



XONTRO

MiFID Nachhandelstransparenz

Beschreibung Tagesendfile

Version

1

Stand 20.06.2007

Inhalt

1	Vorsatz	3
2	Berichtssatz	3
3	Endesatz	5

Am Tagesende kann der Teilnehmer ein File mit den gültig verarbeiteten Meldesätzen erhalten.

Das File hat folgenden Aufbau:

1 Vorsatz

Name	Beschreibung	Format	M / O	Bemerkung
Empfängernummer	CBF-Nr. des Teilnehmers, der das File erhält	9(4)	M	
Börsentag	Tag, an dem die Meldungen geschickt wurden	9(8)	M	JJJJMMTT
Dateiname	Bezeichnung der Datei	X(25)	M	Konstante „Bericht OTC-Trade-Reports“

2 Berichtssatz

Name	Beschreibung	Format	M / O	Bemerkung
OTC-Report-Nr	vom System vergebene OTC-Trade-Report-Nummer	16(X)	M	Konstante „OTC“ gefolgt von Datum im Format JJMMTT und einer 7-stellig fortlaufenden Nummer
BI-OTC-Report-No	teilnehmerinterne OTC-Trade-Report-Nummer	13(X)	O	teilnehmerinterne Reportnummer
Abschlussdatum	Datum des Geschäftsabschlusses	9(6)	M	JJMMTT
Abschlussuhrzeit	Uhrzeit des Geschäftsabschlusses	9(8)	M	HHMMSSHS

Stornokennzeichen	Kennzeichen, ob es sich um ein Storno eines Trade-Reports handelt	X(1)	O	„S“ für Storno
BIC des Melders	11-stelliger alphanumerischer Code des meldenden Institutes.	X(11)	M	
Execution Venue ID	Art bzw. Ausführungsort des Geschäftes	X(12)	M	„OTC“ „SI“ „B“ plus BIC „M“ plus MIC „I“ plus IBEI
Abweichender Preis Indikator	Kennzeichen, ob Preis vom Marktpreis abweicht	X(1)	O	„J“ für abw. Preis
Verhandelter Preis Indikator	Kennzeichen, ob der Preis verhandelt ist	X(1)	O	„J“ für verhandelten Preis
Delay Indikator	Block trade delay	X(1)	O	„J“ bei Block trade;
Amendment	Kennzeichen, ob es sich um ein geändertes Geschäft handelt	X(1)	O	„J“ für Neumeldung nach Storno
Einheit der Effektennotiz	Notierungseinheit	X(1)	M	1 = Stück 2 = Prozent 3 = Promille
Abweichung zu UTC mit Vorzeichen (+/-HHMM)	Abweichung der Abschlussuhrzeit von der Universal Time Coordinated (UTC)	S9(4)	M	+HHMM
Nominale	Nominale oder die Stückzahl des Geschäftes	9(9)V9(3)	M	
Wertpapierkennnummer	ISIN	X(12)	M	
Preis	Preis, zu dem gehandelt wurde	9(6)V9(4)	M	

Währung zum Preis	Währung zum Preis bzw. Depotwährung	X(3)	M	
Eingaber des Geschäftes	CBF-Konto-Nr. des Eingabers	9(4)	M	
Alert-Code	Ergebnis der Validierung	X(2)	O	PA = Preis-Alert NV = keine Validierung
Eingangs-Zeitstempel	Datum und Uhrzeit, wann die Nachricht ins System eingestellt wurde	X(26)	M	JJJJ-MM-TT- HH.MM.SS.NNNN NN ¹
Ausgangs-Zeitstempel	Datum und Uhrzeit, an dem der Trade-Report zur Veröffentlichung weitergegeben wurde	X(26)	M	JJJJ-MM-TT- HH.MM.SS.NNNN NN ²

3 Endesatz

Name	Beschreibung	Format	M / O	Bemerkung
Empfänger Nummer	CBF-Nr. des Teilnehmers, der die Meldung geschickt hat	9(4)	M	
Satzzähler	Anzahl der Sätze der Datei inkl. Vor- und Endesatz	9(6)	M	
Ende-Kennzeichen	File-Ende-Kennzeichen	X(3)	M	Konstante „END“
Dateiname	Bezeichnung der Datei	X(25)	M	Konstante „Bericht OTC-Trade-Reports“

¹ Zeit mit einer Genauigkeit von Nanosekunden

² Zeit mit einer Genauigkeit von Nanosekunden