlussnote mehr als eine Order zu Grunde, werden die dazu gehörigen Order-Referenzen in ein oder mehreren Nachrichten des Typs MT599 gesendet, sofern dies gewünscht wird.
- INVESTRO:
- (1) Übermittlung von Schlussnoten aus der Abruf-Gruppe
 - V – INVESTRO-Geschäfte
 - (2) Liegen der Schlussnote mehr als ein INVESTRO-Auftrag zu Grunde, werden die Auftragsreferenzen in ein oder mehreren Nachrichten des Typs MT599 gesendet, sofern dies gewünscht wird.
- INVESTRO/
Vestima+:
- (1) Übermittlung von Schlussnoten aus der Abruf-Gruppe
 - F – EUFO-Geschäfte
 - (2) Einer EUFO-Schlussnote liegt immer nur ein EUFO-Auftrag zugrunde. Deshalb wird hier niemals ein MT599 gesendet.
- MAX-ONE:
- (1) Übermittlung von Schlussnoten aus den Abruf-Gruppen
 - A – Aufgaben
 - G – Xontro-Geschäfte (incl. Aufgabe-Schließungen und Durchlieferungen)
 - S – Storni

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

- (2) Liegen der Schlussnote mehr als eine Order zu Grunde, werden die Order-Referenzen in ein oder mehreren Nachrichten des Typs MT599 gesendet, sofern dies gewünscht wird.

MT 512 Schlussnote/Geschäftsbestätigung			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format

Die Beschreibung dieses Nachrichtenformats ist in dem Dokument „SNO-Datenträgerbeschreibung“ enthalten und kann dort nachgeschlagen werden.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.5 OTC Trade Report (MT 513)

Urheber: Bank

Übermittlung von XONTRO-Trade-Reports

MT 513 OTC Trade Report			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
O	20:	Bankinterne OTC-Trade-Report-Nummer	13x
M	31P:	Börsenplatz Abschlussdatum (JJMMTT) Abschlussuhrzeit (HHMM)	3x6n4n
M	40:	BIC des Melders Execution Venue ID Abweichender Preis Indikator Verhandelter Preis Indikator Delay Indikator Amendment Einheit der Effektennotiz Abweichung zu UTC mit Vorzeichen (+/-HHMM)	11x/12x/[1a]/[1a]/ [1a]/[1a]/[1n]/ [1x4n]
M	35A:	Nominale	10n,3n
M	35B:	Wertpapierkennnummer	ISINb12c
M	33T:	Währung zum Preis Preis	3a6n,4n
M	82D:	Eingeber des Geschäfts	4n

Außer Etikett 40: sind alle Etiketten mit denen des MT511 identisch.

Feld 20 (Bankinterne OTC-Trade-Report-Nummer):

Das Kreditinstitut kann bei Bedarf eine bankinterne OTC-Trade-Report-Nummer vergeben. Diese wird in der Bestätigung zurückgeliefert.

Feld 31P (Börsenplatz):

Das Feld muss dem Börsenplatz des Eingebers (Feld 82D) entsprechen.
Möglicher Wertebereich:

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

100 – Berlin

150 – Hannover

120 – Düsseldorf

160 – Börse München

130 – Frankfurt

170 – Stuttgart

140 – Hamburg

Feld 31P (Abschlussdatum):

Das Feld enthält das Datum des Abschlusses des Geschäfts im Format JJMMTT. Erlaubt ist jeder Kalendertag, also auch Samstag, Sonntag oder Feiertag.

Feld 31P (Abschlussuhrzeit):

Das Feld gibt den Zeitpunkt an, zu dem das Geschäft ausgeführt wurde. Anzugeben ist die Ortszeit der zuständigen Behörde, der das Geschäft gemeldet wird.

Feld 40 (BIC des Melders):

11-stelliger alphanumerischer Code zur Identifizierung des meldenden Institutes. Hier ist das Institut einzutragen, welches das gemeldete Geschäft abgeschlossen hat. Bei Meldungen „on behalf“ weicht die BIC des Melders also vom Eingeber (Feld 82D) ab. Es erfolgt keine Prüfung auf Existenz.

Feld 40 (Execution Venue ID):

Hier ist anzugeben, ob das gemeldete Geschäft ein OTC-Geschäft ist, ob es ein internalisiertes Geschäft ist oder ob es auf einer Plattform (und ggf. welcher) zustande gekommen ist.

Die folgenden Ausprägungen sind zulässig:

‚OTC‘ für OTC-Geschäfte konstanter Wert

‚SI‘ für systematische Internalisierer konstanter Wert

zur Identifizierung einer Plattform:

‚B‘ plus BIC (ISO 9662, 11-stellig alphanummerisch) z. B. BDEUTDEFFXXX

‚M‘ plus MIC (ISO10383, 4-stellig alphanummerisch) z. B. MXFRA

‚I‘ plus IBEI (ISO16327, 10-stellig alphanummerisch) z. B. IDE12345670

Feld 40 (Indikator: vom Marktpreis abweichender Preis):

Das Feld ist mit ‚J‘ zu füllen, wenn der Preis vom Marktpreis abweicht. In diesem Fall wird die Preisvalidierung unterdrückt.

Feld 40 (Indikator: verhandelter Preis):

Das Feld ist mit ‚J‘ zu füllen, wenn der Preis verhandelt worden ist. In diesem Fall wird die Preisvalidierung unterdrückt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 40 (Delay Indikator):

Hiermit wird der Block trade delay angesprochen. Ist der Delay Indikator auf „J“ gesetzt, so wird gemäß den MIFID-Verzögerungsregeln die Meldung erst zum spätest möglichen Zeitpunkt zur Veröffentlichung gegeben.

Feld 40 (Amendment):

Das Feld ist mit ‚J‘ zu füllen, wenn die Meldung nach einem Storno neu erfasst wird. Eine Prüfung auf einen vorangegangenen Storno findet nicht statt.

Feld 40 (Einheit der Effektennotiz):

Das Feld kann folgende Ausprägungen enthalten:

Kennzeichen	Bedeutung
1	Stücknotiz
2	Prozentnotiz
3	Promillenotiz

Feld 40 (Abweichung zu UTC mit Vorzeichen +/-HHMM):

Hier ist anzugeben, wie weit der Ort, dessen Uhrzeit als Abschlussuhrzeit gemeldet wird, von der Universal Time Coordinated (UTC) abweicht, z. B. Frankfurter Winterzeit ist +0100, Frankfurter Sommerzeit ist +0200.

Feld 35A (Nominale):

Das Feld enthält die Nominale oder die Stückzahl des Geschäfts. Die Eingabe des Feldes Nominale ist zur Zeit nur im Format 9n,3n möglich.

Feld 35B (Wertpapierkennnummer):

Das Feld enthält die 12stellige internationale Kennnummer (ISIN) des Wertpapiers.

Feld 33T (Währung zum Preis):

Das Feld enthält bei stücknotierten Werten die Währung zum Preis im ISO-Format, bei prozentnotierten Werten die Depotwährung.

Feld 33T (Preis):

Das Feld enthält den Preis des Geschäfts.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 82D (Eingeber des Geschäfts):

Das Feld enthält die vierstellige CBF-Konto-Nr. des Eingebers des Geschäfts. Diese muss dem Börsenplatz im Feld 31P entsprechen.

Es besteht die Möglichkeit, OTC-Trade-Reports für dazu berechnigte CBF-Konto-Nummern fremd zu erfassen.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.6 Orders zur Schlussnote (MT 599)

Urheber: Systeme XONTRO, INVESTRO und MAX-ONE

XONTRO,
INVESTRO,
MAX ONE:

- (1) Übermittlung der von einer Schlussnote betroffenen Orders. Die Nachricht tritt nur in Verbindung zu einer Schlussnote (MT512) auf. Sie wird erzeugt, wenn
 - mehr als eine Order von einer Schlussnote betroffen ist oder nicht die gesamte Ordernominale in die Schlussnote einfließt
 - und der Bezug dieser Order-Referenzen für das Institut eingerichtet wurde.
- (2) Pro MT599 werden max. 10 Orders übermittelt. Dies ist abweichend zum SNO-Datenträger; dort können pro MT599 maximal 34 Orders übermittelt werden.
- (3) Die OSNs der Nachrichten zu einer Schlussnote werden aufsteigend, aber nicht zwingend fortlaufend vergeben. Dies ist abweichend zum SNO-Datenträger.

MT 599 Orders zur Schlussnote			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format

Die Beschreibung dieses Nachrichtenformats ist in dem Dokument „SNO-Datenträgerbeschreibung“ enthalten und kann dort nachgeschlagen werden.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.7 Ausführungsbestätigung für Ausführung eines Fondsauftrages (MT 515)

Urheber: Systeme INVESTRO und Vestima+.
 Der Nachrichtenaufbau entspricht dem SWIFT-Format 15022.

- INVESTRO:
- (1) Nach der Ausführung eines Auftrages in einer INVESTRO-Gattung mit Vestima+-Aufgeber wird eine Kopie der Ausführungsbestätigung an die Depotbank (Order Handling Agent / OHA) übertragen.
 - (2) Nach der Ausführung eines Auftrages in einer Vestima+-Gattung wird die von Vestima+ an Investro gesendete Ausführungsbestätigung an den Aufgeber (Order Issuer / OI) des Auftrages übertragen.

(1) Nachrichtenaufbau MT515 an INVESTRO-Depotbank (OHA):

M/O	TAG	Format	Value	Comments
M	:16R:		GENL	Start of A - General Information
M	:20C:	:4!c/16x	:SEME//OHAordernumber	INVESTRO reference to INVESTRO OHA
M	:23G:	4!c/4!c]	NEWM	NEWM=New confirmation
M	:22F:	:4!c/4!c	:TRTR//TRAD	Transaction type indicator
M	:16R:		LINK	Start of A 1 – Linkages (3)
C	:20C:	:4!c/16x	:RELA//DWZordernumber	“DWZ”+DWZ Order number
M	:16S:		LINK	End of A 1 – Linkages (3)
M	:16S:		GENL	End of A - General Information
M	:16R:		CONFDET	Start of C – Confirmation Details
M	:98A:	:4!c/8!n	:SETT//yyyymmdd	Settlement date
M	:98A:	:4!c/8!n	:TRAD//yyyymmdd	Trade date
M	:90B:	:4!c/4!c/3!a15d	:DEAL//ACTU/EURamount	Deal price and currency as actual amount
M	:22H:	:4!c/4!c	:BUSE//REDM :BUSE//SUBS	REDM=Redemption (Verkauf) SUBS=Subscription (Kauf)
M	:22H:	:4!c/4!c	:PAYM//APMT	Payment type indicator
M	:16R:		CONFPRTY	Start of C1 – Confirmation Parties
M	:95R:	:4!c/[8c]/34x	:BUYR/CEDE/account number :SELL/CEDE/account number	CBF Account Number of German OHA

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

M/O	TAG	Format	Value	Comments
O	:97A:	:4!c//35x	:SAFE//account number	Confirmation Party account number on Fundside to settle order
M	:16S:		CONFPRTY	End of C1 – Confirmation Parties
M	:36B:	:4!c//4!c/15d	:CONF//UNIT/quantity	Confirmed quantity of financial instrument
M	:35B:	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	ISIN isin description	ISIN and description
M	:16S:		CONFDET	End of C – Confirmation Details
M	:16R:		SETDET	Start of D – Settlement Details
M	:22F:	:4!c//4!c	:SETR//TRAD	Type of settlement transaction indicator: trade
O	:22F:	:4!c/[8c]/4!c	:STCO/CEDE/DFLT	Default as stored in KUSTA
M	:16R:		SETPRTY	Start of D1 Settlement Parties (1)
M	:95P:	:4!c//4!a2!a2!c3! !c]	:PSET//BIC address	Place of Settlement
M	:16S:		SETPRTY	End of D1 – Settlement Parties (1)
M	:16R:		SETPRTY	Start of D1 Settlement Parties (2)
M	:95P:	:4!c//4!a2!a2!c3! !c]	:xEAG//BIC address	DEAG if 22H Redemption REAG if 22H Subscription
C	:97A:	:4!c//35x	:SAFE//account number	Account number 5!n or 8!n
M	:16S:		SETPRTY	End of D1 – Settlement Parties (2)
M	:16R:		SETPRTY	Start of D1 Settlement Parties (3)
C	:95P:	:4!c//4!a2!a2!c3! !c]	:xEUC//BIC address	DECU if 22H Redemption RECU if 22H Subscription
C	:97A:	:4!c//35x	:SAFE//account number	Account number 5!n or 8!n
M	:16S:		SETPRTY	End of D1 – Settlement Parties (3)
M	:16R:		SETPRTY	Start of D1 Settlement Parties (4)
C	:95P:	:4!c//4!a2!a2!c3! !c]	:BUYR//BIC address or :SELL//BIC address	SELL if 22H Redemption BUYR if 22H Subscription
C	:97A:	:4!c//35x	:SAFE//account number	Account number 5!n or 8!n
M	:16S:		SETPRTY	End of D1 – Settlement Parties (4)
M	:16R:		AMT	Start of D3 – Conditional Amounts (1)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

M/O	TAG	Format	Value	Comments
M	:19A:	:4!c//3!a15d	:DEAL//EURamount	Trade amount
M	:16S:		AMT	End of D3 – Conditional Amounts (1)
M	:16R:		AMT	Start of D3 – Conditional Amounts (6)
M	:19A:	:4!c//3!a15d	:SETT//EURamount	Settlement amount
M	:16S:		AMT	End of D3 – Conditional Amounts (6)
M	:16R:		AMT	Start of D3 – Conditional Amounts (7)
O	:19A:	:4!c//3!a15d	:BAKL//EURamount	Amount of back-end-load charges
M	:16S:		AMT	End of D3 – Conditional Amounts (7)
M	:16R:		AMT	Start of D3 – Conditional Amounts (8)
O	:19A:	:4!c//3!a15d	:ENTF//EURamount	Amount of entrance charges: Difference between Settlement amount and trade amount
M	:16S:		AMT	End of D3 – Conditional Amounts (8)
M	:16S:		SETDET	End of D – Settlement Details

Legende: M=Mandatory, O=Optional; C=Conditional

Hinweis zu (1):

In den Settlement Details wird die Settlement Chain des Vestima+-Auftragsgeber (OI) übermittelt.

(2) Nachrichtenaufbau MT515 an INVESTRO-Orderaufgeber in einer Vestima+-Gattung:

Der Nachrichtenaufbau für den Order Issuer ist folgendem Dokument zu entnehmen:

www.clearstream.com

→ Publications & Downloads

→ Investment Funds

→ Vestima+ User Documentation

→ Vestima+ SWIFT

Vestima+ SWIFT User Guide for Order Issuers

Hinweis zu (2):

Abweichend zu den Angaben im o.g. Dokument enthält das Feld 20C SEME immer das Literal "CON" gefolgt von der 13 stelligen DWZ-Ordernummer.

Das Feld 20C RELA enthält die bankinterne Ordernummer, wenn sie im Auftrag mitgeschickt wurde. Ist keine bankinterne Ordernummer vorhanden, enthält das Feld das Literal "DWZ" gefolgt von der 13 stelligen DWZ-Ordernummer.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.8 Ausführungsbestätigung (MT 519)

Urheber: Systeme XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE

- XONTRO:
- (1) Nach Feststellung eines Börsenkurses und Ablauf der Kurskorrekturzeit werden Bestätigungen für alle zu diesem Kurs ausgeführten elektronisch übermittelten Orders den Benutzern (Banken) gemeldet. In dieser Mitteilung wird generell die ausgeführte Nominale mitgeliefert. Die Ausführungsbestätigungen sind verbindlich. Eine Stornierung der Ausführungsbestätigungen ist nicht mehr möglich. (Stornierung nur noch über Stornierung von Geschäften in Börsengeschäftseingabe möglich).
 - (2) Bei den Ausführungsbestätigungen für Kassakurse ohne Zusätze ('Bezahl-Kurse') kann die Bank wählen zwischen der hier definierten Mitteilung auf Einzelorderebene und einer globalen Mitteilung auf Gattungsebene (vgl. MT551). Die Festlegung erfolgt im Benutzerprofil.
 - (3) Bei Kassakursen mit Zusätzen, die eine Teilausführung von einzelnen Orders notwendig machen, werden generell Ausführungsbestätigungen auf Einzelorderebene mit Angabe der jeweils ausgeführten Nominale erstellt.
 - (4) Für alle im System befindlichen Orders werden Ausführungsbestätigungen erstellt.
 - (5) Für ausgeführte Orders eines Handelsteilnehmers werden zusätzlich Ausführungsbestätigungen an die Abwicklungsbank erstellt.

- Xetra:
- (1) Nach Ausführung einer Order wird dem Teilnehmer eine Ausführungsbestätigung übermittelt.
 - (2) Für alle per Orderrouting und über VALUES basierte Frontend-Applikationen (Notfall-Prozedere) transferierten Orders wird eine Ausführungsbestätigung erstellt.
 - (3) Die Ausführungsbestätigungen werden immer auf Einzelorderebene übermittelt.
 - (4) Da in Xetra eine Order gleichzeitig gegen mehrere Orders mit unterschiedlichen Preisen ausgeführt werden kann, können pro Ausführung mehrere Ausführungsbestätigungen erstellt werden (eine pro Preis).

- INVESTRO:
- (1) Nach der Preisauszeichnung eines INVESTRO Auftrags werden dem Aufgeber und dem Empfänger des Auftrags jeweils eine Ausführungsbestätigung übermittelt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

INVESTRO/Vestima+: Nach der Ausführung eines Auftrages in einer INVESTRO-Gattung mit Vestima+-Aufgeber wird kein MT519 als Kopie der Ausführungsbestätigung an den Empfänger des Auftrages übertragen (sondern ein MT515).

Nach der Ausführung eines Auftrages in einer Vestima+-Gattung wird kein MT519 an den Aufgeber des Auftrages übertragen (sondern ein MT515).

- MAX-ONE:
- (1) Nach Ausführung einer Order wird dem Teilnehmer eine Ausführungsbestätigung übermittelt.
 - (2) Für alle per Orderrouting, über Bankterminal und über eine Frontend-Applikationen eingegebenen Orders wird eine Ausführungsbestätigung erstellt.
 - (3) Die Ausführungsbestätigungen werden immer auf Einzelorderebene übermittelt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

MT 519 Ausführungsbestätigung			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
M	20:	Bezugsauftragsnummer: DWZ-Ordernummer bzw. Xetra-Ordernummer bzw. Ordernummer des Handelssystems	<u>13</u> x
M	21:	Bankinterne Ordernummer (Feld F:20 der Order) Falls nicht vorhanden: /NONREF	16x
M	23:	Geschäftsart: – BOUGHT oder SOLD – Kennzeichen börslich	6x[/2x]
M	31P:	Abschlussangaben: – Ausführungstag (JJMMTT) – Börsenplatz – Handelshinweis – Ausführer Makler / Kontrahent / Spezialist – Uhrzeit der Ausführung (HHMMSSHS) – Kurszusatz gem. Schlüsselverzeichnis – Zinstage mit Vorzeichen – freies Feld; wird z.Z. nicht benutzt	<u>6n3x2a4n8n</u> [b3x][/1x3n][/1x]
M	35A:	Art des Wertpapiers Stück oder Nennwert Rem-Peak-Qty	<u>3a10n,3n[/10n,3n]</u>
M	35B:	1. Zeile: Internationale Kenn-Nr. 2. Zeile: Wertpapierkurzbezeichnung. 3. Zeile: Versionsnummer (lastUpdateDat) exec-Id exec-Flag	<u>ISINb12c</u> 35x [18n][/5x[1x]]
O	50:	Kennzeichnung des Handelssystems	<u>3c</u>
M	33T:	Währung der Notierung (ISO-Code) Ausführungskurs	<u>3a6n,4n</u>

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

MT 519 Ausführungsbestätigung (Fortsetzung 1)

O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
0	72:	1. Zeile: ID-KZ des Ordereingebers	[DWZ-USERb10x]
		INVESTRO Vorzeichen Zwischengewinn, wenn negativ: „N“	[/[N]/[N]/[2n,2n]]
		INVESTRO Vorzeichen akkumulierte Erträge, wenn negativ: „/N“	
		INVESTRO Ausgabeaufschlag	
		2. Zeile: INVESTRO Bonisatz	[2n,3n]/[3n,7n]
		INVESTRO Wiederanlagerabatt	[/7n,8n]]]
		INVESTRO Zwischengewinn (wenn negativ, siehe 1. Zeile)	
		3. Zeile: INVESTRO Ausgabepreis	[7n,8n]/[9n,8n]
		INVESTRO Akkumulierter ausschüttungs- gleicher Ertrag (wenn negativ, siehe 1. Zeile)	

Regeln:**Feld 20 (Bezugsauftragsnummer):**

Die DWZ-Ordernummer ist wie folgt aufgebaut:

Stelle 1-6 (**6n**): Einstellungsdatum der Order im Handelssystem

Stelle 7-13 (**7n**): 7-stellige laufende Nummer

Xetra: Die Xetra-Ordernummer enthält keinen Hinweis auf das Datum oder andere Attribute der Order.

MAX-ONE: Die Ordernummer des Handelssystems enthält keinen Hinweis auf das Datum oder andere Attribute der Order.

Feld 21 (Bankinterne Ordernummer):

XONTR0: Das Feld Bankinterne Ordernummer ist bei ausgeführten Orders eines Handelsteilnehmers in der Nachricht an die Abwicklungsbank nicht belegt.

INVESTRO: Das Feld Bankinterne Ordernummer ist nur beim Aufgeber des Auftrags belegt.

Feld 23 (Geschäftsart):

BOUGHT aus MT500

SOLD aus MT501

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 23 (Kennzeichen börslich):

BS börslich
AB außerbörslich

XONTRO: Das Feld ist immer belegt.

Xetra: Das Feld ist immer belegt.

INVESTRO: Das Feld ist generell mit „AB“ belegt.

MAX-ONE: Das Feld ist generell mit „BS“ belegt.

Feld 31P (Ausführungstag):

XONTRO: Datum der Kursfeststellung

Xetra: Datum der Preisfeststellung

INVESTRO: Datum des Preises

MAX-ONE: Datum der Preisfeststellung

Feld 31P (Börsenplatz):

Börse, an der die Order ausgeführt wurde (lt. WM-Schlüssel GD621). Möglicher Wertebereich:

100 – Berlin	160 – Börse München
120 – Düsseldorf	170 – Stuttgart
130 – Frankfurt	183 – INVESTRO
140 – Hamburg	194 – Xetra Frankfurt
150 – Hannover	944 – Xetra Wien

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 31P (Handelshinweis):

Möglicher Wertebereich:

Ausprägung	Bedeutung	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
KS	Kassakurs	Ja	Nein	Nein	Ja
EK	Eröffnungskurs	Ja	Nein	Nein	Ja
SK	Schlusskurs	Ja	Nein	Nein	Nein
VA	variabel	Ja	Nein	Ja	Ja

Xetra: In Xetra gibt es keine Handelshinweise. Da dieses Pflichtfeld keine Leerzeichen enthalten darf, wird als Kennzeichnung der Wert "XT" übergeben.

INVESTRO: In INVESTRO gibt es keine Handelshinweise. Da dieses Pflichtfeld keine Leerzeichen enthalten darf, wird als Kennzeichnung der Wert "VA" übergeben.

Feld 31P (Ausführender Makler / Kontrahent / Spezialist):

XONTRO: Angabe der CBF-Konto-Nr. des ausführenden Maklers.

Xetra: Da dieses Feld ein Pflichtfeld ist, wird es mit dem Defaultwert Null zurückgegeben.

INVESTRO: Angabe der CBF-Konto-Nr. des Auftragempfängers.

MAX-ONE: Angabe der CBF-Konto-Nr. des Spezialisten.

Feld 31P (Uhrzeit der Ausführung):

Xetra: Die Uhrzeit der Ausführung wird in Xetra nur mit 6 Stellen angegeben (HHMMSS). Die beiden Stellen, die die 100-stel Sekunden darstellen, werden mit Nullen gefüllt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 31P (Kurszusatz):

Möglicher Wertebereich:

blank	Bezahlt
+	Bezahlt; kleine Stücke ohne Umsatz
BB	Bezahlt Brief
BB+	Bezahlt Brief; kleine Stücke ohne Umsatz
BBP	Bezahlt Brief Primärmarkt
BG	Bezahlt Geld
BG+	Bezahlt Geld; kleine Stücke ohne Umsatz
BGP	Bezahlt Geld Primärmarkt
EB	Etwas bezahlt Brief
EB+	Etwas bezahlt Brief; kleine Stücke ohne Umsatz
EG	Etwas bezahlt Geld
EG+	Etwas bezahlt Geld; kleine Stücke ohne Umsatz
RB	Rationiert/Rep. Brief
RB+	Rationiert/Rep. Brief; kleine Stücke ohne Umsatz
RBP	Rationiert Brief Primärmarkt
RG	Rationiert/Rep. Geld
RG+	Rationiert/Rep. Geld; kleine Stücke ohne Umsatz
RGP	Rationiert Geld Primärmarkt

Xetra: In Xetra gibt es keine Kurszusätze.

INVESTRO: In INVESTRO gibt es keine Kurszusätze.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 35A (Art des Wertpapiers):

Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen der Wertpapierart aufgeführt:

Wertpapierart	Bedeutung
SHS	Aktien
BON	Renten
BCE	Zertifikatsähnliche Renten
WTS	Warrants
CER	Zertifikate
FUN	Fonds
SUB	Nebenrechte
RTE	Genussrechte
UNT	Units
MSC	Sonstige

Xetra: Falls die Art des Wertpapiers nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „MSC“ an den Teilnehmer geliefert.

MAX-ONE: Falls die Art des Wertpapiers nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „MSC“ an den Teilnehmer geliefert.

Feld 35A (Rem-Peak-Qty):

Xetra: enthält das nach einer Preisfeststellung im Orderbuch sichtbare Volumen einer Iceberg Order.

Feld 35B / 2. Zeile (Wertpapierkurzbezeichnung):

Xetra: Falls die Wertpapierkurzbezeichnung nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „???“ geliefert.

MAX-ONE: Falls die Wertpapierkurzbezeichnung nicht ermittelt werden kann, wird als Defaultwert „???“ geliefert.

Feld 35B / 3. Zeile (Versionsnummer lastUpdateDat):

Xetra: Xetra transferiert u.a. bei einer Teilausführung die aktuelle Versionsnummer (lastUpdateDat). Diese Versionsnummer sollte für zukünftige Ordermodifikationen verwendet werden.

XONTRO: Bei Orderausführungen während der Zeichnungsphase sowie bei „Handel per Erscheinen“ wird der Emissionstermin (= Emissionsvaluta aus WM-Feld GD660) in die ersten 8 Stellen des Feldes lastUpdateDat eingestellt.

MAX-ONE: Bei Orderausführungen während der Zeichnungsphase sowie bei „Handel per Erscheinen“ wird der Emissionstermin (= Emissionsvaluta aus WM-Feld GD660) in die ersten 8 Stellen des Feldes lastUpdateDat eingestellt.

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

Feld 35B / 3. Zeile (exec-Id):

Xetra: Member-ID des BEST Executors für Xetra BEST.

Feld 35B / 3. Zeile (exec-Flag):

Xetra: Angabe, ob die Order in Xetra BEST ausgeführt wurde.

Feld 50 (Kennzeichnung des Handelssystems):

Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen aufgeführt:

Feldinhalt	Bedeutung
XON	Xontro
MAX	MAX-ONE
INV	Investro
XET	Xetra Frankfurt
FF2	Xetra Frankfurt 2

Feld 33T (Währung der Notierung):

INVESTRO: Das Feld wird mit der INVESTRO Abrechnungswährung belegt.

Feld 72 (ID-KZ des Ordereingebers):

XONTRO: Das Feld ID-KZ des Ordereingebers ist bei ausgeführten Orders eines Handelsteilnehmers beim Datensatz an die Abwicklungsbank mit der CBF-Konto-Nr. des Handelsteilnehmers belegt.

Feld 72 / alle Zeilen:

INVESTRO: Die Zeilen des Feldes 72 werden nur beim Aufgeber des Auftrags übertragen.

Feld 72 / 1. Zeile (Vorzeichen Zwischengewinn):

INVESTRO: Bei einem in Zeile 2 gelieferten negativen Zwischengewinn ist das Feld mit „N“ belegt.

Feld 72 / 1. Zeile (Vorzeichen akkumulierte Erträge):

INVESTRO: Bei einem in Zeile 3 gelieferten negativen akkumulierten ausschüttungsgleichen Ertrag ist das Feld mit „N“ belegt.

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

Feld 72 / 1. Zeile (Ausgabeaufschlag):

INVESTRO: Dieses Feld enthält den Ausgabeaufschlag in Prozent.

Feld 72 / 2. Zeile (Bonisatz):

INVESTRO: Es wird der Bonisatz aus den Feldern Bonisatz-1 oder Bonisatz-2 der Konditionstabelle INVESTRO oder der Wert „0“ übermittelt.

Käufe ohne Geschäftsartergänzung	Bonisatz-1
Käufe zur Wiederanlage	Bonisatz-2
Käufe zum Rücknahmepreis	„0“
Verkäufe	„0“

Feld 72 / 2. Zeile (Wiederanlagerabatt):

INVESTRO: Der Wiederanlagerabatt wird innerhalb des Wiederanlagezeitraums geliefert.

Feld 72 / 2. Zeile (Zwischengewinn):

INVESTRO: Der Zwischengewinn wird geliefert, wenn er gemeldet wird und wenn er ungleich ‚0‘ ist.

Ist der Zwischengewinn negativ, dann ist das Vorzeichen in Zeile 1 belegt.

Feld 72 / 3. Zeile (Ausgabepreis):

INVESTRO: Der Ausgabepreis kann leer sein, wenn sich der Fonds in der Rücknahmephase befindet.

Feld 72 / 3. Zeile (Akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag):

INVESTRO: Der akkumulierte ausschüttungsgleiche Ertrag wird geliefert, wenn er vorhanden ist und die Währung gleich der INVESTRO Abrechnungswährung ist.

Ist der Ertrag negativ, dann ist das Vorzeichen in Zeile 1 belegt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.9 Ereignisse im WP-Geschäft (MT 551)

Urheber: Systeme XONTRO, Xetra und MAX-ONE

- XONTRO:
- (1) Mitteilung von folgenden gattungsbezogenen Ereignissen:
 - Kassakursmitteilungen/Ausführungsbestätigungen auf Gattungsebene: Für alle Kassakurse ohne Zusätze können alternativ zu den Ausführungsbestätigungen auf Einzelorderebene diese Kassakursmitteilungen vom Benutzer (Bank) bezogen werden (Festlegung über Benutzerprofile). Bei Ausführungsbestätigungen auf Kassakursebene wird keine ausgeführte Nominale mitgeliefert.
 - Kursaussetzungen
 - Einfügen / Ändern / Löschen eines Kurses
 - Orderänderungen/-streichungen wegen Nebenrechten durch das System; Mitteilung auf Gattungsebene. Die Verarbeitung der Nebenrechte und der Versand der Ereignismitteilungen erfolgt in der Regel im Buchungsschnitt für den folgenden Börsentag. Es ist jedoch auch eine Verarbeitung am Folgetag möglich (Anstoß Makler); es werden dann nur die Orders bearbeitet, die bis zum Buchungsschnitt des Vortages vorlagen.
 - Die Verarbeitung von Orderstreichungen wegen Einstellung der Notierung nach Tagesendverarbeitung durch das System erfolgt nach dem Online-Ende von XONTRO. Sie können somit den Kreditinstituten nicht sofort übermittelt werden. Die Daten (MT551/MT595) werden bereitgestellt und können am nächsten Tag mittels Retrieval angefordert werden.
 - (2) Mitteilung von sonstigen Ereignissen:
 - Verlängerung der Börsenzeit
 - Unterbrechung der Börsenversammlung
 - Freigabe der Börsenversammlung
 - Technische Störung, z.B. Ausfall von Leitungsverbindung zum HOST der Deutsche Börse AG
 - Ausfall XONTRO-Anwendungsfunktionen
 - Allgemeine Informationen

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

- Xetra:
- (1) Mitteilung von folgenden gattungsbezogenen Ereignissen:
 - Kursaussetzungen
 - (2) Mitteilung von sonstigen Ereignissen:
 - Ende des Handelstages (Indikator XEBAT):
Für Xetra und für Xetra Frankfurt 2 wird jeweils der Indikator XEBAT geliefert.
 - Hinweis: Für den Börsenplatz Frankfurt wird weiterhin auch der Indikator BOEND geschickt.

Die Vergabe einer Ereignisnummer erfolgt abhängig vom Börsenplatz für Xetra oder für Frankfurt.

INVESTRO: MT551 werden nicht erstellt.

- MAX-ONE:
- (1) Mitteilung von folgenden gattungsbezogenen Ereignissen:
 - Kursaussetzungen
 - Orderstreichungen wegen Nebenrechten durch das System; Mitteilung auf Gattungsebene.
Die Verarbeitung der Nebenrechte und der Versand der Ereignismitteilungen erfolgt im Anschluss an den fortlaufenden Handel (End-of-Day-Verarbeitung) für den folgenden Börsentag. Es ist jedoch auch eine Verarbeitung am Folgetag möglich (Anstoß Spezialist); es werden dann nur die Orders bearbeitet, die bis zur End-of-Day-Verarbeitung des Vortages vorlagen.
 - Orderstreichungen wegen Einstellung der Notierung durch das System; Mitteilung auf Gattungsebene.
Die Verarbeitung und der Versand der Ereignismitteilungen erfolgt in der Regel im Anschluss an den fortlaufenden Handel (End-of-Day-Verarbeitung).
 - (2) Mitteilung von sonstigen Ereignissen:
 - Ende des Handelstages: TradeDay Closed (Indikator EHEND)

Die Vergabe der Ereignisnummern für MAX-ONE erfolgt analog XONTRO für die Börse München.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Die Mitteilungen werden bei Auftreten bzw. Verarbeitung des Ereignisses den Banken übermittelt.

MT 551 Nachricht über ein Ereignis			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
M	20:	Ereignisnummer (TRN)	6n7n
M	35B:	1. Zeile: Internationale Kenn-Nr. 2. Zeile: Wertpapierkurzbezeichnung 3. Zeile: Wertpapier-Kennnummer (deutsche) sofern gattungsbezogen, sonst 1. Zeile: Indikatorgruppe: MISC = nicht gattungsbezogen TECH = Technik, nicht gattungsbezogen nnnn = CBF-Konto-Nr. des Maklers CBF-Konto-Nr. des Xetra Teilnehmers CBF-Konto-Nr. des MAX-ONE Teilnehmers	[ISINb12c] 35x [6x] 35x
O	50:	Kennzeichnung des Handelssystems	3c
M	79:	Ereignisschlüssel: 1. Zeile 2. Zeile 3. Zeile	5c6n6n[6n6n] [/[6n,4n]/[N]/[3x] /[3a]/[4n]/[1x3n] /[ISINb12c]/[4x] /[6n,4n]/[6n,4n]/] [/[6n,4n]/[3x]/[6n,4n] /[3x]]
Siehe folgende Tabellen für Details !			
O	72:	Freier Informationstext	3*35x

Regeln:**Feld 20 (Ereignisnummer):**

Die Ereignisnummer (TRN) ist wie folgt aufgebaut:

Stelle 1-6 (**6n**): Datum in der Form JJMMTT

Stelle 7-13 (**7n**): 7-stellige laufende Nummer

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 35B (Indikatorgruppe):

Die Indikatorgruppen nnnn (CBF-Konto-Nr. des Maklers, des Xetra Teilnehmers bzw. des MAX-ONE Teilnehmers) können lediglich beim Indikator (Feld F:79 / 1. Zeile = TRESP, XEBAT bzw. EHEND) auftreten.

Feld 50 (Kennzeichnung des Handelssystems):

Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen aufgeführt:

Feldinhalt	Bedeutung
XON	Xontro
MAX	MAX-ONE
INV	Investro
XET	Xetra Frankfurt
FF2	Xetra Frankfurt 2

Feld 79 (Allgemeine Beschreibung):

Zeile	Beschreibung
1. Zeile	Ereignisschlüssel: Indikator 1.Datum (JJMMTT) 1.Uhrzeit (HHMMSS) 2.Datum (JJMMTT) 2.Uhrzeit (HHMMSS)
2. Zeile	Kurs / Limitabschlag N = Kennzeichen für Limitaufschlag Börsenplatz Währung der Notierung Ausführender Makler Zinstage mit Vorzeichen Neue Wertpapiergattung Art des Nebenrechts Geldkurs Briefkurs
3. Zeile	Kurs alt Zusatz alt Kurs neu Zusatz neu

Feld 79 / 1. Zeile:

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Im Folgenden werden die einzelnen Ereignisschlüssel im Feld F:79 / 1. Zeile in Abhängigkeit vom der Indikatorgruppe in Feld F:35B beschrieben:

Indikatorgruppe (Feld F:35B)	Ereignisschlüssel (Feld F:79 / 1. Zeile): Indikator
ISIN (Gattungsbezogen)	FIXOF (Fixing stopped) Kursaussetzung
	FIXON (Fixing restarted) Rücknahme einer Kursaussetzung
	SPOTR (Spot-Rate) Kassakursmitteilung
	EKURS Einfügen eines Kurses
	AKURS Ändern eines Kurses
	LKURS Löschen eines Kurses
	ORDCH (Orders changed) Orderänderungen/-streichungen auf Gattungsebene wegen Nebenrechten. Orderstreichungen auf Gattungsebene wegen Einstellung der Notierung (Tagesendverarbeitung)
	ORDIN Informationen bzgl. Nebenrechten, die keine Aktionen auf den Orderbestand bewirken (nur informativ)
MISC	BOEND (XONTRO-Ende Buchungsschnitt); Beginn des nächsten Börsentages in XONTRO. XONTRO hat alle Ereignismitteilungen (MT551), Ausführungsbestätigungen (MT519) und Schlussnoten (MT512, MT599) erstellt. Für den abgelaufenen Börsentag werden keine dieser Nachrichten für das Handelssystem XONTRO mehr erzeugt.
	SAKIV (SAKI-Ende vorläufig); letzte aktiv vom System gesendete Nachricht für den abgelaufenen „SAKI-Tag“ (außer SAKIE). Das System bleibt

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Indikatorgruppe (Feld F:35B)	Ereignisschlüssel (Feld F:79 / 1. Zeile): Indikator
---------------------------------	---

aber noch mindestens 10 Minuten offen für z.B. Retrievals oder Logouts.

SAKIE (SAKI-Ende); letzte Nachricht vom System für den abgelaufenen „SAKI-Tag“. Die OSN-Nummern werden anschließend zurückgesetzt.

BOERE (XONTRO-Restart); XONTRO wieder verfügbar;
Orderübertragung heute nicht mehr möglich

ORDRE (XONTRO-Restart inkl. Orders) XONTRO wieder verfügbar;
Orderübertragung wieder möglich

BOINT (Börse interrupt) Unterbrechung der Börsenversammlung;
alle Bearbeitungsfunktionen der Makler sind nicht möglich (inkl. Kursfestsetzung)

TRINT (Trade interrupt) Unterbrechung der Kursfeststellung;
andere Maklerfunktionen (z.B. Nachbearbeitung) sind erlaubt

BOSTA (Börse started) Wiederaufnahme der Börsenversammlung (nach BOINT)

TRSTA (Trading started) Wiederaufnahme der Kursfeststellung (nach TRINT)

NBSTA (Nachbearbeitung started) Wiederaufnahme der Börsenversammlung nur für Nachbearbeitungsfunktionen;
keine Kursfeststellung mehr möglich (nach BOINT)

TREXP (Trading time expanded) Information über eine Veränderung der Börsenzeit (global)

INFO1 Information (allgemeine Mitteilungen)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Indikatorgruppe (Feld F:35B)	Ereignisschlüssel (Feld F:79 / 1. Zeile): Indikator
TECH	NOT01 Bank kann keine Orders übertragen (z.B. Störung der Leitungsverbindung Bank ↔ System)
	NOT02 Rechner steht nicht zur Verfügung (z.B. Ausfall HOST-Rechner der Deutsche Börse AG)
	NOT03 Engpass im System der Deutsche Börse AG (z.B. Bank erhält keine Orderbestätigungen)
	<ul style="list-style-type: none"> – Die Nachrichten bzgl. NOT01 bzw. NOT02 werden der Bank nach Störungsende übermittelt. Die Nachrichten bzgl. NOT03 werden der Bank direkt beim Auftreten der Störung gemeldet. Diese Nachrichten werden nur an Banken übermittelt, die zum Zeitpunkt der Störung angemeldet waren. – Bei Störungsende werden den Banken, die vorher automatisch abgemeldet wurden, Störungsendenachrichten übermittelt (ORDRE bzw. BOERE). Nach Empfang dieser Störungsendenachrichten kann die Bank den Datenaustausch mit der Deutsche Börse AG, beginnend mit Anmeldenachrichten, wieder aufnehmen. – Generell erfolgt nach dem Versenden der Nachrichten der Indikatorgruppe TECH zur Bank eine automatische Abmeldung aller LTERMs der Bank inkl. Übermittlung der Abmeldebestätigung (MT003 in MT598 mit GV-Code = 023). Ausnahme: Bei NOT01 werden nur die gestörten LTERMs abgemeldet.
nnnn	TREXP (Trading time expanded) Information über eine Veränderung der Börsenzeit (Teilmarkt)
	XEBAT Ende Xetra Orderrouting auf Teilnehmerebene Ende Xetra Frankfurt 2 Orderrouting auf Teilnehmerebene
	EHEND Ende MAX-ONE Orderrouting auf Teilnehmerebene

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

Xetra: XEBAT gilt immer nur für den angegebenen Xetra Teilnehmer am jeweiligen Börsenplatz. Für diesen Teilnehmer werden nach dem XEBAT für diesen Börsenplatz keine Orderausführungen oder positiven Orderbestätigungen mehr übertragen.

Für alle zu diesem Zeitpunkt noch nicht beantworteten Nachrichten kann der tatsächliche Status nicht maschinell bestimmt werden. Daher ist eine manuelle Nachbearbeitung dieser Orders erforderlich. Die negativen Bestätigungen für diese ausstehenden Nachrichten werden mit einer entsprechenden Fehlermeldung (XK0300F, Feld F:79) nach dem XEBAT übertragen.

In Ausnahmefällen wird der XEBAT erst in der Tagesendverarbeitung erstellt und gesendet. Da in diesem Fall nicht feststeht, ob alle Broadcasts an den jeweiligen Teilnehmer gesendet wurden, wird diese Nachricht mit einem Text im Feld F:72 belegt: XK0310F EVTL. FEHLENDE BROADCASTS.

MAX-ONE: EHEND gilt immer nur für den angegebenen MAX-ONE Teilnehmer. Für diesen Teilnehmer werden nach dem EHEND keine Orderausführungen oder positiven Orderbestätigungen mehr übertragen.

Für alle zu diesem Zeitpunkt noch nicht beantworteten Nachrichten kann der tatsächliche Status nicht maschinell bestimmt werden. Daher ist eine manuelle Nachbearbeitung dieser Orders erforderlich. Die negativen Bestätigungen für diese ausstehenden Nachrichten werden mit einer entsprechenden Fehlermeldung (BC9430F, Feld F:79) nach dem EHEND übertragen.

Feld 79 / 2. Zeile (Börsenplatz):

Lt. WM-Schlüssel GD621. Möglicher Wertebereich:

100 – Berlin	150 – Hannover
120 – Düsseldorf	160 – Börse München
130 – Frankfurt	170 – Stuttgart
140 – Hamburg	194 – Xetra Frankfurt
	944 – Xetra Wien

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

Feld 79 / 3. Zeile (Zusatz alt / Zusatz neu):**Schlüsselverzeichnis:**

blank	Bezahlt
P	Bezahlt Primärmarkt
+	Bezahlt; kleine Stücke ohne Umsatz
BB	Bezahlt Brief
BB+	Bezahlt Brief; kleine Stücke ohne Umsatz
BBP	Bezahlt Brief Primärmarkt
BG	Bezahlt Geld
BG+	Bezahlt Geld; kleine Stücke ohne Umsatz
BGP	Bezahlt Geld Primärmarkt
EB	Etwas bezahlt Brief
EB+	Etwas bezahlt Brief; kleine Stücke ohne Umsatz
EG	Etwas bezahlt Geld
EG+	Etwas bezahlt Geld; kleine Stücke ohne Umsatz
RB	Rationiert/Rep. Brief
RB+	Rationiert/Rep. Brief; kleine Stücke ohne Umsatz
RBP	Rationiert Brief Primärmarkt
RG	Rationiert/Rep. Geld
RG+	Rationiert/Rep. Geld; kleine Stücke ohne Umsatz
RGP	Rationiert Geld Primärmarkt
C	Kompensationsgeschäft (nur Börse Frankfurt)
B	Brief
BP	Brief Primärmarkt
G	Geld
-	Gestrichen
-B	Gestrichen Brief
-G	Gestrichen Geld
-T	Gestrichen Taxe
-GT	Gestrichen Geld / Taxe
-BT	Gestrichen Brief / Taxe

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 79 / 1., 2., 3. Zeile (Ereignisschlüssel):

Bei den verschiedenen Indikatoren gilt folgende Feldbelegung:

Indikator	Pflichtfelder (M)	Wahlfelder (O)
FIXOF	Börsenplatz 1. Datum (gültig ab) 1. Uhrzeit (gültig ab): aktuelle Uhrzeit falls gleichartig wirksam wird; ansonsten: ,000000'	2. Datum (gültig bis) 2. Uhrzeit (gültig bis) generell, falls 2. Datum belegt: ,235959' Art des Nebenrechts: die Ergänzungen ,ZG' (gestrichen Ziehung) und ,PO' (Public Offering) sind möglich
	XONTRO: Beim Zusatz ,PO' (Public Offering) dient die Nachricht als Hinweis auf eine Zeichnungssperre. Orderrouting ist danach in dieser Gattung wie bei jeder Kursaussetzung nicht möglich. Allerdings werden bei diesem Zusatz offene Orders der Teilnehmer nicht gelöscht. Falls keine Wahlfelder angegeben sind, gilt die Aussetzung bis zur expliziten Rücknahme.	
FIXON	Börsenplatz 1. Datum (gültig ab) 1. Uhrzeit (gültig ab)	keine
SPOTR	Börsenplatz 1. Datum (gültig ab) 1. Uhrzeit (gültig ab) Kursfeststellungszeit Kurs (= Kassakurs) Ausführender Makler	Währung Zinstage
TREXP (,,nnnn")	Börsenplatz 1. Datum (JJMMTT) 1. Uhrzeit (HHMMSS)	2. Datum (JJMMTT) 2. Uhrzeit (HHMMSS)
EKURS AKURS LKURS	Börsenplatz 1. Datum (der Kursfeststellung) 1. Uhrzeit (der Kursfeststellung)	2. Datum (der Durchführung) 2. Uhrzeit (der Durchführung) Kurs alt (bei AKURS / LKURS) Zusatz alt (bei AKURS / LKURS) Kurs neu (bei EKURS / AKURS) Zusatz neu (bei EKURS / AKURS)
ORDCH	1. Datum (gültig ab): Dieses Feld enthält den Extag des Handelsereignisses 1. Uhrzeit (gültig ab): generell '000000' Art des Nebenrechts	Börsenplatz Limitabschlag N = Kennzeichen für Limitaufschlag Währung Neue Wertpapiergattung (= Gattungs-Änderung)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Indikator	Pflichtfelder (M)	Wahlfelder (O)
	→ Zu den möglichen Arten von Nebenrechten siehe nachfolgende Tabelle	Falls keines der Wahlfelder angegeben ist, wurden die Orders gestrichen.
ORDIN	1. Datum (gültig ab): Dieses Feld enthält den Extag des Handelsereignisses 1. Uhrzeit (gültig ab): generell '000000' Art des Nebenrechts → Zu den möglichen Arten von Nebenrechten siehe nachfolgende Tabelle	Börsenplatz
BOEND	1. Datum (gültig ab) 1. Uhrzeit (gültig ab)	freier Informationstext (Feld F:72)
SAKIV	1. Datum (JJMMTT) 1. Uhrzeit (HHMMSS)	freier Informationstext (Feld F:72) Feldbelegung s. Hinweise zu SAKIV
SAKIE	1. Datum (JJMMTT) 1. Uhrzeit (HHMMSS)	freier Informationstext (Feld F:72) Feldbelegung s. Hinweise zu SAKIE
ORDRE BOERE TRINT TRSTA BOINT BOSTA NBSTA INFO1 XEBAT („nnnn“) EHEND („nnnn“)	Börsenplatz 1. Datum (gültig ab) 1. Uhrzeit (gültig ab)	freier Informationstext (Feld F:72)
TREXP	Börsenplatz 1. Datum (gültig bis)	keine
NOT01 NOT02 NOT03	Börsenplatz 1. Datum (gültig bis) 1. Uhrzeit (gültig bis)	freier Informationstext (Feld F:72)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

ORDCH:

ORDCH: Folgende Arten von Nebenrechten sind möglich		
Art des NR	Beschreibung	Aktion auf Orderbestand
EREO	ex Redenominierung wegen Euro	Orderlöschung
EXBR	ex Bezugsrecht (ordentliche Kapitalerhöhung)	Orderlöschung
EXBA	ex Berichtigungsaktien (Kapitalerhöhung aus Gesellschaftsmitteln)	Orderlöschung
EXAG	ex Ausschüttung (bei Genussscheinen)	Orderlöschung
EXDI	ex Dividende (Dividendenausschüttung)	Orderlöschung
EXDA	ex Dividende (bei Auslandsaktien) (Dividendenausschüttung)	Orderlöschung
EXZS	ex Zinsen (bei Anleihen)	Orderlöschung
EXAZ	ex Ausgleichszahlung (bei Aktien)	Orderlöschung
EXBO	ex Bonusrecht (bei Aktien)	Orderlöschung
HL	Hinweis (auf Besonderheiten wird gesondert hingewiesen)	Orderlöschung
HA	Hinweis (auf Besonderheiten wird gesondert hingewiesen)	Limitabschlag
EABC	ex verschiedene Rechte	Orderlöschung
EXSP	Teilung (Split) bei ausländischen Aktien	Orderlöschung
EXRS	Zusammenlegung (Reverse Split) bei Aktien	Orderlöschung
WKNA	Gattungs-Änderung	Gattungs-Änderung
ENOT	Einstellen der Notierung	Orderlöschung
LHBR	Ende des Bezugsrechtshandels	Orderlöschung von limitierten Orders
SBSL	keine SB-/SL-Orders möglich	Orderlöschung
MSEG	für XONTRO ungültiges Marktsegment	Orderlöschung
MBKS	Änderung Kennzeichen Einheitsnotierung , kleinste handelbare Einheit, Mindestbetrag oder Inkrement Mindestbetrag Einheitskurs	Orderlöschung /-änderung

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

ORDCH: Folgende Arten von Nebenrechten sind möglich (Fortsetzung)		
Art des NR	Beschreibung	Aktion auf Orderbestand
MBVA	Änderung Kennzeichen variabler Handel, kleinste handelbare Einheit, Mindestbetrag oder Inkrement Mindestbetrag variabler Handel	Orderlöschung/-änderung
KSVA	Wechsel von Einheitsnotierung in variablen Handel ohne Einheitsnotierung	Orderlöschung/-änderung
KSKH	Wechsel von Einheitsnotierung in kein Handel	Orderlöschung
VAKS	Wechsel von variablen Handel ohne Einheitsnotierung in Einheitsnotierung	Orderlöschung/-änderung
VAKH	Wechsel von variablen Handel ohne Einheitsnotierung in kein Handel	Orderlöschung
VKKS	Wechsel von variablen Handel mit Einheitsnotierung in Einheitsnotierung	Orderlöschung/-änderung
VKVA	Wechsel von variablen Handel mit Einheitsnotierung in variablen Handel ohne Einheitsnotierung	Orderlöschung/-änderung
VKKH	Wechsel von variablen Handel mit Einheitsnotierung in kein Handel	Orderlöschung

ORDIN:

ORDIN: Folgende Arten von Nebenrechten sind möglich		
Art des NR	Beschreibung	Aktion auf Orderbestand
EXAR	ex Ausschüttung bei Renten	keine; nur informativ
H	Hinweis (auf Besonderheiten wird gesondert hingewiesen)	keine; nur informativ

XONTRO: Hinweise zu ORDCH und ORDIN:

1. Im Header wird Datum und Zeit der Verarbeitung des Handelsereignisses eingestellt. In der Regel wird dieser Zeitpunkt im Buchungsschnitt vor dem Extag liegen.
2. In Ausnahmefällen ist die Verarbeitung jedoch auch am Extag vor dem 1. Kurs möglich. Generell werden nur Orders bearbeitet, deren Eingang bis zum Buchungsschnittende vor dem Extag in XONTRO vorlag.
Alle Orders, deren DWZ-Ordernummer in den ersten 6 Stellen identisch mit dem Extag sind

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

(Form: JJMMTT), und alle Orders, die vom Orderaufgeber mit der Gültigkeit ab dem Folgetag aufgegeben wurden, werden nicht bzgl. des Handelereignisses bearbeitet.

3. Dies gilt nicht, falls es sich bei dem Nebenrecht um LHBR handelt. In diesem Fall werden auch die limitierten Orders mit Gültigkeit ab Folgetag gelöscht.

MAX-ONE: Hinweise zu ORDCH

1. Im Header wird Datum und Zeit der Verarbeitung des Handelereignisses eingestellt. In der Regel wird dieser Zeitpunkt im Anschluss an den fortlaufenden Handel vor dem Extag liegen.
2. In Ausnahmefällen ist die Verarbeitung jedoch auch am Extag vor Handelsbeginn vor der Eröffnungsauktion möglich. Generell werden nur Orders bearbeitet, deren Eingang vor der End-of-Day-Verarbeitung vor dem Extag in MAX-ONE vorlag.

Hinweise zum Indikator SAKIV:

Das Feld F:72 wird folgendermaßen verwendet:

Stelle 1 bis 6	SAKI-Datum – aktueller Wert
Stelle 7:	Space
Stelle 8 bis 27:	Letzte OSN in jedem Nummernkreis, getrennt durch “/” (wurde in einem Nummernkreis keine OSN vergeben, dann wird der jeweilige Initialwert 000000, 300000, 600000 eingestellt)

Hinweise zum Indikator SAKIE:

Das Feld F:72 wird folgendermaßen verwendet:

Stelle 1 bis 6	SAKI-Datum – neuer Wert nach SAKI-Ende
Stelle 7:	Space
Stelle 8 bis 13:	SAKI-Datum – alter Wert bis SAKI-Ende
Stelle 14:	Space
Stelle 15 bis 34:	Letzte OSN in jedem Nummernkreis, getrennt durch “/” (wurde in einem Nummernkreis keine OSN vergeben, dann wird der jeweilige Initialwert 000000, 600000 eingestellt)

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

3.2.10 Anfrage: Änderung / Streichung / Storno / Durchlieferung (MT 595)

Urheber: Benutzer (Bank) und Systeme (XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE)

- Bank:
- (1) Übermittlung von Orderänderungen und -streichungen.
Bei Orderänderung/-streichung während einer laufenden Kursfeststellung in XONTRO, bei Marktausgleichsphase in Xetra bzw. Orderbuchsperrung in MAX-ONE (Zeitraum zwischen Preisfeststellung und Ausführung der Orders) erfolgt zunächst eine vorläufige Meldung (MT596). Die Änderung / Streichung der Order wird im System vorgetragen und nach Entsperrung des Orderbuchs, nach Ende der Marktausgleichsphase bzw. nach Orderbuchsperrung automatisch verarbeitet.
Die Bank erhält eine endgültige Meldung (MT596), in der die Orderannahme bzw. Ablehnung inkl. Uhrzeit der definitiven Annahme / Ablehnung mitgeteilt wird.
 - (2) Übermittlung von INVESTRO Auftragsstreichungen. Bei Auftragsstreichungen, die von INVESTRO an das Handelssystem Vestima+ übertragen wurden, erhält die Bank zunächst eine vorläufige Meldung (MT596). Nach der Antwort aus Vestima+ erhält die Bank eine Meldung (MT596), in der die Annahme oder Ablehnung der Auftragsstreichung in Vestima+ mitgeteilt wird. Anschließend erhält die Bank eine Statusmitteilung (MT595) über die Durchführung oder Ablehnung der Auftragsstreichung durch die Vestima+-Depotbank (OHA).
 - (3) Übermittlung Storno bzw. Durchlieferung eines Bankdirektgeschäfts. Die Bank muss sich für die Übermittlung in ihrem Benutzerprofil durch die BrainTrade GmbH freischalten lassen.
Die Eingabe eines Stornos bzw. einer Durchlieferung wird sofort an XONTRO Trade weitergeleitet. Falls für die beteiligte(n) Bank(en) Schlussnoten realtime übermittelt werden sollen, wird/werden die entsprechende(n) realtime Schlussnote(n) erstellt und übermittelt.
 - (4) Übermittlung Storno eines OTC-Trade-Reports. Die Eingabe eines Stornos wird sofort zum Veröffentlichen weitergeleitet. Die Eingabe und Veröffentlichung eines Stornos kann taggleich und für die vier letzten Arbeitstage erfolgen. Stornierungen auf ältere Meldungen werden abgewiesen.
- XONTRO:
- (1) Übermittlung / Protokollierung von Orderänderungen und -streichungen, die über Terminal Eingaben von Bank und vom Makler in das System eingegeben wurden.

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

- (2) Mitteilung von Orderänderungen und -streichungen wegen Nebenrechten (auf Orderebene).
 - (3) Mitteilung von Teilstreichungen durch Teilausführungen von nicht ganzzahligen Vielfachen des Mindestbetrages variabler Handel.
 - (4) Mitteilung von Orderstreichungen wegen Befristung.
 - (5) Mitteilung von Änderungen und Streichungen von Orders eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank.
 - (6) Mitteilung über das Umsetzen einer Stop Order in Billigst / Bestens.
- Xetra:
- (1) Übermittlung / Protokollierung aller Orderänderungen und Orderstreichungen, die über eine VALUES basierte Frontend-Applikation (Notfall-Prozedere) eingegeben wurden.
Hinweis: Die Anmeldung in der VALUES basierten Frontend-Applikation muss mit einer Orderrouting Trader-ID durchgeführt werden.
 - (2) Mitteilung aller Orderänderungen und -streichungen, die „on behalf“ für den Händler (z.B. von der Market Supervision) eingegeben wurden.
 - (3) Mitteilung von Orderänderungen und -streichungen wegen Nebenrechten (auf Orderebene). Diese Mitteilungen werden wie Orderänderungen oder -streichungen, die über eine VALUES basierte Frontend-Applikation eingegeben wurden, interpretiert.
- INVESTRO:
- (1) Übermittlung / Protokollierung von INVESTRO Auftragsstreichungen an die empfangende Bank.
 - (2) Übermittlung / Protokollierung von INVESTRO Auftragsstreichungen, die über Terminal Eingaben durch die Bank in das System eingegeben wurden. Bei Auftragsstreichungen, die von INVESTRO an das Handelssystem Vestima+ übertragen wurden, erhält die Bank zunächst eine vorläufige Meldung (MT595). Nach der Antwort aus Vestima+ erhält die Bank eine endgültige Meldung, in der die Durchführung (MT595) bzw. die Ablehnung (MT596) der Auftragsstreichung mitgeteilt wird.
- MAX-ONE:
- (1) Übermittlung / Protokollierung aller Orderänderungen und -streichungen, die über Terminal Eingaben durch die Bank oder über eine Frontend-Applikation in das System eingegeben wurden.
 - (2) Mitteilung von Orderstreichungen wegen Nebenrechten (auf Orderebene).
 - (3) Mitteilung von Orderstreichungen wegen Befristung.
 - (4) Mitteilung aller Orderstreichungen, die „on behalf“ für den Teilnehmer (z.B. von dem Handels-Supervisor) eingegeben wurden.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

0	79:	Bezeichnungen und neue Inhalte der zu ändernden Felder (gleiche Abbildung wie in der ursprünglichen Nachricht, d.h. Feldetikett immer am Anfang einer neuen Zeile und gleiche Reihenfolge der Feldetiketten). Bei Xetra gelten zum Teil besondere Regeln bezüglich der Feldbelegungen.	35*50x
---	-----	---	--------

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Regeln:

Feld 11 (Nachrichtentyp bzw. Datum der ursprünglichen Nachricht):

Diese Felder sind wie folgt zu belegen:

- Nachrichtentyp: 500, 501 bzw. 511
- Datum der urspr. Nachricht: Datum der Orderrückmeldung bzw. Tagesdatum.

Bei der Stornierung eines OTC-Trades-Reports sind diese Felder wie folgt zu belegen:

- Nachrichtentyp: 513
- Datum der urspr. Nachricht: Tagesdatum.

Feld 20 (Bankinterne Ordernummer bzw. Geschäftsnummer bzw. OTC-Trade-Report-Nummer):

XONTRO: Das Feld Bankinterne Ordernummer ist bei Orders eines Handelsteilnehmers in der Nachricht an die Abwicklungsbank nicht belegt.

Bei der Stornierung bzw. der Durchlieferung eines Direktgeschäfts ist das Feld 20 mit der 16stelligen Geschäftsnummer zu belegen.

Bei der Stornierung eines OTC-Trades-Reports ist das Feld 20 mit der 16stelligen OTCTrade-Report-Nummer zu belegen. INVESTRO: Das Feld Bankinterne Ordernummer ist nur beim Aufgeber des Auftrags belegt.

Feld 21 (Bezugsauftragsnummer):

Die DWZ-Ordernummer ist wie folgt aufgebaut:

- Stelle 1-6 (**6n**): Einstellungsdatum der Order im Handelssystem
- Stelle 7-13 (**7n**): 7-stellige laufende Nummer

Xetra: Die Xetra-Ordernummer enthält keinen Hinweis auf das Datum oder andere Attribute der Order.

MAX-ONE: Die Ordernummer des Handelssystems enthält keinen Hinweis auf das Datum oder andere Attribute der Order.

Feld 20 (Bankinterne Ordernummer bzw. Geschäftsnummer) /

Feld 21 (Bezugsauftragsnummer):

Bei Nachrichten von der Bank zum System genügt die Angabe eines der beiden Felder.

Bei Angabe beider Felder müssen diese Felder die gleiche Order innerhalb des Orderbestandes referenzieren. Ansonsten wird die Nachricht abgewiesen.

Bei der Stornierung bzw. der Durchlieferung eines Direktgeschäfts sowie bei der Stornierung eines OTC-Trade-Reports ist das Feld 20 Mussfeld. Eine Eingabe im Feld 21 wird ignoriert.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode):

Im Folgenden ist aufgeführt, welche Geschäftsvorfallcodes von welchem System unterstützt werden:

Code	Bedeutung
Bank an System:	
111	XONTRO: Orderänderung Xetra: Orderänderung MAX-ONE: Orderänderung
113	XONTRO: Orderstreichung Xetra: Orderstreichung INVESTRO: Auftragsstreichung MAX-ONE: Orderstreichung
114	XONTRO: Storno Direktgeschäft
115	XONTRO: Durchlieferung Direktgeschäft
116	XONTRO: Storno OTC-Trade-Report
System an Bank:	
041	XONTRO: Rückmeldung Orderänderung über Terminal Eingaben durch Bank Xetra: Rückmeldung Orderänderung über VALUES basierte Frontend-Applikation MAX-ONE: Rückmeldung Orderänderung über Terminal Eingaben oder Frontend-Applikation durch Bank
042	XONTRO: Rückmeldung Orderänderung über Terminal Eingaben durch Makler MAX-ONE: Rückmeldung Orderänderung über Frontend-Applikation durch Spezialist
043	XONTRO: Rückmeldung Orderstreichung über Terminal Eingaben durch Bank Xetra: Rückmeldung Orderstreichung über VALUES basierte Frontend-Applikation INVESTRO: Rückmeldung INVESTRO Auftragsstreichung über Terminal Eingaben durch Bank MAX-ONE: Rückmeldung Orderstreichung über Terminal Eingaben oder Frontend-Applikation durch Bank
044	XONTRO: Rückmeldung Orderstreichung über Terminal Eingaben durch Makler MAX-ONE: Rückmeldung Orderstreichung über Frontend-Applikation durch Spezialist
045	XONTRO: Order(teil)streichung von Kassaspitzen wegen Teilausführungen
046	XONTRO: Orderänderung wegen Nebenrecht

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Code	Bedeutung
047	XONTRO: Orderstreichung wegen Nebenrecht MAX-ONE: Orderstreichung wegen Nebenrecht
048	XONTRO: Zurückgestellte Änderung via Terminal (wegen Sperre) MAX-ONE: Zurückgestellte Änderung via Terminal oder Frontend-Applikation (wegen Preisauszeichnung) Xetra: Zurückgestellte Änderung durch VALUES basierte Frontend-Applikation (wegen Sperre)
049	XONTRO: Zurückgestellte Löschung via Terminal (wegen Sperre) MAX-ONE: Zurückgestellte Löschung via Terminal oder Frontend-Applikation (wegen Preisauszeichnung) Xetra: Zurückgestellte Löschung durch VALUES basierte Frontend-Applikation (wegen Sperre) INVESTRO/Vestima+: Zurückgestellte Löschung via Terminal an Vestima+ (wegen noch offener Bestätigung von Vestima+)
050	MAX-ONE: Orderstreichung wegen Befristung
051	XONTRO: Umwandlung einer Stop Order in Billigst / Bestens Xetra: Umwandlung einer Stop Order in Billigst / Bestens
052	Xetra: Umwandlung einer Stop-Limit in eine Limit Order
053	Xetra: Orderänderung „on behalf“ (z.B. durch Market Supervision) INVESTRO/Vestima+: Einstellung des Auftrages wurde von Vestima+-Depotbank (OHA) positiv bestätigt; siehe Feld 77A
054	XONTRO: Orderlöschung durch Systemverwalter (Superuser) Xetra: Orderlöschung „on behalf“ (z.B. durch Market Supervision) MAX-ONE: Orderlöschung „on behalf“ (z.B. durch Handels-Supervisor) INVESTRO/Vestima+: Auftragslöschung durch Vestima+-Depotbank (OHA)
055	Xetra: Mitteilung des nicht ausgeführten Teils einer FOK/IOC Order oder Market-to-Limit Order
056	Xetra: Änderung einer Stop-Limit Order
057	Xetra: Änderung einer Iceberg Order
058	Xetra: Änderung einer Market-to-Limit Order
060	XONTRO: Aktivierung einer EG-Order MAX-ONE:
061	XONTRO: Zurücksetzen einer aktivierten Order auf eine EG-Order
450	INVESTRO/Vestima+: Löschung von Vestima+ / OHA durchgeführt
451	INVESTRO/Vestima+: Löschung von Vestima+ / OHA abgelehnt (siehe Feld F:77A)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Code	Bedeutung
452	INVESTRO/Vestima+: Provision Check in Vestima+ negativ; der Auftrag bleibt offen, kann aber bis zu einem positiven Provision Check nicht ausgeführt werden (siehe Feld F:77A)
453	INVESTRO/Vestima+: Provision Check in Vestima+ positiv (siehe Feld F:77A)
454	INVESTRO/Vestima+: Bei Löschung über Dialog wurde der Eingang der Auftragslöschung von Vestima+ bestätigt. Die Löschung ist noch vorläufig, da sie noch vom OHA abgelehnt werden kann (siehe Feld F:77A)
543	INVESTRO: Rückmeldung der Auftragslöschung eines Auftrags für den Empfänger
641	XONTRO: Rückmeldung der Änderung einer Order eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank
643	XONTRO: Rückmeldung der Streichung einer Order eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank (auch wegen Befristung oder durch den Systemverwalter)
645	XONTRO: Rückmeldung der Order(teil)streichung von Kassaspitzen an die Abwicklungsbank (siehe auch GV-Code 045)
646	XONTRO: Änderung einer Order eines Handelsteilnehmers wegen Nebenrecht an die Abwicklungsbank
647	XONTRO: Streichung einer Order eines Handelsteilnehmers wegen Nebenrecht an die Abwicklungsbank
660	XONTRO: Aktivierung einer EG-Order eines Handelsteilnehmers an die Abwicklungsbank MAX-ONE:
661	XONTRO: Zurücksetzen einer aktivierten Order eines Handelsteilnehmers auf EG-Order; Nachricht an die Abwicklungsbank

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 111 Orderänderung):

Die zu ändernden Felder sind innerhalb von Feld F:79 anzugeben. In XONTRO, Xetra und MAX-ONE kann die bankinterne Ordernummer durch Angabe in Feld F:79 geändert werden. In Feld F:20 kann nur die bankinterne Ordernummer der zu ändernden Order angegeben werden.

INVESTRO: Eine Auftragsänderung ist nicht zulässig.

MAX-ONE: Bei einer Order, für die eine bankinterne Ordernummer vergeben wurde, kann die bankinterne Ordernummer nicht entfernt werden (Angabe von /NONREF in Feld F:79 Feld F:20 nicht erlaubt).

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 113 Orderstreichung):

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Nominale = 100

Die variable Order wird also reduziert um die
Nominale = 20 (Kassaspitze)

Die Bank erhält folgende Nachricht (MT595):

:20:4711
:21:9211010000001
:75:045
:50:XON
:11:500
921101
:79:35A:SHS20,
.....

(Feld F:79 enthält die Nominale, um die die variable Order gekürzt wird)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 046 / 047):

Informationen auf Orderebene werden generiert, wenn die Bank in ihrem **Benutzerprofile** folgende Einträge hat:

Orderbestandsänderung wegen Nebenrecht:	J (= MT551 - Ereignismitteilung)
Information auf Orderebene:	J

Xetra: Für Xetra werden diese GV-Codes nicht geliefert.

INVESTRO: Für INVESTRO werden diese GV-Codes nicht geliefert.

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 048 / 049):

Kann eine zurückgestellte Änderung/Löschung, die in XONTRO über Terminal bzw. in MAX-ONE über Terminal oder eine Frontend-Applikation eingestellt wurde, wegen zwischenzeitlicher Kursauszeichnung nicht durchgeführt werden, so wird kein MT595, sondern ein MT596 mit Geschäftsvorfallcode 315/325 und mit Fehlercode BC1520F (= Order bereits ausgeführt) geliefert.

Bei erfolgreicher Durchführung der zurückgestellten Änderung / Löschung wird ein MT595 mit GV-Code 041 bzw. 043 geliefert.

Bei zurückgestellter Änderung der bankinternen Ordernummer enthält Feld F:20 schon die neue bankinterne Ordernummer.

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 050):

MAX-ONE: Die Verarbeitung der Orderstreichungen wegen Befristung erfolgt im Anschluss an den fortlaufenden Handel (End-of-Day-Verarbeitung). Die Daten werden somit direkt am Tag der Orderlöschung den Kreditinstituten übermittelt.

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 051):

XONTRO: Die Umwandlung einer Stop Order in Billigst / Bestens wird der Bank über den GV-Code 051 mitgeteilt. Die Bank kann sich für den Erhalt der Nachricht in ihrem Benutzerprofile durch die BrainTrade GmbH freischalten lassen.

Xetra: Bei der Umwandlung einer Stop-Market Order in Billigst / Bestens wird in Xetra das Attribut „lastUpdateDat“ aktualisiert. Diese Änderung wird der Bank über den GV-Code 051 mitgeteilt.

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 052):

Xetra: Bei der Umwandlung einer Stop-Limit Order in eine Limit Order wird der Bank das umgesetzte Limit mitgeteilt.

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 053):

Xetra: Orderänderungen, die „on behalf“ erfolgen (z.B. durch die Market Supervision), werden der Bank per GV-Code 053 mitgeteilt.

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 054):

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

XONTRO: Orders eines Aufgebers können aufgrund eines außergewöhnlichen Ereignisses durch den Systemverwalter (Superuser) gelöscht werden. Diese Löschung wird der Bank per GV-Code 054 mitgeteilt.

Xetra: Orderlöschungen, die „on behalf“ erfolgen (z.B. durch die Market Supervision), werden der Bank per GV-Code 054 mitgeteilt.

MAX-ONE: Orderlöschungen, die „on behalf“ erfolgen (z.B. durch den Handels-Supervisor), werden der Bank per GV-Code 054 mitgeteilt.

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 055):

Xetra: Bei der Eingabe einer FOK / IOC Order sowohl über Xentric Order als auch über eine VALUES basierte Frontend-Applikation kann es zu einer Nichtausführung bzw. zu Teilausführungen kommen. Der nicht ausgeführte Teil der Order wird in einem solchen Fall im Feld F:79:35A (Stück oder Nennwert) unter Angabe des GV-Codes 055 der Bank mitgeteilt. Falls es zu Teilausführungen kommt (nur für IOC Orders relevant), werden Ausführungsbestätigungen (Nachrichtentyp MT519) an die Bank gesendet. Eine Beschreibung des Ablaufs bei Eingabe einer FOK / IOC Order findet sich im Abschnitt 3.2.11 Antwort (MT 596).

Bei der Eingabe einer Market-to-Limit Order über eine VALUES basierte Frontend-Applikation kann es auf Grund der Orderbuchsituation zu einer Löschung der Order kommen. Diese Löschung wird per GV-Code 055 mitgeteilt.

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 056):

Xetra: Die Änderung einer Stop-Market Order oder einer Stop-Limit Order über eine VALUES basierte Frontend-Applikation wird der Bank per GV-Code 056 mitgeteilt.

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 057):

Xetra: Die Änderung einer Iceberg Order über eine VALUES basierte Frontend-Applikation wird der Bank per GV-Code 057 mitgeteilt.

Feld 75 (Geschäftsvorfallcode = 058):

Xetra: Die Änderung einer Market-to-Limit Order über eine VALUES basierte Frontend-Applikation wird der Bank per GV-Code 058 mitgeteilt.

Feld 75 (Börsenplatz):

(lt. WM-Schlüssel GD621). Möglicher Wertebereich:

100 – Berlin	160 – Börse München
120 – Düsseldorf	170 – Stuttgart
130 – Frankfurt	183 – INVESTRO
140 – Hamburg	194 – Xetra Frankfurt
150 – Hannover	944 – Xetra Wien

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

XONTRO: Der Börsenplatz ist für den Storno bzw. für die Durchlieferung eines Bankdirektgeschäfts sowie für den Storno eines OTC-Trade-Reports ein Pflichtfeld. Der Börsenplatz muss dem Eingeber des Stornos bzw. der Durchlieferung im Feld 75 entsprechen. Der Storno bzw. die Durchlieferung eines Bankdirektgeschäfts ist nur an den im MT511 (Direktgeschäft) angegebenen Börsenplätzen (siehe Feld 31P) möglich.

Der Storno eines OTC-Trade-Reports ist nur an den im MT513 (OTC-Trade-Report) angegebenen Börsenplätzen (siehe Feld 31P) möglich.

INVESTRO: Der Börsenplatz ist ein Pflichtfeld, sowohl bei der Nachricht von der Bank zum System und der Nachricht vom System zur Bank.

Xetra: Der Börsenplatz ist ein Pflichtfeld, sowohl bei der Nachricht von der Bank zum System als auch bei der Nachricht vom System zur Bank.

Feld 75 (Stück oder Nennwert):

Bei den GV-Codes = 111 und 113 kann als Ergänzung dieses Feld (aktueller Wert, der dem Teilnehmer bekannt ist) mit angegeben werden. Die Orderänderung bzw. die Orderstreichung wird abgelehnt, falls die aktuell gültige Stückzahl / Nominale der Order in XONTRO, Xetra (nur bei der Orderänderung) bzw. MAX-ONE ungleich diesem Feld ist.

Die Ablehnung erfolgt mit Fehlercode:

XONTRO:	BC5120F
Xetra:	XA2010F
MAX-ONE:	BC5120F

Wird dieses Feld nicht angegeben, werden die entsprechenden Aktionen ohne Prüfung der Stückzahl / Nominale generell durchgeführt.

Beim GV-Code = 116 wird dieses Feld nicht geprüft.

Xetra: Falls eine Änderung der aktuell gültigen Stückzahl / Nominale gewünscht wird, so kann dieses durch Angabe des Feldes F:79:35A erreicht werden.

Xetra: Für Xetra wird das Feld aktuell gültige Stückzahl / Nominale nur bei einer Änderung (GV-Code 111) geprüft. Bei einer Orderstreichung (GV-Code 113) wird ein Eintrag in diesem Feld ignoriert. Es wird empfohlen, das Feld bei Orderänderungen zu füllen, insbesondere dann, wenn das Attribut "lastUpdateDat" nicht gefüllt wird.

INVESTRO: Bei GV-Code 113 darf das Etikett 75 Feld Stück / Nominale nicht belegt sein. Ist das Feld belegt, wird die Auftragsstreichung mit Fehlercode BC0210F abgelehnt.

Feld 75 (Orderaufgeber / Eingeber des Stornos bzw. der Durchlieferung bzw. des Stornos eines OTC-Trade-Reports):

Falls bei Banken mit zentraler Anbindung die CBF-Konto-Nr. des Orderaufgebers von der CBF-Konto-Nr. der Zentrale abweicht, muss dieses Feld bei Nachrichten von der Bank

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

zum System mitgeliefert werden. Bei Nachrichten von dem System zur Bank ist das Feld generell belegt.

Empfehlung: Das Feld sollte von Banken generell gepflegt werden (auch für Banken mit dezentraler Anbindung).

XONTRO: Der Eingabe ist für den Storno bzw. für die Durchlieferung eines Direktgeschäfts sowie für den Storno eines OTC-Trade-Reports ein Pflichtfeld. Der Eingabe muss dem Börsenplatz im Feld 75 entsprechen.

XONTRO: (System an Bank) Beim Datensatz an die Abwicklungsbank (GV-Code 641/643/645/646/647) wird hier die CBF-Konto-Nr. des Handelsteilnehmers hinterlegt.

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 543) wird hier die CBF-Konto-Nr. des Auftraggebers hinterlegt.

Feld 75 (ID-KZ bei Terminaleingabe / VALUES basierte Frontend-Applikation):

XONTRO: (System an Bank) Beim Datensatz an die Abwicklungsbank (GV-Code 641/643/645/646/647) wird das Feld nicht belegt.

Xetra: Das ID-KZ enthält die letzten sechs Stellen der Orderrouting Trader-ID.

INVESTRO: (System an Bank) Beim Datensatz für den Empfänger eines Auftrags (GV-Code 543) wird das Feld nicht belegt.

Feld 75 (Einstellungszeit der Nachricht):

Die Einstellungszeit enthält die Uhrzeit des Eingangs in das System.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 75 (Art des Nebenrechts):

Bei Orderänderung/-löschung wegen Nebenrechten (GV-Code 046/047) wird die Art des Nebenrechts mitgeliefert (siehe auch MT551). Bei Orderlöschung wegen Kursaussetzung wird "AUSG", bei Orderlöschung wegen Auslösung wird "ZG" als Schlüsselwert geliefert.

MAX-ONE: In MAX-ONE kann es weitere Ausprägungen geben.

Feld 50 (Kennzeichnung des Handelssystems):

Das Feld ist gefüllt bei Nachrichten *System an Bank*.

Bei Nachrichten *Bank an System* wird das Feld ignoriert.

Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen aufgeführt:

Feldinhalt	Bedeutung
XON	Xontro
MAX	MAX-ONE
INV	Investro
XET	Xetra Frankfurt
FF2	Xetra Frankfurt 2

Feld 60 (RegulatoryID):

XONTRO, MAX-ONE:

Bei Nachrichten *Bank an System* enthält das Feld die Nummer des Algorithmus, auf Basis dessen die Order geändert oder gelöscht wurde. Das Feld ist kein Order-Attribut, sondern ein Identifier einer Order-Transaktion.

Gültig sind nur numerische Werte von 1 bis 4294967294.

Bei Nachrichten *System an Bank* wird das Feld nicht geliefert.

Investro: Das Feld wird ignoriert.

Xetra: Das Feld wird ignoriert.

Feld 77A (freier Text):

Bei Nachrichten von Banken zum System:

Bei Bedarf können hier Änderungen / Löschungen referenziert werden; der hier angegebene Text wird unverändert vom System in die Rückmeldung (MT596) eingestellt.

Bei Nachrichten vom System an die Banken:

Xetra:

Das Feld F:77A wird bei endgültig positiven Bestätigungen folgendermaßen verwendet:

Stelle 1:	Transaktionstyp [<u>l</u> x]; entspricht dem Xetra-Feld trnTypId
Stelle 2:	Konstante [Q] (für Quantity)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Stelle 3 bis 15:	Nominale [+12n] die letzten 3 Stellen sind die Nachkommastellen; entspricht dem Xetra-Feld ordrQty
Stelle 16:	Konstante [E] (für executed Quantity)
Stelle 17 bis 29:	ausgeführte Nominale [+12n]; die letzten 3 Stellen sind die Nachkommastellen, entspricht dem Xetra-Feld ordrExeQty

INVESTRO/Vestima+:

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Das Feld F:77A wird bei Statusänderungen aus Vestima+ folgendermaßen verwendet:

Bei GV-Code	Feldinhalt
053:	Konstante EINSTELLUNG BEI OHA
054:	Text aus Nachricht von Vestima+
451	Text aus Nachricht von Vestima+
452	Konstante PROVISION CHECK
453	Konstante PROVISION CHECK
454	Konstante LOESCHUNG VON VESTIMA EMPFANGEN (nur bei Löschung über Dialog)

Übrige Systeme:

Das Feld 77A ist nicht belegt.

Feld 79 (Bezeichnungen und Inhalte):

XONTRO:

Für den Storno bzw. die Durchlieferung eines Geschäfts sowie für den Storno eines OTC-Trade-Reports muss die ISIN in der 1. Zeile des Feldes F:79:35B belegt werden.

Xetra:

Für Nachrichten an Xetra sind die nachfolgenden Besonderheiten zu beachten:

Die Eingabe der ISIN ist in Xetra sowohl für Orderänderungen als auch für Orderlöschungen eine Pflichteingabe.

Da die ISIN in der 1. Zeile des Feldes F:79:35B angegeben werden muss, ist gemäß S.W.I.F.T.-Konventionen auch die 2. Zeile (Wertpapierkurzbezeichnung) zu füllen. Ferner sollte in der 3. Zeile des Feldes F:79:35B das Attribut "lastUpdateDat" mit angegeben werden.

Für die Löschung einer Stop Order in Xetra ist im Feld F:79:32L der Limitzusatz ein Pflichtfeld.

Bei der Änderung von Attributen des Feldes F:79:32L (z.B. Preis-/Kurslimit) ist bei Stop Orders, Market-to-Limit Orders, Iceberg Orders und Midpoint Orders der Limitzusatz ebenfalls ein Pflichtfeld. Dies gilt für Market-to-Limit Orders, Iceberg Orders und Midpoint Orders immer, für Stop Orders nur bis zu ihrer Umsetzung in eine Market oder Limit Order (MT595, GV-Codes 051, 052). Bei umgesetzten Stop Orders darf der Limitzusatz nicht mehr belegt werden.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Die übrigen Pflichtfelder der 1. und 2. Zeile des Feldes F:79:32L sind gemäß S.W.I.F.T.-Konventionen zu belegen.

Bei Änderungen bzw. Löschung der Order über eine VALUES basierte Frontend-Applikation wird unter Umständen eine neue Xetra-Ordernummer vergeben. Diese neue Xetra-Ordernummer wird im Feld F:79:20 mitgeteilt (DWZnnnnnnnnnnnn).

Tabellarische Darstellung der Feldinhalte F:20 (bankinterne Ordernummer), F:21 (Xetra-Ordernummer) und F:79:20 bei der Änderung bzw. Löschung einer Order über eine VALUES basierte Frontend-Applikation:

Änderung	F:20 (BI-Ordernr.)	F:21 (Xetra-Order-Nr.)	F:79:20
Keine Änderung der bankinternen oder der Xetra-Ordernummer	Aktuell gültige bankinterne Ordernummer	Aktuell gültige Xetra-Ordernummer zur Referenzierung	Aktuell gültige bankinterne Ordernummer
Nur Änderung der bankinternen Ordernummer	Aktuell gültige bankinterne Ordernummer	Aktuell gültige Xetra-Ordernummer zur Referenzierung	Aktuell gültige bankinterne Ordernummer
Nur Änderung der Xetra-Ordernummer	Aktuell gültige bankinterne Ordernummer	Alte Xetra-Ordernummer zur Referenzierung beim Teilnehmer	Neue Xetra-Ordernummer (DWZnnnnnnnnnnnn).
Änderung der bankinternen und der Xetra-Ordernummer	Aktuell gültige bankinterne Ordernummer	Alte Xetra-Ordernummer zur Referenzierung beim Teilnehmer	Neue Xetra-Ordernummer (DWZnnnnnnnnnnnn).

Löschung	F:20 (BI-Ordernr.)	F:21 (Xetra-Order-Nr.)	F:79:20
Löschung ohne Änderung der Xetra-Ordernummer	Aktuell gültige bankinterne Ordernummer	Aktuell gültige Xetra-Ordernummer zur Referenzierung	Aktuell gültige bankinterne Ordernummer
Löschung mit Änderung der Xetra-Ordernummer	Aktuell gültige bankinterne Ordernummer	Alte Xetra-Ordernummer zur Referenzierung beim Teilnehmer	Neue Xetra-Ordernummer (DWZnnnnnnnnnnnn).

MAX-ONE:

Für Nachrichten an MAX-ONE sind die nachfolgenden Besonderheiten zu beachten:

Die Löschung einer vergebenen bankinternen Ordernummer ist nicht möglich. Die Ablehnung erfolgt mit dem Fehlercode BC9630F.

Bei der Änderung von Attributen des Feldes F:79:32L (z.B. Preis-/Kurslimit) ist bei Stop-Market Orders der Limitzusatz Pflichtfeld. Andernfalls wird in MAX-ONE eine Stop-Market Order in eine Stop-Limit Order geändert.

Ist die Stop-Market Order bereits in eine Market Order umgesetzt und wird der Limitzusatz geliefert, wird die Änderung mit Fehlercode BC9600F abgelehnt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 79 (Unterfeld 23 / automatische Lieferfreigabe):

Das Feld wird für alle Handelssysteme ignoriert. Demzufolge steht beim MT595 die Resend-Funktionalität **nicht** zur Verfügung.

Feld 79 (Unterfeld 23 / KZ-Eigengeschäft):

Xetra: (Bank an System) Eine Änderung des Attributes KZ-Eigengeschäft im Feld F:79:23 ist nicht möglich. Die Belegung des KZ-Eigengeschäft ist bei Orderänderungen oder -löschungen für Agent-Orders (Ausprägung „A1“) optional. Für alle anderen Ausprägungen ist das KZ-Eigengeschäft ein Pflichtfeld.

Feld 79 (Unterfeld 32L / Handelshinweis):

Xetra:

Für den Inhalt des Attributes Handelshinweis im Feld F:79:32L gilt bei der Vornahme von Änderungen folgendes:

1. (Bank an System) Um eine Order mit Trading Restriction auf den Defaultwert gemäß Xetra Marktmodell zu ändern, muss der Schlüsselwert „CT“ eingegeben werden.
2. (System an Bank) Bei der Mitteilung einer Orderänderung (z.B. bei Eingabe über eine VALUES basierte Frontend-Applikation) von System an Bank wird für Orders ohne Trading Restriction der Schlüsselwert „CT“ mitgeteilt.

Der Schlüsselwert „CT“ für das Attribut Handelshinweis ist für alle anderen Nachrichtentypen (z.B.: MT500, MT501, MT519) nicht zulässig.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.11 Antwort (MT 596)

Urheber: Systeme XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE

- XONTRO:
- (1) Rückmeldung (Bestätigungen und Fehlermeldungen) von Ordereinstellungen, Orderänderungen und Orderlöschungen für maschinell übermittelte Aufträge.
Für Orders, deren Orderbuch wegen einer laufenden Kursfeststellung gesperrt ist, erfolgt zunächst eine entsprechende Meldung. Die Einstellung, Änderung oder Löschung der Order wird im System vorgetragen und nach Entsperrern des Orderbuchs automatisch verarbeitet. Die Bank erhält eine weitere Meldung (MT596), in der die Orderannahme bzw. Ablehnung (Order bereits ausgeführt; Kassakurs festgestellt bei tagesgültiger Order; etc.) inkl. Uhrzeit der definitiven Annahme / Ablehnung mitgeteilt wird.
Für EG-Orders (ereignisgesteuerte Orders) erhält die Bank bei der Einstellung zunächst eine vorläufige Meldung (MT596 / GV-Code 302). Nach der Bestätigung durch den Skontroführer / QLP (Quality-Liquidity-Provider) erhält sie eine weitere Meldung für die endgültige Annahme bzw. Ablehnung (MT596 mit GV-Code 300 bzw. 305).
 - (2) Bei Übermittlung von Orders, die über Terminal Eingaben in das System gelangten und bei Übermittlung des gesamten Orderbestandes zu Kontrollzwecken wird in Ergänzung zu MT500/MT501 ein MT596 als Folgesatz gesandt, um die DWZ-Ordernummer der Bank mitzuteilen (nur falls bankinterne Ordernummer vorhanden). Die Verknüpfung zu MT500/MT501 erfolgt über Feld F:20 (bankinterne Ordernummer).
 - (3) Rückmeldung (Bestätigungen und Fehlermeldungen) für maschinell übermittelte Bankdirektgeschäfte.
 - (4) Rückmeldung (Bestätigungen und Fehlermeldungen) für maschinell übermittelte Stornierungen bzw. Durchlieferungen von Bankdirektgeschäften.
 - (5) Rückmeldung (Bestätigungen und Fehlermeldungen) für maschinell übermittelte OTC-Trade-Reports (MT513).
 - (6) Rückmeldung (Bestätigungen und Fehlermeldungen) für maschinell übermittelte Stornierungen von OTC-Trade-Reports.

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

- Xetra:
- (1) Für Orders, die über die Order-Management-Systeme der Kreditinstitute eingestellt, geändert oder gelöscht werden und via Orderrountingsystem zu Xetra weitergeleitet worden sind, werden Rückmeldungen (Bestätigungen und Fehlermeldungen) erstellt. Hierfür wird der Nachrichtentyp MT596 verwendet.

Ordernachrichten können während verschiedener Handelsphasen in Xetra (z.B. Marktausgleichsphase) sowie morgens außerhalb der Xetra Orderannahmezeit vom System mit GV-Code 3n2 vorläufig bestätigt werden. In dieser Bestätigung ist beim Orderzugang die Xetra Ordernummer nicht gefüllt. Bei Orderannahme durch Xetra wird eine endgültige Bestätigung (Annahme mit Angabe der Xetra Ordernummer bzw. Ablehnung) übermittelt.
 - (2) Bei Übermittlung von Orders, die über Eingaben in VALUES basierten Frontend-Applikationen in das System gelangten, wird in Ergänzung zu MT500 / MT501 ein MT596 als Folgesatz gesandt, um die Xetra-Ordernummer der Bank mitzuteilen (nur falls bankinterne Ordernummer vorhanden). Die Verknüpfung zu MT500/MT501 erfolgt über Feld F:20 (bankinterne Ordernummer).
- INVESTRO:
- (1) Rückmeldung (Bestätigungen und Fehlermeldungen) von INVESTRO Auftragseinstellungen und Auftragslöschungen für maschinell übermittelte Aufträge.

Für Auftragseinstellungen und Auftragslöschungen, die von INVESTRO an das Handelssystem Vestima+ übertragen wurden, erhält die Bank zunächst eine vorläufige Meldung (MT596). Nach der Antwort aus Vestima+ erhält die Bank eine Meldung (MT596), in der die Annahme oder Ablehnung der Auftragseinstellung oder Auftragslöschung in Vestima+ mitgeteilt wird. Für Auftragslöschungen erhält die Bank anschließend eine Statusmitteilung (MT595) über die Durchführung oder Ablehnung der Auftragslöschung durch die Vestima+-Depotbank (OHA).
 - (2) Bei Übermittlung von INVESTRO Aufträgen, die über Terminal Eingaben in das System gelangten und bei Übermittlung des gesamten Auftragsbestandes zu Kontrollzwecken wird in Ergänzung zu MT500/MT501 ein MT596 als Folgesatz gesandt, um die DWZ-Ordernummer der Bank mitzuteilen (nur falls bankinterne Ordernummer vorhanden). Die Verknüpfung zu MT500/MT501 erfolgt über Feld F:20 (bankinterne Ordernummer).
- MAX-ONE:
- (1) Rückmeldung (Bestätigungen und Fehlermeldungen) von Ordereinstellungen, Orderänderungen und Orderlöschungen für maschinell übermittelte Aufträge.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Für Orders, die während einer Orderbuchsperrung in MAX-ONE (Zeitraum zwischen Preisfeststellung und Ausführung der Orders) vorgemerkt werden, erfolgt zunächst eine entsprechende Meldung. Die Einstellung, Änderung oder Löschung der Order wird im System vorgetragen und nach der Orderbuchsperrung automatisch verarbeitet.

Die Bank erhält eine endgültige Meldung (MT596), in der die Orderannahme bzw. Ablehnung (Order bereits ausgeführt; etc.) inkl. Uhrzeit der definitiven Annahme / Ablehnung mitgeteilt wird.

- (2) Bei Übermittlung von Orders, die über Bankterminal oder eine Frontend-Applikation in das System gelangten und bei Übermittlung des gesamten Orderbestandes zu Kontrollzwecken wird in Ergänzung zu MT500/MT501 ein MT596 als Folgesatz gesandt, um die Ordernummer des Handelssystems der Bank mitzuteilen (nur falls bankinterne Ordernummer vorhanden). Die Verknüpfung zu MT500/MT501 erfolgt über Feld F:20 (bankinterne Ordernummer).

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Bestätigungen von OTC-Trade-Reports enthalten im Feld 20 des MT596 entweder die im MT513 im Feld 20 gelieferte bankinterne OTC-Trade-Report-Nummer oder den Wert "0000000000000". Bestätigungen von Stornos von OTC-Trade-Report enthalten immer den Wert „000000000000“. Die OTC-Trade-Report-Nummer wird im Feld 21 übermittelt.

Xetra:

Die Xetra-Ordernummer enthält keinen Hinweis auf das Datum oder andere Attribute der Order.

Xetra vergibt bei bestimmten Änderungen und Löschungen eine neue Ordernummer. In diesen Fällen enthält Feld F:20 die alte Ordernummer und Feld F:76 die neue Ordernummer.

Bei einer Orderänderung/-löschung (MT595), die nur über die bankinterne Ordernummer (Feld F:20) referenziert wurde, und die abgelehnt wird, enthält das Feld F:20 im MT596 den Wert "0000000000000".

Bei einer Ordereinstellung, die vorläufig bestätigt wird (z.B. während der Marktausgleichsphase), enthält das Feld F:20 im MT596 den Wert "0000000000000".

MAX-ONE: Die Ordernummer des Handelssystems enthält keinen Hinweis auf das Datum oder andere Attribute der Order.

Feld 21 (Bezugsauftragsnummer (Bankinterne Ordernummer) bzw. Geschäftsnummer / OTC-Trade-Report-Nummer):

Das Feld enthält bei Ordernachrichten die bankinterne Ordernummer.

Bei Bankdirektgeschäften wird das Feld für die Übermittlung der 16stelligen Geschäftsnummer, bei OTC-Trade-Reports für die Übermittlung der 16stelligen OTC-Trade-Report-Nummern genutzt.

Die Geschäftsnummer bzw. OTC-Trade-Report-Nummer ist wie folgt aufgebaut:

Stelle 1-3 **(3x)**: Börsenplatz

Stelle 4-9 **(6n)**: Börsentag im Format JJMMTT

Stelle 10-16 **(7n)**: laufende Nummer

(bei einer negativen Bestätigung ist das Feld mit /NONREF belegt)

Xetra: Bei einer Änderung der bankinternen Ordernummer wird im Gegensatz zu XONTRO in diesem Feld die neue und nicht die alte bankinterne Ordernummer geliefert.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 76 (Codenummer):

Im Folgenden ist aufgeführt, welche Codenummern von welchem System unterstützt werden:

Codenummer	Bedeutung
/000	Alle Systeme: Folgesatz zu MT500/MT501
/3n0	Alle Systeme: Anforderung fehlerfrei durchgeführt
/3n1	Alle Systeme: Konvertierungsfehler (Anforderung wurde nicht durchgeführt)
/3n2	<p>XONTRO: Die Anforderung wird wegen aktuellem Verarbeitungsstatus (Orderbuchsperrung) zurückgestellt. Nach Änderung des Verarbeitungsstatus erfolgt automatisch durch XONTRO ein erneuter Versuch unter Erzeugung einer weiteren Rückmeldung (MT596).</p> <p>Xetra: Die Anforderung wird wegen aktuellem Verarbeitungsstatus (z.B. Xetra ist zum Zeitpunkt der Orderübermittlung noch nicht verfügbar) zurückgestellt. Nach Änderung des Verarbeitungsstatus wird eine weitere Rückmeldung (MT596) erzeugt. Zum Zeitpunkt der Tagesendeverarbeitung noch zurückgestellte Orders werden abgelehnt (MT596).</p> <p>MAX-ONE: Die Anforderung wird wegen aktuellem Verarbeitungsstatus (Preisauszeichnung) zurückgestellt. Nach Änderung des Verarbeitungsstatus erfolgt automatisch durch MAX-ONE ein erneuter Versuch unter Erzeugung einer weiteren Rückmeldung (MT596).</p> <p>INVESTRO/Vestima+: vorläufiger Auftragseingang bzw. Auftragslöschung, die von Investro an Vestima+ übertragen wurde, aber noch nicht von Vestima+ bestätigt wurde</p>
/3n3	Alle Systeme: Order nicht gefunden
/3n4	Alle Systeme: Order bereits vorhanden
/3n5	Alle Systeme: Dateninhalte führten zu Fehler
/3n6	<p>XONTRO: Anforderung nicht durchgeführt; Funktionen sind z.Z. gesperrt</p> <p>INVESTRO: Anforderung nicht durchgeführt; Funktionen sind z.Z. gesperrt</p>
/307	<p>XONTRO: Zugang fehlerfrei durchgeführt, gültig ab Folgetag</p> <p>INVESTRO: Zugang fehlerfrei durchgeführt, gültig ab Folgetag</p> <p>MAX-ONE: Zugang fehlerfrei durchgeführt, gültig ab Folgetag</p>
/308	<p>XONTRO: OTC-Trade-Report eingestellt; Preis auffällig</p> <p>INVESTRO: Kauf zum Rücknahmepreis</p>
/309	<p>XONTRO: Zeichnungsauftrag eingestellt</p> <p>INVESTRO: Kauf zum Rücknahmepreis, gültig ab Folgetag</p>
/406	XONTRO: Fondssegment, Gültigkeit angepasst.
/407	XONTRO: Fondssegment, Gültigkeit angepasst. Gültig ab Folgetag.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Codenummer	Bedeutung
/422	INVESTRO/Vestima+: Eingang der Auftragslöschung von Vestima+ bestätigt. Die Löschung ist vorläufig, da sie noch vom OHA abgelehnt werden kann
n =	0 Zugang 1 Änderung / Durchlieferung 2 Streichung / Storno

XONTRO:

Die Codenummer /302 bedeutet bei einer EG-Order eine „vorläufige Einstellung“, d.h. die Order muss noch durch den Skontroführer bzw. QLP bestätigt werden.

Die Codenummer /312 bzw /322 bedeutet bei der Fehlermeldung BC7650F, dass eine Orderänderung bzw. -löschung logisch bereits endgültig, aber aus technischen Gründen vorübergehend zurückgestellt ist. Die endgültigen Bestätigungen mit Codenummer /310 bzw. /320 folgen.

INVESTRO:

Die Codenummer /308 bzw. /309 wird gesetzt, wenn keine Geschäftsartausprägung geliefert wird, jedoch ein 'R' in der Konditionstabelle hinterlegt ist.

Xetra:

Abfolge der erzeugten Nachrichtentypen (System an Bank) bei einer Eingabe einer FOK / IOC Order bzw. Midpoint-FOK / Midpoint-IOC Order über Xentric Order oder eine VALUES basierte Frontend-Applikation:

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Order	Ergebnis	Xentric Order	Frontend-Applikation
FOK:	1. Ausführung	MT596 (GV-Code 300)	MT500 / MT501 und evtl. der Folgesatz MT596 Eine bis n Ausführungsbestätigungen (MT519)
	2. Ablehnung	MT596 (GV-Code 300)	MT500 / MT501 und evtl. der Folgesatz MT596 Orderlöschungsmitteilung MT595 (GV-Code 055)
IOC:	1. Ausführung	MT596 (GV-Code 300)	MT500 / MT501 und evtl. der Folgesatz MT596 Eine bis n Ausführungsbestätigungen (MT519)
	2. Ablehnung	MT596 (GV-Code 300)	MT500 / MT501 und evtl. der Folgesatz MT596 Orderlöschungsmitteilung MT595 (GV-Code 055)
	3. Teilausführung	MT596 (GV-Code 300)	MT500 / MT501 und evtl. der Folgesatz MT596 Orderteillöschungsmitteilung MT595 (GV-Code 055) über den gelöschten Teil Eine bis n Ausführungsbestätigungen (MT519)

Xetra:

Abfolge der erzeugten Nachrichtentypen (System an Bank) bei der Änderung einer Order in eine FOK / IOC Order bzw. Midpoint-FOK / Midpoint-IOC Order über Xentric Order oder eine VALUES basierte Frontend-Applikation (analog zur Ordereingabe):

Order	Ergebnis	Xentric Order	Frontend-Applikation
FOK:	1. Ausführung	MT596 (GV-Code 310)	MT595 Eine bis n Ausführungsbestätigungen (MT519)
	2. Ablehnung	MT596 (GV-Code 310)	MT595 Orderlöschungsmitteilung MT595 (GV-Code 055)
IOC:	1. Ausführung	MT596 (GV-Code 310)	MT595 Eine bis n Ausführungsbestätigungen (MT519)
	2. Ablehnung	MT596 (GV-Code 310)	MT595 Orderlöschungsmitteilung MT595 (GV-Code 055)
	3. Teilausführung	MT596 (GV-Code 310)	MT595 Orderteillöschungsmitteilung MT595 (GV-Code 055) über den gelöschten Teil Eine bis n Ausführungsbestätigungen (MT519)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 76 (Xetra-Ordernummer neu):

Xetra vergibt z.B. bei Limitänderung, Änderung der Gültigkeit oder Erhöhung der Nominale eine neue Ordernummer. In diesem Fall transferiert Xetra die alte und die neue Ordernummer.

Feld 76 (Geschäftsnummer neu):

Bei der Durchlieferung eines Bankdirektgeschäfts wird die neue Geschäftsnummer in diesem Feld übermittelt.

Feld 76 / 2. Zeile (Versionsnummer lastUpdateDat):

Xetra: Xetra transferiert bei einer erfolgreichen Ordereingabe oder -modifikation die aktuelle Versionsnummer (lastUpdateDat). Diese Versionsnummer sollte für zukünftige Ordermodifikationen verwendet werden.

Feld 50 (Kennzeichnung des Handelssystems):

Im Folgenden sind die verschiedenen Ausprägungen aufgeführt:

Feldinhalt	Bedeutung
XON	Xontro
MAX	MAX-ONE
INV	Investro
XET	Xetra Frankfurt
FF2	Xetra Frankfurt 2
OTC	Antwort auf MT511 sowie auf MT595 GV-Code 114 / 115
MIF	Antwort auf MT513 sowie auf MT595 GV-Code 116

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feld 77A (freier Text):

XONTRO:

Bei einer Antwort auf einen MT595 wird das Feld aus dem MT595 übernommen.

Xetra:

Das Feld F:77A wird bei endgültig positiven Antworten folgendermaßen verwendet:

Stelle 1:	Transaktionstyp [<u>1</u> x]; entspricht dem Xetra-Feld trnTypId
Stelle 2:	Konstante [Q] (für Quantity)
Stelle 3 bis 15:	Nominale [<u>+12</u> n] die letzten 3 Stellen sind die Nachkommastellen; entspricht dem Xetra-Feld ordrQty
Stelle 16:	Konstante [E] (für executed Quantity)
Stelle 17 bis 29:	ausgeführte Nominale [<u>+12</u> n]; die letzten 3 Stellen sind die Nachkommastellen, entspricht dem Xetra-Feld ordrExeQty

INVESTRO/Vestima+:

Das Feld F:77A hat folgenden Inhalt, wenn Vestima+ einen Löschauftrag der Bank ablehnt:

Bei GV-Code	Feldinhalt
325:	Text aus Antwort von Vestima+

Übrige Systeme:

Das Feld 77A ist nicht belegt.

Feld 11 (Nachrichtentyp):

Das Feld enthält den Nachrichtentyp, auf den die Eingabebestätigung referenziert.

Feld 79 / Fehlercode (Feldetikett):

Xetra: Die Angabe des Feldetiketts wird von Xetra nicht unterstützt. Stattdessen werden Leerzeichen geliefert.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.12 Übersicht über Felder und Systeme

In den folgenden tabellarischen Übersichten sind für Ordernachrichten alle Pflicht- und Kann-Felder je Handelssystem aufgeführt.

M = Feld ist für das Handelssystem Pflicht-Feld (Mandatory)

O = Feld ist für das Handelssystem Kann-Feld (Optional)

Hinweis: Die Belegungsregeln für den MT512/MT599 (Schlussnoten und Orderreferenzen) sind hier nicht aufgeführt. Diese sind der Darstellung des MT512/MT599 in der Schlussnoten-Datenträger-Beschreibung (separates Dokument) zu entnehmen.

3.2.12.1 MT 500 / MT 501 (Kauforder / Verkauforder)

Feldbezeichnung	Etikett	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
Bankinterne Ordernummer	20:	M	M	M	M
Geschäftsvorfallcode	23:	O	O	O	O
Geschäftsartergänzung	23:			O	
Automatische Lieferfreigabe	23:		O		
KZ-Eigengeschäft	23:	O	O		O
Netting Type / Netting Category	23:		O		
Order gültig bis (JJMMTT)	30:	M	M	M	M
Art des Wertpapiers	35A:	M	M	M	M
Stück oder Nennwert	35A:	M	M	M	M
Peak-Size-Qty	35A:		O		
Internationale Kenn-Nr.	35B:	M	M	M	M
Wertpapierkurzbezeichnung	35B:	M	M	M	M
Versionsnummer	35B:		O		
Währung der Notierung	32L:	M	M	M	M
Preis-/Kurslimit	32L:	M	M	M	M
Börsenplatz	32L:	M	M	M	M
Empfänger der Order	32L:	O		O	O

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feldbezeichnung	Etikett	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
Handelshinweis	32L:	0	0		0
Limitzusatz	32L:	0	0		0
exePrc-Stop-Order	32L:		0		0
exec-Id	32L:		0		
Order-/Auftragsaufgeber	82D:	0	0	0	0
CBF-Konto-Nr. der "wegen Bank"	83C:	0			
Kennzeichnung des Handelssystems	50:	0	0	0	0
RegulatoryID	60:	0			0
INVESTRO Vertriebspartner	53C:			0	
Spesen	71D:	0			
Provision	71D:	0			
freier Text	72:	0	0	0	0
ID-KZ bei Terminaleingabe / ID-KZ bei Frontend Eingabe	72:	0	0	0	0
Erstellungszeit der Nachricht	72:	0	0	0	0

3.2.12.2 MT 511 (Bankdirektgeschäft)

Feldbezeichnung	Etikett	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
Bankinterne OTC-Nummer	20:	0			0
Satzart	23:	M			M
Kennzeichen Börslich	23:	0			0
Börsenplatz	31P:	M			M
Abschlussdatum	31P:	0			0
Abschlussuhrzeit	31P:	0			0
(Abweichender) Schlusstag	31P:	0			0
Kennzeichen Festvaluta	31P:	0			0
Datum Festvaluta	31P:	0			0
Kennzeichen Emissionsgeschäft	31P:	0			0

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feldbezeichnung	Etikett	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
Zinstage	31P:	O			O
Diskonttage	31P:	O			O
Art des Wertpapiers	35A:	M			M
Nominale	35A:	M			M
Wertpapierkennnummer	35B:	M			M
Währung der Notierung	33T:	M			M
Kurs	33T:	M			M
Eingebener des Geschäfts	82D:	M			M
Kontrahent	82D:	M			M
Wiederanlagerabatt	71B:	O			O
Bonifikationssatz	71B:	O			O
Courtage	71C:	O			O
Kennzeichen Courtage	71C:	O			O
Spesen	71D:	O			O
Kennzeichen Provision	71D:	O			O
Provision	71D:	O			O
Text	72:	O			O
Devisenkurs	36:	O			O

3.2.12.3 MT 513 (OTC Trade Report)

Feldbezeichnung	Etikett	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
Bankinterne OTC-Trade-Report-Nummer	20:	O			O
Börsenplatz	31P:	M			M
Abschlussdatum	31P:	M			M
Abschlussuhrzeit	31P:	M			M
BIC des Melders	40:	M			M
Execution Venue ID	40:	M			M

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feldbezeichnung	Etikett	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
Abweichender Preis Indikator	40	O			O
Verhandelter Preis Indikator	40	O			O
Delay Indikator	40	O			O
Amendment	40	O			O
Einheit der Effektennotiz	40	O			O
Abweichung zu UTC mit Vorzeichen	40	O			O
Nominale	35A:	M			M
Wertpapierkennnummer	35B:	M			M
Währung zum Preis	33T:	M			M
Preis	33T:	M			M
Eingebener des Geschäfts	82D:	M			M

3.2.12.4 MT 515 (Ausführungsbestätigung für Fondauftrag)

Diese Nachricht ist nur relevant für INVESTRO/Vestima+. Nachrichtenaufbau siehe Kapitel 3.2.7.

3.2.12.5 MT 519 (Ausführungsbestätigung)

Feldbezeichnung	Etikett	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
Bezugsauftragsnummer	20:	M	M	M	M
Bankinterne Ordernummer	21:	M	M	M	M
Geschäftsart	23:	M	M	M	M
Kennzeichen börslich	23:	O	O	O	O
Ausführungstag	31P:	M	M	M	M
Börsenplatz	31P:	M	M	M	M
Handelshinweis	31P:	M	M	M	M
ausführender Makler/Kontrahent/Spezialist	31P:	M	M	M	M
Uhrzeit der Ausführung	31P:	M	M	M	M
Kurszusatz	31P:	O			O
Zinstage	31P:	O	O		O

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

Feldbezeichnung	Etikett	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
Art des Wertpapiers	35A:	M	M	M	M
Stück oder Nennwert	35A:	M	M	M	M
Rem-Peak-Qty	35A:		O		
Internationale Kenn-Nr.	35B:	M	M	M	M
Wertpapierkurzbezeichnung	35B:	M	M	M	M
Versionsnummer	35B:		O		
exec-Id	35B:		O		
exec-Flag	35B:		O		
Kennzeichnung des Handelssystems	50:	O	O	O	O
Währung der Notierung	33T:	M	M	M	M
Ausführungskurs	33T:	M	M	M	M
ID-KZ des Ordereingebers	72:	O	O	O	O
Vorzeichen Zwischengewinn	72:			O	
Vorzeichen akkumulierte Erträge	72:			O	
Ausgabeaufschlag	72:			O	
Bonisatz	72:			O	
Wiederanlagerabatt	72:			O	
Zwischengewinn	72:			O	
Ausgabepreis	72:			O	
Akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag	72:			O	

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.12.6 MT 595 (Änderung / Streichung / Storno / Durchlieferung)

Feldbezeichnung	Etikett	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
Bankinterne Ordernummer	20:	M/O	M/O	M/O	M/O
Bezugsauftragsnummer	21:	M/O	M/O	M/O	M/O
Geschäftsvorfallcode	75:	M	M	M	M
Art des Wertpapiers	75:	O	O	O	O
Prüfnominale	75:	O	O	O	O
Orderaufgeber	75:	M/O	O	O	M/O
Börsenplatz	75:	M/O	M	M	M/O
ID-KZ bei Terminaleingabe	75:	O	O	O	O
Erstellungszeit der Nachricht	75:	O	O	O	O
Art des Nebenrechts	75:	O			O
Kennzeichnung des Handelssystems	50:	O	O	O	O
RegulatoryID	60:	O			O
freier Text	77A:	O	O	O	O
Nachrichtentyp	11:	M	M	M	M
Datum der ursprünglichen Nachricht	11:	M	M	M	M
Bezeichnungen und neue Inhalte der zu ändernden Felder:	79:	M/O	M	O	O
– Internationale Kenn-Nr.	35B:	M/O	M		
– Wertpapierkurzbezeichnung	35B:	M/O	M		
– Versionsnummer	35B:	O	O		
weitere Besonderheiten siehe Beschreibung Feld 79					

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.12.7 MT 596 (Rückmeldung)

Feldbezeichnung	Etikett	XONTRO	Xetra	INVESTRO	MAX-ONE
Bezugsauftragsnummer	20:	M	M	M	M
Bankinterne Ordernummer	21:	M	M	M	M
Codenummer	76	M	M	M	M
Xetra-Ordernummer (neu)	76:		O		
Geschäftsnummer neu	76:	O			O
Erstellungszeit der Nachricht	76:	O	O	O	O
Versionsnummer	76:		O		
Kennzeichnung des Handelssystems	50:	O	O	O	O
freier Text	77A:	O	O	O	O
Nachrichtentyp	11:	M	M	M	M
Datum der ursprünglichen Nachricht	11:	M	M	M	M
Fehlercode	79:	O	O	O	O

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

3.2.13 Nachricht für eigene Anwendung (MT 598)

Urheber:	Benutzer (Bank) und Systeme (XONTRO, Xetra, INVESTRO und MAX-ONE)
Funktion:	Dieser Nachrichtentyp wird als Umschlag für die bereits definierten Nachrichtentypen MT000, MT001, MT002, MT003, MT020 und MT021 benutzt.

MT 598 Nachricht für eigene Anwendung			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
M	20:	Auftragsnummer (TRN)	<u>6</u> n <u>3</u> n
M	12:	Nachrichtentyp der in dieser Nachricht übermittelt wird	<u>3</u> n
M	77E:	Nachricht gemäß besonderer Beschreibung ohne Header und Trailer	73x [n*78x]

Regeln:**Feld 20:****Bei File-Transfer gilt folgendes Format: 6n3n**

Bei Übertragungen vom System zur Bank wird die Auftragsnummer jeweils in Vor- (Feld F:12 = 000) und Nachsatz (Feld F:12 = 002) eingestellt. Die Nummern in beiden Sätzen sind pro Stapel identisch.

Bei Programm/Programm-Verbindung gilt generell:

Bei allen Rückmeldungen / Bestätigungen wird im Feld F:20 die TRN aus der zugrunde liegenden Nachricht des Kreditinstituts eingestellt.

Die Auftragsnummer (TRN) ist wie folgt aufgebaut:

Stelle 1-6 (6n): Entstehungsdatum der Nachricht

Stelle 7-13 (3n): 7-stellige laufende Nummer (wird nicht geprüft)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

4 Fehlerhinweise

4.1 Fehler im Nachrichtenkopf / Formatfehler

H01	Formatfehler Block 1
H02	Anwendungskennzeichen nicht "F"
H15	falsche Session
H20	falsche Eingabefolgennummer (ISN)
H25	Formatfehler Block 2
H30	ungültiger Nachrichten-Typ
H50	keine Bestimmungsadresse
H99	Ungültiges Zeichen im Anwendungsheader
U00	Formatfehler Block 3
Z00	Formatfehler Block 5
010	von OSN/bis OSN nicht numerisch
011	Absender ist kein Orderrouting-Teilnehmer

4.2 Fehler in der Nachricht (Mnn)

M60	ungültiges Zeichen
-----	--------------------

4.3 Fehler im Text (Tnn)

T12	Fehler im Inhalt des Feldes
T13	Zwingend vorgeschriebenes Feld fehlt, Feldfolge unkorrekt
T16	Feldkennzeichen ohne Doppelpunkt; Buchstabe wurde an unerlaubter Stelle gefunden
T26	Feld darf nicht mit "/" beginnen oder mit "/" enden und ebenso darf kein "/" vorkommen
T30	im Feld wurden zu viele Komponenten vorgefunden
T31	Trennzeichen zwischen den Komponenten fehlt oder ist ungültig
T32	Zwingend vorgeschriebene Komponente fehlt
T33	Länge der Komponente zu groß
T34	Länge der Komponente zu klein
T37	Unterfeld 1 in Feld F:35A enthält ungültiges Codewort
T40	Betrag/Zahl fehlt oder erstes Zeichen ist falsch
T43	das Trennzeichen für Dezimalstellen ist kein Komma
T50	Datumsfehler
T52	Ungültige Art des Wertpapiers
T80	Trailer fehlt
T98	'end of message' falsch
T99	Innerhalb einer Nachricht befindet sich mehr als eine Ende-Sequenz (CrLf-)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

4.4 Plausibilitäts-Fehler (Cnn)

C03 Anzahl der Nachkommastellen größer als für das Feld maximal zugelassen

4.5 Retrieval-Kontingent-Fehler (Knn)

K01 Input-Kontingent für Retrieval-Anforderungen überschritten

K02 Output-Kontingent für Retrieval-Anforderungen überschritten

4.6 XONTRO - Fehlermeldungen / Hinweise

BC0000F Keine Berechtigung zu dieser Funktion
BC0010F Mussfeld fehlt
BC0020F Fehler bei Abhängigkeitsprüfung
BC0030F Feld muss gültigen Schlüsselwert enthalten
BC0040F Feld muss gültiges Datum enthalten
BC0050F Feld muss eine Gattung enthalten
BC0070F Feld muss numerisch sein
BC0090F Falsche Stellenzahl
BC0100F Feld enthält unzulässige Zeichen
BC0110F Gattung nicht vorhanden
BC0160F Feld nicht änderbar
BC0170F Limit nicht zulässig, da Geschäftsart fehlerhaft
BC0210F Feldeingabe nicht erlaubt
BC0220F Funktion z.Z. gesperrt
BC0260F Kontrahent ungültig
BC0330F Ungültige Eingabekombination
BC0340F Börsenplatz ungültig oder nicht zugelassen
BC0350F Aufgeber ungültig
BC0360F Wegen-Bank ungültig
BC0370F Empfänger ungültig
BC0400F Eingeber ungültig
BC0480F Nominale ist kleiner Kleinste-Handelbare-Einheit
BC0490F Handelshinweis und Nominale passen nicht zusammen
BC0500F Die Geschäftsnummer ist im Geschäftsbestand nicht vorhanden
BC0510F Das Geschäft wurde bereits durchgeliefert
BC0530F Die Gattung entspricht nicht der des Geschäfts
BC0540F Festvaluta nur taggleich stornierbar
BC0610F Gattung am entsprechenden Börsenplatz für XONTRO nicht zugelassen

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

BC0630F	Die Börse des Kontrahenten hat einen Feiertag
BC0650F	Gattung ist kursausgesetzt
BC0660F	Tagesgültige Splitorder nach Kassakurs eingegeben
BC0670F	Tagesgültige Kassaorder nach Kassakurs eingegeben
BC0680F	Tagesgültige Order zum ersten Kurs nach erstem Kurs eingegeben
BC0690F	Tagesgültige Order nach Orderannahmeschluss
BC0700F	Gültigkeit der Order überschreitet Endfälligkeit
BC0710F	Nur tagesgültig zulässig
BC0720F	Kein Handelshinweis erlaubt
BC0750F	Nur Handelshinweis KS zulässig
BC0760F	Limit ungültig
BC0780F	Limitzusatz nicht zulässig
BC0790F	Limitzusatz muss zu Geschäftsart passen
BC0810F	Nominale weicht von ausführbarer Nominale ab
BC0830F	Gattungs-Änderung/Löschung nicht zulässig
BC0840F	Orderänderung wegen Teilausführung nicht zulässig
BC0850F	Keine Berechtigung zur Orderänderung/Löschung
BC0860F	Provision/Spesen nur bei Wegen-Eingabe
BC0870F	Kompensation bei Wegen-Eingabe nicht erlaubt
BC0880F	Kassamarkt gesperrt zur Kursfeststellung
BC0890F	Variabler Markt gesperrt zur Kursfeststellung
BC0900F	Kurswert überschreitet zulässigen Grenzwert
BC0910F	Seriennummer nur bei Verkauf
BC0920F	Gattung ist keine gültige Seriennummer
BC0940F	Bankinterne Ordernummer nicht eindeutig
BC0990F	Abweichender Schlusstag nur in der Vergangenheit möglich
BC1140F	Kontostamm für Eingabe nicht ermittelbar
BC1150F	Kontostamm für Kontrahent nicht ermittelbar
BC1180F	Absender ist kein Orderrouting-Teilnehmer
BC1190F	Nominale ist größer als Ursprungsnominale
BC1210F	Ursprungsorder: Marktzugehörigkeit darf sich nicht ändern
BC1220F	Ungültiges Passwort
BC1230F	Passwort abgelaufen
BC1240F	Ungültiges neues Passwort
BC1250F	Ungültige User-ID
BC1260F	Ablaufdatum für User-ID überschritten
BC1270F	Freigabe der Berechtigung (durch Security-Beauftragten) fehlt
BC1280F	Ersterfassungs-Passwort vorhanden; Bitte ändern
BC1290F	Nominale ist fehlerhaft
BC1300F	Gattung fehlerhaft
BC1310F	Limitbetrag ist fehlerhaft
BC1320F	Limitzusatz ist fehlerhaft
BC1330F	Bank (LTERM) nicht angemeldet
BC1340F	Bank (LTERM) bereits angemeldet

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

BC1350F	Das Geschäft wurde bereits storniert
BC1390F	Temporäre Änderung 'Umfang Nachrichtenaustausch' von 'N' auf 'Y' nicht erlaubt
BC1400F	Anzahl der Vorkommastellen ist zu groß
BC1410F	Anzahl der Nachkommastellen ist zu groß
BC1460F	Empfänger in XONTRO nicht zugelassen
BC1500F	Keine Order zu bankinterner Ordnernummer vorhanden
BC1520F	Order ist bereits ausgeführt
BC1530F	Tagesgültige Order nach Schlusskurs eingegeben
BC1680F	Gattung ist an entsprechender Börse nicht notiert
BC1690F	Geschäftsart ungültig
BC1790F	PUEV Geschäfte sind nicht erlaubt
BC1810F	Kontrahent nicht zugelassen
BC1890F	Eingegebenes Datum ist kein gültiges Kalenderdatum
BC1940F	Empfänger muss INVESTRO-Teilnehmer sein
BC1950F	Satz mit ungültigem Messagetype
BC1970F	Änderung/Löschung für Order, die nicht änderbar ist
BC1980F	Löschung für Order, die nicht mehr aktiv ist
BC1990F	Nachricht von Bank wurde nicht über Sende-LTERM der Bank empfangen
BC2000F	Seriennummer nur bei Verkauf oder Kompensation
BC2070F	Unlimitierte Kompensationen sind nicht möglich
BC2180F	Ergänzung-Geschäftsart W, R oder leer
BC2190F	Empfänger kann nicht ermittelt werden
BC2250F	Nominale ist kein Vielfaches des Mindestbetrag Variabler Handel
BC2440F	Annahmeschluss erreicht: Löschung nicht mehr zulässig
BC2470F	Kauf zur Rücknahme nicht zulässig
BC2480F	Annahmeschluss erreicht; Verarbeitung nicht möglich
BC2580F	Depotbank nicht korrekt gepflegt
BC2680F	Wert nach dem Komma entspricht nicht der Regel
BC2750F	Erträgnisdaten nicht korrekt gepflegt
BC2960F	Nominale ist kein Vielfaches der kleinsten handelbaren Einheit
BC3040F	Erster Kurs gesperrt zur Kursfeststellung
BC3140F	Geschäftsnummer ist ungültig
BC3270F	EK-Orders sind nur tagesgültig möglich
BC3280F	Feld Limitzusatz nicht änderbar
BC3480F	Gattung nicht zum INVESTRO-Handel zugelassen
BC3600F	Feld enthält ungültige Sonderzeichen
BC3650F	Gattung gelöscht
BC3690F	Gattung gelöscht, nur noch Blocklöschung erlaubt
BC3700F	Abschlussdatum nur in der Vergangenheit möglich
BC3730F	Der Börsentag in der Geschäftsnummer entspricht nicht den Storno- bzw. Durchlieferfristen
BC3780F	Gattung ist für XONTRO nicht zugelassen
BC3790F	Verarbeitung für Seriennummer nicht zulässig
BC3910F	Kein Skontroführender Makler zu dieser Gattung vorhanden

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

BC3950F	Gattung ist nicht variabel notiert
BC3990F	Seriennummer nur bei Satzart 012 zulässig
BC4160F	Mindeststückzahl unterschritten
BC4260F	Nominale ist kein Vielfaches des Mindestbetrags
BC4290F	Gattung in vorzeitiger Einstellung; nur Kauf möglich
BC4310F	Instruktion der EG-Order kann nicht interpretiert werden
BC4380F	Kauf zur Wiederanlage unzulässig
BC4400F	Limitzusatz SB/SL für Gattung nicht zugelassen
BC4590F	Auftragsteillöschung für INVESTRO nicht möglich
BC4600F	Auftragssplitt für INVESTRO nicht möglich
BC4670F	Bei SB/SL-Orders ist Handelshinweis EK nicht erlaubt
BC4680F	Sende-LTERM ist identisch mit einem angemeldeten Empfangs-LTERM
BC4690F	Empfangs-LTERM ist identisch mit einem angemeldeten Sendes-LTERM
BC4740F	Orderannahmeschluss erreicht; Kursfeststellung für Gattung nicht abgeschlossen
BC4770F	Devisenkurs für Gattung unzulässig
BC4830F	Empfänger nicht depotführende Stelle
BC4850F	Änderung des Orderempfängers nicht zulässig
BC4870F	Empfänger Freimakler bei Gattung mit Inkrement = 2 nicht möglich
BC4880F	Orderänderung w/Verarbeitung Nebenrechte momentan nicht möglich
BC4900F	Kompensationen mit Freimakler nicht zulässig
BC4970F	Tagesgültige Order nach Buchungsschnitt
BC4980F	Tagesgültige Order nach Schlusskurs
BC4990F	Tagesgültige Kassaorder nach Kassakurs
BC5000F	Tagesgültige Order mit Handelshinweis EK nach erstem Kurs
BC5110F	Eingebener hat keine Stornoberechtigung
BC5120F	Angegebene Stück/Nominale (Ursprung) weicht von aktuellem Wert der Order ab
BC5130F	Änderung des Handelshinweises nicht erlaubt
BC5340F	Gattung nicht mehr notiert
BC5360F	Änderung für INVESTRO nicht möglich
BC5390F	Kein Handelshinweis zulässig
BC5400F	Aufgeber kein ECU-Clearer
BC5440F	Für diese Gattung ist keine Eingabe einer Kassaorder möglich
BC5450F	Kaufphase abgeschlossen, nur noch Verkauf möglich
BC5460F	In dieser Gattung wird kein Einheitskurs notiert
BC5530F	Aufgeber ist kein AKV-Teilnehmer
BC5540F	Abwicklungsgeschäft nicht stornierbar
BC5560F	Keine Konditionen angelegt
BC5600F	Gattung zur Zeit inaktiv
BC5760F	Gattung hat keinen gültigen Bonischlüssel
BC5870F	Aufgeber und Wegen-Kontrahent müssen PUEV-Teilnehmer sein
BC6100F	Gattung nicht für BOEGA zugelassen
BC6120F	Datum-Gültigkeit-bis ist kleiner als Datum-Gültig-ab
BC6230F	PUEV-Eingabe-Ende ist erreicht
BC6720F	Ungültige Funktion (Ordersplit / Orderteillöschung)

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

BC6850F	Änderung nicht möglich; SB/SL-Order wird zur Zeit auf billigst/bestens umgesetzt
BC6930F	Abschlussuhrzeit ist ungültig
BC7010F	Nominale bei Gattung mit Inkrement = 2 nicht nach Regel
BC7020F	Nominale ist kleiner als der Mindestbetrag
BC7090F	Ungültige Notierungsart
BC7190F	Kein verantwortlicher Händler hinterlegt
BC7400F	Keine börslichen Eingaben am Börsenplatz erlaubt
BC7520F	Aufgeber nicht fremdwährungsfähig
BC7530F	Empfänger nicht fremdwährungsfähig
BC7610F	Die Funktion ist für Handelsteilnehmer nicht zulässig
BC7620F	Feldeingabe für Handelsteilnehmer nicht erlaubt
BC7650F	Änderung/Löschung akzeptiert, aber vorübergehend zurückgestellt
BC7660F	Aufgeber ist nicht zur Übermittlung von Bankdirektgeschäften / Storno / Durchlieferung berechtigt
BC7670F	Eingabe Bankdirektgeschäft für angegebenen Börsenplatz nicht erlaubt
BC7680F	Gattung nicht MiFID relevant
BC7690F	Eingabe MiFID-Nachrichten am angegebenen Börsenplatz unzulässig
BC7700F	Meldung nicht vorhanden
BC7710F	Wg. Aggregation nicht stornierbar. Gegengeschäft eingeben
BC7800F	Festvaluta darf nicht vor dem Emissionstag liegen
BC8090F	Durchlieferung ist bei Aufgaben unzulässig
BC8510F	Aufgeber muss Eufo-Teilnehmer sein
BC8520F	Ergänzung-Geschäftsart nicht zulässig
BC8530F	Auftrag wurde von Vestima+ noch nicht bestätigt
BC8540F	Löschung wurde von Vestima+ noch nicht bestätigt
BC8550F	Einstellung von Vestima+ abgelehnt
BC8560F	Löschung von Vestima+ abgelehnt
BC8570F	Keine Bestätigung von Vestima+ erhalten
BC8580F	Einstellung an Vestima+
BC8590F	Löschung an Vestima+ (vorläufig)
BC8600F	Löschung von Vestima+ empfangen
BC9030F	DWZ-Ordernummer nicht vorhanden
BC9430F	Orderstatus nicht definiert – bitte prüfen
BC9460F	Änderung Limitorder in Marketorder nicht möglich
BC9470F	Änderung Marketorder in Limitorder nicht möglich
BC9500F	Teilnehmer angehalten
BC9510F	Teilnehmer ausgesetzt
BC9520F	Gegenseite für unlimitierte Order nicht vorhanden
BC9530F	Ungültiger Trailing Abstand
BC9540F	EG-Ordertyp ungültig
BC9550F	Nicht definierter EG-Order Regelfehler
BC9560F	Auftrag für EG-Order vorläufig angenommen
BC9580F	Limitzusatz < EG > für Skontoführer / QLP nicht erlaubt
BC9590F	Nominale ist kein Vielfaches der kleinsten übertragbaren Einheit

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

BC9600F	Ungültiges Stop-Limit
BC9610F	Orderrouting an MAX-ONE nicht möglich
BC9620F	Bankinterne Ordernummer darf geändert, jedoch nicht gelöscht werden
BC9630F	Anforderung wird in MAX-ONE zurückgestellt
BC9640F	Zur Zeit kein Handelszeitraum in MAX-ONE
BC9650F	Handelshinweis ungültig
BC9660F	Bei SB/SL-Orders ist Handelshinweis EK nicht erlaubt
BC9670F	Ungültige Währung
BC9680F	Limitzusatz SB/SL ist Mussfeld bei Stop-Limit Order
BC9760F	Zeichnungsauftrag eingestellt, Gültigkeit angepasst
BC9770F	Zeichnungsauftrag während Orderbuchsperrung nicht möglich
BC9790F	Order außerhalb Zeichnungsphase
BC9820F	Bei EG-Order ist der Handelshinweis „EK“ nicht erlaubt
BC9830F	Bei EG-Order ist der Handelshinweis „KS“ nur für SA erlaubt
BC9840F	Ungültige OCO Limitrelation
BC9850F	Trailing Stop Differenz erforderlich
BC9860F	Keine Trailing Stop Orders für dieses Instrument zulässig
BC9990F	Systemfehler

Hinweis: Falls ein Feld aus mehreren Unterfeldern besteht, wird in der 6. Stelle der Fehler-ID die Nummer des ersten fehlerhaften Unterfeldes angegeben.

Bsp.: BC0072F ^ 2. Unterfeld ist nicht numerisch

Xetra: Dieses Verhalten gilt auch für die folgenden Xetra Fehlermeldungen, falls eine Identifizierung des fehlerhaften Unterfeldes möglich ist.

4.7 Xetra - Fehlermeldungen / Hinweise

Aktion	Umgebung	Fehlertyp	Fehlercode	Angabe Feldetikett
1. Entschlüsseln Nachricht, formale Grobprüfung, Berechtigungsprüfung (Security, Anmeldung)	Host Allgemeiner XONTRO-Teil	formaler Fehler	BCnnnnF	ja
2. Prüfen der Daten auf formale und fachliche Korrektheit	Xentric Order	1. formaler Fehler 2. inhaltlicher Fehler 3. technische Fehler	XKnnnnF XKnnnnF u. XAnnnnF BC9990F	ja
3. Prüfen Nachricht an Xetra	Xetra-Backend	1. formaler Fehler 2. inhaltlicher Fehler	XnnnnnF XnnnnnF	nein

- Die detaillierten Fehlermeldungen beim Prüfen der Nachricht an Xetra sind der jeweils gültigen Version der Dokumentation "Xetra - VALUES API Programming Version" zu entnehmen und werden hier nicht mehr explizit aufgeführt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

2. Die Fehlermeldungen beim Entschlüsseln der Nachricht, bei der formalen Grobprüfung und bei der Berechtigungsprüfung (Security, Anmeldung) entsprechen den XONTRO Fehlermeldungen.

Kreditinstitute - Technische AnbindungVersion 5.55

3. Im Folgenden sind die Fehlermeldungen, deren Ursache auf formale und inhaltliche Fehler bei der Prüfung in Xentric Order zurückzuführen ist, aufgeführt:

XK0010F	Absender ist kein Xetra-Teilnehmer
XK0020F	Xetra Orderrouting nicht möglich (MISS not available)
XK0030F	Resend nicht möglich (MISS not available)
XK0040F	Orderdaten ungültig für Resend-Nachricht
XK0050F	Orderdaten nicht eindeutig für Resend-Nachricht
XK0100F	Orderteillöschung für Xetra nicht möglich
XK0110F	Ordersplit für Xetra nicht möglich
XK0120F	Eingabe Bankdirektgeschäfte / Storno / Durchlieferung für Xetra nicht möglich
XK0130F	Verarbeitung von MiFID-Nachrichten für Xetra nicht möglich
XK0210F	Feldeingabe für Xetra nicht erlaubt
XK0300F	Orderstatus nicht definiert - bitte prüfen (Order konnte unter Umständen nicht bearbeitet werden)
XK0310F	Evtl. fehlende Broadcasts (Dieser Fehler wird nicht im Nachrichtentyp MT596, sondern nur im Nachrichtentyp MT551 im Feld F:72 für das Ereignis XEBAT geliefert)
XK0320F	Antwort des Handelssystems Xetra offen – bitte prüfen
XK0400F	Anforderung zurückgestellt. Erneuter Versuch durch System.
XK0410F	Zurückgestellte Anforderung abgelehnt
XK0940F	Bankinterne Ordernummer nicht eindeutig
XA2000F	Orderänderungs- / Orderlöschanfrage ist nicht eindeutig
XA2010F	Angegebene Stück/Nominale (Ursprung) weicht von dem aktuellen Wert der Order ab
XA2020F	Eingabe während aktueller Handelsphase nicht möglich

5 Beispiele zur Nachrichtenübermittlung

Die Beispiele sind unter Berücksichtigung der Restriktionen der Systeme erstellt worden.

5.1 Kauforder (MT 500)

BEISPIEL 1A: Kauf festverzinslicher Papiere zur Kasse

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000004} (kein CrLf)
{2:I500DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABCDEFGH
:30:000530
:35A:BON10000,
:35B:ISIN DE0002681491
HESS.LDSBK.IS.E.242
:32L:EUR99,5
/130 KS
-}
```

BEISPIEL 1B: Format für eine Xetra - Kauforder

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000004} (kein CrLf)
{2:I500DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABCDEFGH2
:30:980530
:35A:BON10000,
:35B:ISIN DE0002030751
BAY.HYP.BK.AG PF.R.46 SVG
:32L:EUR99,5
/194
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

BEISPIEL 1C: Kauf INVESTRO

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000004} (kein CrLf)
{2:I500DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABCDEFGH
:23: R
:30:010330
:35A:UNT10000,
:35B:ISIN LU003753395
DIT-LUX STAATSANLEIHEN
:32L:EURO,
/183
:82D:/7002
:53C:/1234567890
-}
```

5.2 Verkauforder (MT 501)

BEISPIEL 2A: Verkauf von Aktien im variablen Handel

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000005} (kein CrLf)
{2:I501DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABCDABCD
:30:900829
:35A:SHS100,
:35B:ISIN DE0007664005
VOLKSWAGEN
:32L:EURO,
/120
:82D:/4037
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

BEISPIEL 2B: Format für eine Xetra - Verkauforder

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000005} (kein CrLf)
{2:I501DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABCDABCD2
:30:980829
:35A:SHS100,
:35B:ISIN DE0007664005
VOLKSWAGEN
:32L:EURO,
/194
:82D:/7002
-}
```

BEISPIEL 2C: Verkauf INVESTRO

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000005} (kein CrLf)
{2:I501DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABCDABCD
:30:010330
:35A:UNT10000,
:35B:ISIN LU003753395
DIT-LUX STAATSANLEIHEN
:32L:EURO,
/183
:82D:/7002
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.3 Ausführungsbestätigung (MT 519)

BEISPIEL 3A: Ausführungsbestätigung für festverzinsliche Papiere

Bezug: Beispiel 1A

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000300001} (kein CrLf)
{2:05191125000515DWZXDEFFABOS00000000000005151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:0005150004711 (DWZ-Order-Nr. gem. MT596 zu MT500)
:21:ABCDEFGH (Bankinterne Ordernummer)
:23:BOUGHT
:31P:000515130KS780112020768/+105
:35A:BON10000,
:35B:ISIN DE0002681491
HESS.LDSBK.IS.E.242
:33T:EUR99,45
-}
```

BEISPIEL 3B: Format für eine Xetra - Ausführungsbestätigung

Bezug: Beispiel 1B

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000300001} (kein CrLf)
{2:05191125980515DWZXDEFFABOS000000000009805151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:0000000000001 (Xetra-Order-Nr. gem. MT596 zu MT500)
:21:ABCDEFGH2 (Bankinterne Ordernummer)
:23:BOUGHT
:31P:980515194XT000012020700/+105
:35A:BON10000,
:35B:ISIN DE0002030751
BAY.HYP.BK.AG PF.R.46 SVG
123456789012345678 (Versionsnummer / lastUpdateDat)
:33T:EUR99,45
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

BEISPIEL 3C: Ausführungsbestätigung INVESTRO

Bezug: Beispiel 2C

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000300001} (kein CrLf)
{2:05191204010330DWZXDEFFABOS00000000000103301204N} (kein CrLf)
{4:
:20:0103300004711 (DWZ-Order-Nr. gem. MT596 zu MT500)
:21:ABCDABCD (Bankinterne Ordernummer)
:23:BOUGHT
:31P:010330183VA703012020768
:35A:UNT10000,
:35B:ISIN LU003753395
DIT-LUX STAATSANLEIHEN
:33T:EUR57,12
:72:DWZ-USER 7002192799
3,5/3,2/12,12
59,12/1,23
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.4 Ereignis im Wertpapiergeschäft (MT 551)

5.4.1 Kassakursmitteilung

BEISPIEL 4A:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000300002} (kein CrLf)
{2:05511336900830DWZXDEFFABOS00000000009008301336N} (kein CrLf)
{4:
:20:9008301234567
:35B:ISIN DE0007664005
VOLKSWAGEN
766400
:79:SPOTR900830133550
/504,///130/EUR/7885////////
-}
```

5.4.2 Kursaussetzung für VW-Aktien in Frankfurt

BEISPIEL 4B:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000300003} (kein CrLf)
{2:05511155900830DWZXDEFFABOS00000000009008301155N} (kein CrLf)
{4:
:20:9008302345678
:35B:ISIN DE0007664005
VOLKSWAGEN
766400
:79:FIXOF900830120050
///130////////
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.5 Sonstige Ereignisse (MT 551)

5.5.1 XONTRO Buchungsschnitt Ende

BEISPIEL 5A:

```
{1:F01DRESDEFFA1300000300005} (kein CrLf)
{2:05512036020830DWZXDEFFABOS00000000000208302036N} (kein CrLf)
{4:
:20:0208301234567
:35B:MISC
:79:BOEND020830203550
///130////////
:72: BOSS-BUCHUNGSSCHNITT-ENDE
-}
```

5.5.2 Handelsende MAX-ONE

BEISPIEL 5C:

```
{1:F01DRESDEFFA1600000300005} (kein CrLf)
{2:05512036020830DWZXDEFFABOS00000000000208302036N} (kein CrLf)
{4:
:20:0208301234567
:35B:2004
:79:EHEND020830203550
///160////////
:72: MAX-ONE TRADE DAY CLOSED
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.5.3 Nachricht für SAKI-Ende vorläufig

BEISPIEL 5D:

```
{1:F01CSDBDE7172710000300433} (kein CrLf)
{2:05512219090112DWZXDEFFABOS00000000000901122219N} (kein CrLf)
{4:
:20:0901138000003
:35B:MISC
:79:SAKIV090112221935
:72:090112 000023/300432/600099
-}
```

5.5.4 Nachricht für SAKI-Ende

BEISPIEL 5E:

```
{1:F01CSDBDE7172710000300433} (kein CrLf)
{2:05512219090112DWZXDEFFABOS00000000000901122219N} (kein CrLf)
{4:
:20:0901138000003
:35B:MISC
:79:SAKIE090112221935
:72:090113 090112 000023/300433/600099
-}
```

5.6 Anfrage (MT 595)

5.6.1 Orderänderung

BEISPIEL 6A: (Bezug: Beispiel 2A)

Limitänderung

```
{1:F01DRESDEFFAXX00000000006} (kein CrLf)
{2:I595DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABCDABCD
:75:111/4037
:11:501
900515
:79:32L:EUR600,
/120
-}
```

Die Änderung wird mit MT596 bestätigt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

BEISPIEL 6B: Format für eine Xetra - Orderänderung (Bezug: Beispiel 2B)

Limitänderung

```
{1:F01DRESDEFFAXX00000000006} (kein CrLf)
{2:I595DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABCDABCD2
:21:00000000000002 (Xetra - Ordernummer)
:75:111/7002/194
:11:501
980515
:79:35B:ISIN DE0007664005
VOLKSWAGEN
123456789012345678 (Versionsnummer / lastUpdateDat)
32L:EUR600,
/194
-}
```

Die Änderung wird mit MT596 bestätigt.

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.6.2 Orderstreichung

BEISPIEL 7A: (Bezug: Beispiel 1A)

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000007} (kein CrLf)
{2:I595DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABCDEFGH (Bankinterne Ordernummer)
:21:0005150004711 (DWZ-Order-Nr. gem. MT596 zu MT500)
:75:113/4037
:11:500
000515
-}
```

BEISPIEL 7B: Format für eine Xetra - Orderstreichung (Bezug: Beispiel 1B)

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000007} (kein CrLf)
{2:I595DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABCDEFGH2 (Bankinterne Ordernummer)
:21:0000000000001 (Xetra-Order-Nr. gem. MT596 zu MT500)
:75:113/7002/194
:11:500
980515
:79:35B:ISIN DE0007664005
VOLKSWAGEN
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.7 Bankdirektgeschäft (MT 511) / Storno und Durchlieferung (MT 595)

5.7.1 Einstellung Bankdirektgeschäft

BEISPIEL 8A:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000009} (kein CrLf)
{2:I511DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:BANKINTNUMMER
:23:012 (Satzart)
:31P:130
:35A:SHS1000,
:35B:ISIN DE0007664005
:33T:EUR43,85
:82D:7002/7000
:72:TEXT
-}
```

5.7.2 Storno Bankdirektgeschäft

BEISPIEL 8B: (Bezug: Beispiel 8A)

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000010} (kein CrLf)
{2:I595DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:EDF0403150000001 (Geschäftsnummer. gem. MT596 zu MT511)
:75:114/7002/130
:11:511
040315
:79:35B:ISIN DE0007664005
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.7.3 Durchlieferung Bankdirektgeschäft

BEISPIEL 8C: (Bezug: Beispiel 8A)

{1:F01DRESDEFFAXX0000000011}

(kein CrLf)

{2:I595DWZXDEFFABOSN2005}

(kein CrLf)

{4:

:20:EDF0403150000001

(Geschäftsnummer. gem. MT596 zu MT511)

:75:115/7002/130

:11:511

040315

:79:35B:ISIN DE0007664005

-}

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.8 OTC Trade Report (MT 513) / Storno OTC Trade Report (MT 595)

5.8.1 Einstellung OTC Trade-Report

BEISPIEL 9A:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000009} (kein CrLf)
{2:I513DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:BANKINTNUMMER
:31P:1300711051030
:40:DRESDEFFXXX/OTC/////1/+0100
:35A:1000,
:35B:ISIN DE0007664005
:33T:EUR145,85
:82D:7002
-}
```

5.8.2 Storno OTC Trade Report

BEISPIEL 9B: (Bezug: Beispiel 9A)

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000010} (kein CrLf)
{2:I595DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:EDF0711050000001 (OTC-Trade-Report-Nummer gem. MT596 zu MT513)
:75:116/7002/130
:11:513
071105
:79:35B:ISIN DE0007664005
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.9 Antwort (MT 596)

5.9.1 Bestätigung der Orderannahme

BEISPIEL 10A: (Bezug: Beispiel 1A)

Rückmeldung (Positiv):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000004} (kein CrLf)
{2:05961125000515DWZXDEFFABOS00000000040005151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:0005150004711
:21:ABCDEFGH
:76:/300
EIN-ZEIT 11244001
:11:500
000515
-}
```

BEISPIEL 10B: Format für Xetra (Bezug: Beispiel 1B)

Rückmeldung (Positiv):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000004} (kein CrLf)
{2:05961125980515DWZXDEFFABOS00000000049805151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:0000000000001
:21:ABCDEFGH2
:76:/300/0000000000003
EIN-ZEIT 11244001123456789012345678
:11:500
980515
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.9.2 Ablehnung wegen Datenfehler

BEISPIEL 11A:

Fehlerhafte Nachricht:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000009} (kein CrLf)
{2:I500DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABABABAB
:30:XXXXXX
:35A:BON10000
:35B:ISIN DE0002681491
HESS.LDSBK.IS.E.242
:32L:EUR99,5
/120
:82D:/4037
-}
```

Rückmeldung (Datenfehler):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000006} (kein CrLf)
{2:05961125000515DWZXDEFFABOS00000000090005151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:00000000000000
:21:ABABABAB
:76:/305
EIN-ZEIT 11250110
:11:500
000515
:79:30 BC0700F
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

BEISPIEL 11B: Format für Xetra

Fehlerhafte Nachricht:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000009} (kein CrLf)
{2:I500DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:ABABABAB
:30:980710
:35A:BON10000
:35B:ISIN DE0002681491
HESS.LDSBK.IS.E.242
:32L:EUR99,5
/194
:82D:/4037
-}
```

Rückmeldung (Datenfehler):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000006} (kein CrLf)
{2:05961125980515DWZXDEFFABOS00000000099805151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:00000000000000
:21:ABABABAB
:76:/305
EIN-ZEIT 11250110
:11:500
980515
:79: XnnnnnF
-}
```


5.9.3 Bestätigung einer Änderung

BEISPIEL 12A: (Bezug: Beispiel 6A)

Rückmeldung (Positiv):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000007 (kein CrLf)
{2:05961125900829DWZXDEFFABOS00000000069005151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:9008290004712
:21:ABCDABCD
:76:/310
EIN-ZEIT 11255830
:11:595
900515
-}
```

BEISPIEL 12B: Format für Xetra (Bezug: Beispiel 6B)

Rückmeldung (Positiv):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000007} (kein CrLf)
{2:05961125980829DWZXDEFFABOS00000000069805151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:00000000000002
:21:ABCDABCD2
:76:/310/0000000000004
EIN-ZEIT 11255830123456789012345678
:11:595
980515
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.9.4 Bestätigung einer Streichung

BEISPIEL 13A: (Bezug: Beispiel 7A)

Rückmeldung (Negativ):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000008} (kein CrLf)
{2:05961125000515DWZXDEFFABOS00000000070005151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:0005150004711
:21:ABCDEFGH
:76:/323
EIN-ZEIT 11250110
:11:595
000515
-}
```

BEISPIEL 13B: Format für eine Xetra - Order (Bezug: Beispiel 7B)

Rückmeldung (Negativ):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000008} (kein CrLf)
{2:05961125980515DWZXDEFFABOS00000000079805151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:00000000000001
:21:ABCDEFGH2
:76:/323
EIN-ZEIT 11250110
:11:595
980515
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.9.5 Bestätigung eines Bankdirektgeschäfts

BEISPIEL 14A: (Bezug: Beispiel 8A)

Rückmeldung (Positiv):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000600001} (kein CrLf)
{2:05961125040315DWZXDEFFABOS00000000090403151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:BANKINTNUMMER
:21:EDF0403150000001
:76:/300
EIN-ZEIT 11250110
:11:511
040315
-}
```

5.9.6 Bestätigung Storno eines Bankdirektgeschäfts

BEISPIEL 14B: (Bezug: Beispiel 8B)

Rückmeldung (Positiv):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000600002} (kein CrLf)
{2:05961130040315DWZXDEFFABOS00000000100403151130N} (kein CrLf)
{4:
:20:00000000000000
:21:EDF0403150000001
:76:/320
EIN-ZEIT 11300110
:11:595
040315
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.9.7 Bestätigung Durchlieferung eines Bankdirektgeschäfts

BEISPIEL 14C: (Bezug: Beispiel 8C)

Rückmeldung (Positiv):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000600003} (kein CrLf)
{2:05961130040315DWZXDEFFABOS00000000110403151130N} (kein CrLf)
{4:
:20:00000000000000
:21:EDF0403150000001
:76:/310EDF0403150000002
EIN-ZEIT 11300110
:11:595
040315
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.9.8 Bestätigung eines OTC-Trade-Reports

BEISPIEL 15A: (Bezug: Beispiel 9A)

Rückmeldung (Positiv):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000600001} (kein CrLf)
{2:05961030071105DWZXDEFFABOS00000000090711051030N} (kein CrLf)
{4:
:20:BANKINTNUMMER
:21:EDF0711050000001
:76:/300
EIN-ZEIT 10300110
:11:513
071105
-}
```

5.9.9 Bestätigung Storno eines OTC-Trade-Reports

BEISPIEL 15B: (Bezug: Beispiel 9B)

Rückmeldung (Positiv):

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000600002} (kein CrLf)
{2:05961035071105DWZXDEFFABOS00000000100711051035N} (kein CrLf)
{4:
:20:00000000000000
:21:EDF0711050000001
:76:/320
EIN-ZEIT 10350110
:11:595
071105
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.10 Nachricht für eigene Anwendung (MT 598)

5.10.1 Login

BEISPIEL 16:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000010} (kein CrLf)
{2:I598DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:0005150000001
:12:000
:77E:USER567890/PASSWORTS///
-}
```

5.10.2 Bestätigung Login

BEISPIEL 17:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000009} (kein CrLf)
{2:05981006000515DWZXDEFFABOS00000000100005151006N} (kein CrLf)
{4:
:20:0005150000001
:12:001
:77E:USER567890/XXXXXXXXS///001/
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.10.3 Rückmeldung fehlerhafter Nachrichten durch Kreditinstitut

BEISPIEL 18:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000011} (kein CrLf)
{2:I598DWZXDEFFABOSN2005} (kein CrLf)
{4:
:20:0005150000001
:12:021
:77E:1:F01DRESDEFFAXX0000000009 ← Beginn Ursprungsnachricht
2:05981006000515DWZXDEFFABOS00000000100005151006N
4:
:20:0005150000001
:12:001
:77E:USER567890/XXXXXXXXXS///001/ ← Ende Ursprungsnachricht
:421:021
-}
```

5.10.4 Retrieval-Anforderung, Anfangs-OSN

BEISPIEL 19:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000012}  
{2:I598DWZXDEFFABOSN2005}  
{4:  
:20:0005150000002  
:12:020  
:77E:153:000017  
-}
```

(kein CrLf)
(kein CrLf)

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.10.5 Antwort auf Anforderung

BEISPIEL 20:

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000000010} (kein CrLf)
{2:05981006000515DWZXDEFFABOS0000000012000515006N} (kein CrLf)
{4:
:20:0005150000002
:12:021
:77E:1:F01DRESDEFFAXX0000000012
2:I598DWZXDEFFABOSN2005
4:
:20:0005150000002
:12:020
:77E:153:000017
:421:ANF
-}

:
: (angeforderte Nachrichten; diese Nachrichten werden mit ursprünglicher OSN gesendet)
:

{1:F01DRESDEFFAXX0000000011} (kein CrLf)
{2:05981006000515DWZXDEFFABOS0000000012000515006N} (kein CrLf)
{4:
:20:0005150000002
:12:021
:77E:1:F01DRESDEFFAXX0000000012
2:I598DWZXDEFFABOSN2005
4:
:20:0005150000002
:12:020
:77E:153:000017
:421:END
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.11 Schlussnote (MT 512) / Orders zur Schlussnote (MT 599)

5.11.1 Schlussnote

BEISPIEL 21A: Schlussnote mit 2 betroffenen Orders

Bezug: Beispiel 3A

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000600009} (kein CrLf)
{2:05121125000515DWZXDEFFBBGA00006000090507151125N} (kein CrLf)
{4:
:20:1300005150600012
:21:MT599
:23:BOUGHT/013/N//A1/BS
:31P:000515130///
:30:000000/1125/130//
:35A:BON20000,
:35B:ISIN DE0002681491
HESS.LDSBK.IS.E.242
0062/5,25/21.02.G /
:82D:/7833
:87F:APMT/C/7066
:87F:APMT/D/7833
:33T:EUR99,45
:32M:EUR19890,
:34G:135EUR,93
:71C:/BROK/EUR,38/
:34B:EUR19890,
:72:7833
7066/268149
00051511250000000000000000
BOSS/
-}
```

5.11.2 Orders zur Schlussnote

BEISPIEL 21B: Übermittlung der beiden betroffenen Orders zu einer Schlussnote

Bezug: Beispiel 19A

```
{1:F01DRESDEFFAXX0000600010} (kein CrLf)
{2:05991125000515DWZXDEFFBBGA00006000100507151125N} (kein CrLf)
{4::20:0507184300002
:79:1300005150600012
ABCDEFGH/BON10000,
XYZ/BON10000,
-}
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

5.12 Ausführungsbestätigung für einen Fondsauftrag (MT 515)

5.12.1 Ausführungsbestätigung für Investro-Depotbank, wenn der Orderaufgeber von Vestima+ ist

BEISPIEL 22A:

```
{1:F01BVBEDEMMAXX0000300003} (kein CrLf)
{2:05151313080910DWZXDEFFABOS00000000000809101313N} (kein CrLf)
{4:
:16R:GENL
:20C::SEME//OHA0809107400003
:23G:NEWM
:22F::TRTR//TRAD
:16R:LINK
:20C::RELA//DWZ0809107400003
:16S:LINK
:16S:GENL
:16R:CONFDET
:98A::SETT//20080912
:98A::TRAD//20080910
:90B::DEAL//ACTU/EUR63,
:22H::BUSE//SUBS
:22H::PAYM//APMT
:16R:CONFPRTY
:95R::SELL/CEDE/2013
:97A::SAFE//2013
:16S:CONFPRTY
:36B::CONF//UNIT/200,
:35B:ISIN DE0006329014
LA FLEX INVEST
:16S:CONFDET
:16R:SETDET
:22F::SETR//TRAD
:22F::STCO/CEDE/DFLT
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//CEDELULLXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::REAG//BKAUATWWXXX
:97A::SAFE//18481
:16S:SETPRTY
:16R:AMT
:19A::DEAL//EUR12600,
:16S:AMT
:16R:AMT
:19A::SETT//EUR13000,
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

```
:16S:AMT
:16R:AMT
:19A::ENTF//EUR400,
:16S:AMT
:16S:SETDET
-}
```

5.12.2 Ausführungsbestätigung für Investro-Orderaufgeber, wenn der OHA von Vestima+ ist

BEISPIEL 22B:

```
{1:F01DREDWPFFAXX0000300004} (kein CrLf)
{2:05151411080910DWZXDEFFABOS00000000000809101411N} (kein CrLf)
{4:
:16R:GENL
:20C::SEME//CON0809107400012
:23G:NEWM
:22F::TRTR//TRAD
:16R:LINK
:20C::RELA//BI-Ordernummer
:16S:LINK
:16S:GENL
:16R:CONFDET
:98A::TRAD//20080910
:98A::SETT//20080911
:90B::DEAL//ACTU/USD11,
:22H::BUSE//SUBS
:22F::PRIC/CEDE/NAV
:22H::PAYM//APMT
:16R:CONFPRTY
:95P::SELL//MALALULLXXX
:97A::SAFE//10020
:16S:CONFPRTY
:36B::CONF//UNIT/333,
:35B:ISIN LU0117468966
SHS E + G FD-PROPERTY STOCKS AMER.
:16S:CONFDET
:16R:SETDET
:22F::SETR//TRAD
:22F::STCO/CEDE/MANU
:16R:SETPRTY
:95P::DEAG//MALALULLXXX
:97A::SAFE//10020
:16S:SETPRTY
```

Kreditinstitute - Technische Anbindung

Version 5.55

```
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//CEDELULLXXX
:16S:SETPRTY
:16R:AMT
:19A::DEAL//USD3663,
:16S:AMT
:16R:AMT
:19A::SETT//USD3663,
:16S:AMT
:16S:SETDET
-}
```