

Release 02

## QSAM Systemanschluss Makler

XONTRO VALUES API  
Planing Version

Stand: 05.11.2020

Version 02.01

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

## Inhaltsverzeichnis

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## 1 Einleitung

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

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

Die API-Dokumentation ist in folgende Abschnitte gegliedert:

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

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

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

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

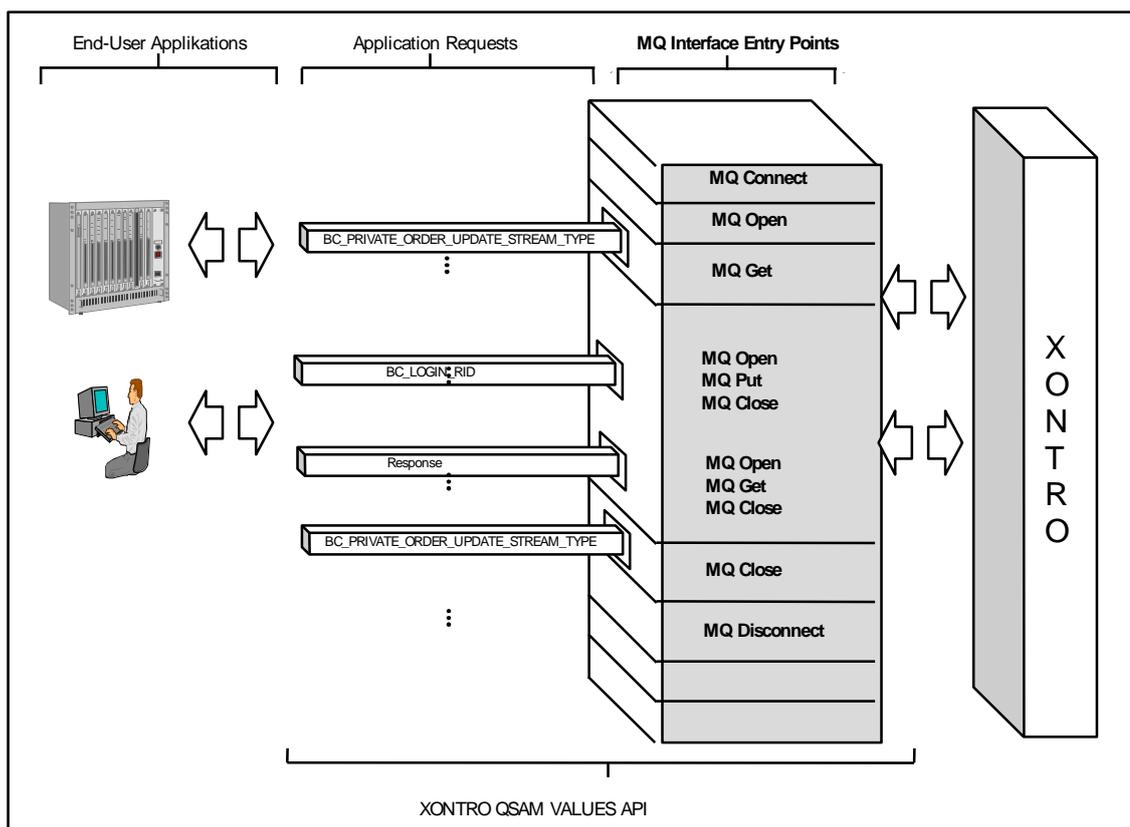
Die folgenden inhaltlichen Abschnitte folgen einem einheitlichen Aufbau:

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

### Request ID, Request Data, Response Data

beschrieben.

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



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

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

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

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

## 2 XONTRO QSAM VALUES API

### 2.1 XONTRO QSAM Nachrichten

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Nicht belegte Feldteile werden bei

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

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

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

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

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

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

## 2.1.1 XONTRO QSAM Header

### 2.1.1.1 XONTRO QSAM Request Header

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

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

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

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

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

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

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

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

|              |                                      |  |
|--------------|--------------------------------------|--|
| Request Data | <code>bc_qsam_request_headerT</code> | <code>qsamId</code> <sup>m</sup><br><code>qsamMsgType</code> <sup>m</sup><br><code>qsamRequestId</code> <sup>m</sup><br><code>qsamExchangeld</code> <sup>m</sup><br><code>qsamUserId</code> <sup>m</sup> |
|--------------|--------------------------------------|--|

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

### 2.1.1.2 XONTRO QSAM Response Header

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### 2.1.1.3 XONTRO QSAM Broadcast Header

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

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

Das Feld `qsamMsgType` liefert folgende Ausprägungen:

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

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

Das Feld `qsamDat` liefert den Börsentag der Nachricht.

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

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

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

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

## 2.1.2 Berechtigungskonzept

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

Das API besitzt also folgende Struktur:

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

Teile dieser Funktionalität sind optional und können abgeschaltet werden.

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

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

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

Das Formular für die Änderung des Berechtigungsprofils „SAM-Teilnehmerprofil“ ist auf der Internetseite [www.xontro.de](http://www.xontro.de) unter **Xontro → Anmeldung** abrufbar.

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



gekennzeichnet.

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



gekennzeichnet:

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

### 2.1.3 Behandlung von Mehrfachübertragungen und alten Nachrichten

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

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

Folgende Requests sind davon ausgenommen und nicht über inSeqNo gesichert:

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

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

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

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

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

## 2.1.4 Anmeldung / Abmeldung und Passwortwechsel

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

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

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

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

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

### 2.1.4.1 XONTRO Login

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

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

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

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

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

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

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

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

`qsamRequestId` → `BC_LOGIN_RID` oder  
`BC_LOGIN_QUOTE_BYPASS_RID`

|              |                                      |  |
|--------------|--------------------------------------|--|
| Request Data | <code>bc_qsam_request_headerT</code> | <code>qsamId</code> <sup>m</sup><br><code>qsamMsgType</code> <sup>m</sup><br><code>qsamRequestId</code> <sup>m</sup><br><code>qsamExchangeld</code> <sup>m</sup><br><code>qsamUserId</code> <sup>m</sup> |
|              | <code>bc_request_headerT</code>      | <code>inSeqNo</code> <sup>o</sup>  |
|              | <code>bc_pwdT</code>                 | <code>bcPwd</code> <sup>m</sup>  |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeId<br>qsamUserId<br>qsamCompICode |
|               | bc_response_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo              |

Das Feld **errFieldRef** liefert beim Request BC\_LOGIN\_QUOTE\_BYPASS\_RID folgende Ausprägungen für die Quote-Bypass Verarbeitung zurück:

|                             |  |
|-----------------------------|--|
| BC_BYPASS_INSTANCE_A_ACTIVE | Kursvermarkter (DBAG CEF) auf Instanz A aktiv<br>(siehe XONTRO Enter Mass Quote) |
| BC_BYPASS_INSTANCE_B_ACTIVE | Kursvermarkter (DBAG CEF) auf Instanz B aktiv<br>(siehe XONTRO Enter Mass Quote) |

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

### 2.1.4.2 XONTRO Logout

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

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

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

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

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

`qsamRequestId` → BC\_LOGOUT\_RID

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

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

### 2.1.4.3 XONTRO Change Password

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

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

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

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

`qsamRequestId` → BC\_CHANGE\_PASSWORD\_RID

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

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

## 2.1.5 Orderverwaltung Front End für skontroführende Makler

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

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

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

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

<sup>1</sup> Im Fall der Orderänderung oder Orderlöschung wird in der Response immer die gleiche Struktur [bc\_response\_mod\_ordT] verwendet.

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

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

### 2.1.5.1 XONTRO Enter Order SKM

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

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

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

qsamRequestId → BC\_ENTER\_ORDER\_SKM\_RID

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

*Diese Struktur wird auf der  
folgenden Seite fortgesetzt*

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

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

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

### 2.1.5.2 XONTRO Modify Order SKM

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

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

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

In Ausnahmefällen kann eine vorangegangene und vorgehaltene<sup>2</sup> Orderänderung zwar logisch, aber noch nicht physisch verarbeitet sein. Trifft der Request **XONTRO Modify Order SKM** in einer solchen Situation auf dem Back End ein, so erhält die Maklerapplikation einen Broadcast vom Subtyp BCBE\_PEND\_MODIFY\_ORDER. Bei der physischen Verarbeitung wird für jede Änderung ein Broadcast vom Subtyp BCBE\_CONFIRM\_MODIFY\_ORDER gesendet.

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

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

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

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_MODIFY\_ORDER\_SKM\_RID

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

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

### 2.1.5.3 XONTRO Delete Order SKM

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

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

In Ausnahmefällen kann eine vorangegangene und vorgehaltene<sup>3</sup> Orderänderung zwar logisch, aber noch nicht physisch verarbeitet sein. Trifft der Request **XONTRO Delete Order SKM** in einer solchen Situation auf dem Back End ein, so erhält die Maklerapplikation einen Broadcast vom Subtyp BCBE\_PEND\_DELETE\_ORDER. Bei der physischen Verarbeitung wird für die Änderung ein Broadcast vom Subtyp BCBE\_CONFIRM\_MODIFY\_ORDER und für die Löschung ein Broadcast vom Subtyp BCBE\_CONFIRM\_DELETE\_ORDER gesendet.

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene DWZ-Ordernummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamCompCode) ELB\_BC\_ORDER\_NOEX.

In der Response ist nur der Header belegt.

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

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

Im Fehlerfall ist in der Response nur der Header belegt.

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

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

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_DELETE\_ORDER\_SKM\_RID

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

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

## 2.1.6 Orderverwaltung Front End für Freimakler

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

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

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

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

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

|               |  |
|---------------|--|
| Response Data | bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT +<br>bc_response_mod_ordT <sup>4</sup> |
|---------------|--|

### 2.1.6.1 XONTRO Enter Order FM

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

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

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

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

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

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

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

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

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

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

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

<sup>4</sup> Im Fall der Orderänderung oder Orderlöschung wird in der Response immer die gleiche Struktur [bc\_response\_mod\_ordT] verwendet.

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

qsamRequestId → BC\_ENTER\_ORDER\_FM\_RID

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

*Diese Struktur wird auf der  
folgenden Seite fortgesetzt*

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

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

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

### 2.1.6.2 XONTRO Modify Order FM

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

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

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

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

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

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

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

Eine weitergeleitete Order kann mit diesem Request nicht geändert werden.

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

qsamRequestId → BC\_MODIFY\_ORDER\_FM\_RID

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

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

### 2.1.6.3 XONTRO Delete Order FM

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

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

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

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene DWZ-Ordernummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB\_BC\_ORDER\_NOEX.

In der Response ist nur der Header belegt.

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

In der Response ist nur der Header belegt.

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

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

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

Im Fehlerfall ist in der Response nur der Header belegt.

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

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

qsamRequestId → BC\_DELETE\_ORDER\_FM\_RID

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

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

### 2.1.7 Kurseingabe Front End für skontroführende Makler

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

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

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

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

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

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

### 2.1.7.1 XONTRO Start Pricing

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

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

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

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

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_START\_PRICING\_RID

|               |                           |   |
|---------------|---------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT   | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeId <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT        | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_start_pricingT | isinCod <sup>m</sup><br>trdResTypCod <sup>m</sup>   |
| Response Data | bc_response_headerT       | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim <sup>5</sup><br>errFieldRef<br>inSeqNo   |

<sup>5</sup> Im Feld execTranTim wird der Zeitpunkt des Setzens der Sperre (lockTim) hinterlegt Diese Zeit entspricht dem Inhalt des Feldes lockTim im Broadcast BCFE\_LOCK\_ORDERS.

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

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

### 2.1.7.2 XONTRO Enter Price

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

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

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

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

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

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests (technischer Completion Code ELB\_TECH\_OK) wird zusätzlich der Broadcast BCFE\_ENTER\_PRICE generiert und das Orderbuch in der Gattung entsperrt. Es wird **kein** zusätzlicher Broadcast vom Subtyp BCFE\_UNLOCK\_ORDERS verschickt.

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

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

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

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

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

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

<sup>6</sup> Die Einhaltung der Regeln wird von den Handelsüberwachungsstellen der Börsen wie bisher überwacht.

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

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

qsamRequestId → BC\_ENTER\_PRICE\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeId <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup>   |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_enter_priceT  | isinCod <sup>m</sup><br>tradMtchCod <sup>m</sup><br>tradMtchPrc <sup>m</sup><br>trdResTypCod <sup>m</sup><br>ordrBkExeQty <sup>o</sup><br>currExcRat <sup>o</sup><br>postProcFlag <sup>m</sup><br>ticket <sup>m</sup> |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeId<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

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

### 2.1.7.3 XONTRO Cancel Pricing

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

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

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

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

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

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird das Orderbuch in der Gattung entsperrt. Zusätzlich wird ein Broadcast BCFE\_UNLOCK\_ORDERS generiert.

qsamRequestId → BC\_CANCEL\_PRICING\_RID

|               |                            |   |
|---------------|----------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT    | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT         | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_cancel_pricingT | isinCod <sup>m</sup><br>ticket <sup>m</sup>   |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT   | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT        | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

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

#### 2.1.7.4 XONTRO Enter Price Plus

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_ENTER\_PRICE\_PLUS\_RID

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

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

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

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

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

### 2.1.7.5 XONTRO Enter Block Price

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

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

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

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

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

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

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

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

Alle Kursfeststellungen, die vom Back End akzeptiert wurden, werden dem Front End mit **einem einzigen Broadcast** vom Subtyp **BCFE\_ENTER\_BLOCK\_PRICE** im Stream der Order Updates zur Verfügung gestellt. Es wird keine Sperrnachricht vom Subtyp BCFE\_LOCK\_ORDERS erzeugt.

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

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

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

## 2.1.8 Nachbearbeitung Front End für skontroführende Makler

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

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

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

### 2.1.8.1 XONTRO Add Position

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

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

Das vom Back End im Broadcast BCFE\_LOCK\_ORDERS übermittelte Ticket ist mitzugeben.

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

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

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests bleibt das Ticket weiterhin gültig.

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_ADD\_POSITION\_RID

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

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

### 2.1.8.2 XONTRO Modify Execution

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

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

Das vom Back End im Broadcast BCFE\_LOCK\_ORDERS übermittelte Ticket ist mitzugeben.

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

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

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests bleibt das Ticket weiterhin gültig.

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_MODIFY\_EXECUTION\_RID

|               |                              |   |
|---------------|------------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT      | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeId <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT           | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_modify_executionT | isinCod <sup>m</sup><br>ordrNo <sup>m</sup><br>tradMtchPrcNo <sup>m</sup><br>tradMtchQty <sup>m</sup><br>ticket <sup>m</sup>            |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT     | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeId<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT          | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

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

### 2.1.8.3 XONTRO Finish Pricing

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

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

Das vom Back End im Broadcast BCFE\_LOCK\_ORDERS übermittelte Ticket ist mitzugeben.

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

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

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

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_FINISH\_PRICING\_RID

|               |                            |   |
|---------------|----------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT    | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeId <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT         | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_finish_pricingT | isinCod <sup>m</sup><br>tradMchPrcNo <sup>m</sup><br>ticket <sup>m</sup><br>currExcRat <sup>o</sup>                                     |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT   | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeId<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT        | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

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

## 2.1.9 Kursaussetzung und Nebenrechte vom Front End

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### 2.1.9.1 XONTRO Deactivate Pricing

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird ein Broadcast vom Subtype BCFE\_DEACTIVATE\_PRICING verschickt.

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

qsamRequestId → BC\_DEACTIVATE\_PRICING\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeId <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_dea_pricingT  | isinCod <sup>m</sup><br>deactFromDat <sup>m</sup><br>deactToDat <sup>o</sup><br>deactComment <sup>o</sup><br>deactText <sup>o</sup>     |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeId<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

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

### 2.1.9.2 XONTRO Deactivate Pricing Block

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

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

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

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

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

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

Wird diese Zahl beim nächsten Request überschritten, dann erhält die Applikation den Completion Code ELB\_BC\_MAXIMUM\_NUMBER\_EXCEEDED.

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

Alle Kursaussetzungen, die vom Back End akzeptiert wurden, werden dem Front End mit **einem einzigen Broadcast** vom Subtyp **BCFE\_DEACTIVATE\_PRICING\_BLOCK** zur Verfügung gestellt.

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

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

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

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

### 2.1.9.3 XONTRO Reactivate Pricing

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

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

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

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird ein Broadcast vom Subtype BCFE\_REACTIVATE\_PRICING verschickt.

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

qsamRequestId → BC\_REACTIVATE\_PRICING\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_rea_pricingT  | isinCod <sup>m</sup><br>deactText <sup>o</sup>  |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

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

#### 2.1.9.4 XONTRO Reactivate Pricing Block

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

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

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

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

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

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

Wird diese Zahl beim nächsten Request überschritten, dann erhält die Applikation den Completion Code ELB\_BC\_MAXIMUM\_NUMBER\_EXCEEDED.

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

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

Im Fall der Rücknahme der Kursaussetzung mit Übermittlung eines umsatzlosen Kurses wird zusätzlich der Broadcast BCFE\_ENTER\_BLOCK\_PRICE an den skontroführenden Makler übermittelt.

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

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

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

### 2.1.9.5 XONTRO Enter Special Right

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

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

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

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

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

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

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird ein Broadcast vom Subtype BCFE\_ENTER\_SP\_RIGHT verschickt.

qsamRequestId → BC\_ENTER\_SP\_RIGHT\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_sp_rightT     | nrCod <sup>m</sup><br>isinCod <sup>m</sup><br>isinCodNew <sup>o</sup><br>ordrExePrcMod <sup>o</sup><br>nrDat <sup>m</sup>               |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

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

bc\_response\_headerT

tranDat  
tranTim  
execTranDat  
execTranTim  
errFieldRef  
inSeqNo

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

### 2.1.10 Bestandsinformationen Orders

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsinformationen:

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

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

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

### 2.1.10.1 XONTRO Inquire Orders

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

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

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

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

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

qsamStreamId → BC\_INQUIRE\_ORDERS\_STREAM  
\_TYPE

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

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

### 2.1.10.2 XONTRO Inquire Special Order Updates

**Beschreibung** Der Stream **BC\_INQUIRE\_SPECIAL\_ORDERS\_STREAM\_TYPE** liefert dem Front End die Orders, die im Rahmen der Nebenrechtsverarbeitung in der Tagesende-verarbeitung des letzten vorhergegangenen Börsentags geändert oder gelöscht wurden. Orderänderungen bzw. Orderlöschungen, die im Rahmen des - der Tagesende-verarbeitung vorausgehenden - Buchungsschnitts erzeugt wurden, werden über die Subtypes **BCBE\_MODIFY\_ORDER\_N** bzw. **BCBE\_DELETE\_ORDER\_N** des **BC\_PRIVATE\_ORDER\_UPDATE\_STREAM\_TYPE** verteilt.

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

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

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

qsamStreamId → BC\_INQUIRE\_SPECIAL\_ORDERS\_STREAM\_TYPE

|      |                           |   |
|------|---------------------------|---|
| Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId |
|      | bc_key_inquireT           | bKeyInq   |
|      | <b>mehrfach</b>           |   |
|      | bc_subTypeT               | subType*  |
|      | bc_nrT <sup>7</sup>       | nrCod*<br>ordrExePrc*<br>ordrNo*<br>userNo*                                     |

<sup>7</sup> Die Struktur bc\_nrT wird sowohl bei Broadcasts als auch bei Requests/Responses verwendet.

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

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

### 2.1.11 Aktualisierung des Orderbestands, der Kursinformation und der Quotes

Die folgenden Tabellen beschreiben die Subtypes und Datenstrukturen der Broadcasts.

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

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

### 2.1.11.1 XONTRO Order Update

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

Lediglich die Ausführungsbestätigungen müssen über einen anderen Broadcaststream angefordert werden.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### 2.1.11.1 Ordereinstellung für einen Skontroführer (via Back End)

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

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

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

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

<sup>10</sup> Aus Kompatibilitätsgründen sowohl in bc\_brd\_pend\_ent\_orderT als auch bc\_response\_headerT enthalten.

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

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

*Diese Struktur wird auf der  
folgenden Seite fortgesetzt*

ordrResCod  
ordrStopLim  
text  
trdResTypCod  
userNo  
userOrdNum  
netTypCodXontro  
lockTim  
regulatoryID

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

### 2.1.11.1.2 Ordereinstellung für einen Freimakler (via Back End)

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

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

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

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

<sup>11</sup> Aus Kompatibilitätsgründen sowohl in bc\_orderT als auch bc\_response\_headerT enthalten.

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

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

ordrStopLim  
text  
trdResTypCod  
userNo  
userOrdNum  
netTypCodXontro  
regulatoryID

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

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

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

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

**Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.**

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

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

<sup>12</sup> Aus Kompatibilitätsgründen sowohl in bc\_orderT als auch bc\_response\_headerT enthalten.

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

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

ordrQty  
ordrResCod  
ordrStopLim  
text  
trdResTypCod  
userNo  
userOrdNum  
netTypCodXontro  
lockTim  
regulatoryID

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

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

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

**Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

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

**Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

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

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

**Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

### 2.1.11.1.7 Abgelehnte Ordereinstellung für einen Freimakler (via Front End)

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

**Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

### 2.1.11.1.8 Ordereinstellung für einen Skontroführer (via Front End)

**Beschreibung** Über den Subtype **BCFE\_ENTER\_ORDER\_SKM** erhalten die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers Nachricht über Ordereinstellungen, die am Front End getätigt wurden.

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

**Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

regulatoryID

### 2.1.11.1.9 Orderänderung (via Back End)

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

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

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

### 2.1.11.1.10 Umsetzung einer Stop Order durch das Back End

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

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

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

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

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

Wird eine Änderung endgültig durchgeführt, dann erhält das Front End einen Broadcast BCBE\_CONFIRM\_MODIFY\_ORDER.

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

**Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

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

Beschreibung Über den Subtype **BCBE\_CONFIRM\_MODIFY\_ORDER** wird dem Front End eines skontroführenden Maklers mitgeteilt, dass eine über den Subtype **BCBE\_PEND\_MODIFY\_ORDER** zugestellte vorläufige Änderung endgültig festgeschrieben (also durchgeführt) wird.

**Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

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

**Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

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

**Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

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

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

**Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

*Diese Struktur wird auf der  
folgenden Seite fortgesetzt*

text  
trdResTypCod  
userNo  
userOrdNum  
netTypCodXontro  
regulatoryID

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

### 2.1.11.1.16 Änderung einer Order des Skontroführers (via Front End)

**Beschreibung** Über den Subtype **BCFE\_MODIFY\_ORDER\_SKM** erhalten die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers Nachricht über Orderänderungen, die am Front End getätigt wurden.

**Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

### 2.1.11.1.17 Orderlöschung (via Back End)

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

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_del_orderT         | ordrNo<br>userNo<br>ordrQty <sup>13</sup><br>ordrStatCod<br>regulatoryID                                       |

<sup>13</sup> In Xontro kann es im Rahmen der Kursfeststellung zu Orderteillöschungen kommen. In diesem Fall liefert das Feld ordrQty nicht die aktuelle Nominale, sondern die gelöschte Teilnominale der Order. Über den Streamtype BC\_PRIVATE\_ORDER\_EXECUTION\_UPDATE\_STREAM\_TYPE wird nur die ausgeführte Nominale geliefert.

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

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

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

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

Wird eine Löschung endgültig durchgeführt, dann erhält das Front End einen Broadcast **BCBE\_CONFIRM\_DELETE\_ORDER**.

**Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

Beschreibung Wird eine über den Subtype **BCBE\_PEND\_DELETE\_ORDER** zugestellte vorläufige Löschung endgültig festgeschrieben (also durchgeführt), dann wird dem Front End eines skontroführenden Maklers die endgültige Festschreibung über den Subtype **BCBE\_CONFIRM\_DELETE\_ORDER** mitgeteilt.

**Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

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

**Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

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

**Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

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

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

**Dieser Broadcast wird nur Freimaklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

*Diese Struktur wird auf der  
folgenden Seite fortgesetzt*

trdResTypCod  
userNo  
userOrdNum  
netTypCodXontro  
regulatoryID

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

### 2.1.11.1.23 Löschung einer Order des Skontroführers (via Front End)

Beschreibung Über den Subtype **BCFE\_DELETE\_ORDER\_SKM** erhalten die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers Nachricht über Orderlöschungen, die am Front End getätigt wurden.

**Dieser Broadcast wird nur skontroführenden Maklern zur Verfügung gestellt.**

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

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

#### 2.1.11.1.24 Orderänderung wegen Nebenrecht

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

Orderänderungen, die im Rahmen der Tagesendeverarbeitung erzeugt wurden, werden im Stream **BC\_INQUIRE\_SPECIAL\_ORDERS\_STREAM\_TYPE** geliefert.

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

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

### 2.1.11.1.25 Orderlöschung wegen Nebenrecht

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

Orderlöschungen, die im Rahmen der Tagesendeverarbeitung erzeugt wurden, werden im Stream **BC\_INQUIRE\_SPECIAL\_ORDERS\_STREAM\_TYPE** geliefert..

Die Datenstruktur entspricht der Orderänderung wegen Nebenrecht (bc\_qsambroadcast\_headerT + bc\_broadcast\_headerT + bc\_nrT).

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

### 2.1.11.1.26 Sperren durch das Back End

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

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

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

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

### 2.1.11.1.27 Sperren durch das Front End

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

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

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

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

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_lockT              | lockTim<br>ticket <sup>14</sup><br>trdResTypCod<br>userNo  |

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

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

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

### 2.1.11.1.28 Entsperrn durch das Back End

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

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

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

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

### 2.1.11.1.29 Entsperrn durch das Front End

**Beschreibung** Über den Subtype **BCFE\_UNLOCK\_ORDERS** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über das Entsperrn des Orderbuchs durch das Front End informiert.

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

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

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

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

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

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

### 2.1.11.1.30 Kursfeststellung am Back End

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

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

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

**Auf die folgenden Besonderheiten ist zu achten:**

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

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

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

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

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

*Diese Struktur wird auf der  
folgenden Seite fortgesetzt*

trdResTypCod  
lockTim  
confirmTim  
ordrBkExeQty  
postProcFlag  
tradMtchPrcTim  
tradMtchPrcTimFraction  
tradMtchPrcDat  
venueMic

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

### 2.1.11.1.31 Kursfeststellung am Front End (XONTRO Enter Price)

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

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

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

Die für den Subtype **BCBE\_ENTER\_PRICE** geltenden Hinweise sind zu berücksichtigen.

Die Datenstruktur entspricht der Kursfeststellung am Back End (bc\_qsambroadcast\_headerT + bc\_broadcast\_headerT + bc\_brd\_ent\_priceT).

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

### 2.1.11.1.32 Kursfeststellung am Front End (XONTRO Enter Price Plus)

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

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

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

Die für den Subtype **BCBE\_ENTER\_PRICE** geltenden Hinweise sind zu berücksichtigen.

Der Broadcast **BCFE\_ENTER\_PRICE\_PLUS** enthält alle Informationen, die nach einer Kursfeststellung mittels Request XONTRO Enter Price in den Broadcasts BCFE\_LOCK\_ORDERS, BCFE\_ENTER\_PRICE, BCFE\_ADD\_POSITION, BCFE\_FINISH\_PRICING enthalten sind.

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

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

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

### 2.1.11.1.33 Eingabe halbes Geschäft am Back End

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

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

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

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

### 2.1.11.1.34 Eingabe halbes Geschäft am Front End

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

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

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

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

### 2.1.11.1.35 Teilausführung am Back End

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

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

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

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

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

### 2.1.11.1.36 Teilausführung am Front End

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

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

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

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

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

### 2.1.11.1.37 Ende Nachbearbeitung am Back End

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

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

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

### 2.1.11.1.38 Ende Nachbearbeitung am Front End

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

Die Datenstruktur entspricht der Ende Nachbearbeitung am Back End (bc\_qsambroadcast\_headerT + bc\_broadcast\_headerT + bc\_brd\_finish\_pricingT).

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

### 2.1.11.1.39 Eingabe von Quotes am Back End

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

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

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

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

#### 2.1.11.1.40 Deaktivierung von Quotes am Back End

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

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

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

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

#### 2.1.11.1.41 Tabellarische Kursfeststellung

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

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

Die Datenstruktur entspricht der Kursfeststellung am Back End (bc\_qsambroadcast\_headerT + bc\_broadcast\_headerT + bc\_brd\_ent\_priceT).

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

#### 2.1.11.1.42 Tabellarische Kursänderung

**Beschreibung** Über den Subtype **BCBE\_ENTER\_PRICE\_MODIFICATION\_TAB** werden tabellarisch erfasste Kursänderungen übermittelt. Die Kurse sind umsatzlos, zum Zeitpunkt der Erfassung darf kein ausführbares Volumen vorgelegen haben.

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

Die Datenstruktur entspricht der Kursfeststellung am Back End (bc\_qsambroadcast\_headerT + bc\_broadcast\_headerT + bc\_brd\_ent\_priceT).

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

### 2.1.11.1.43 Umsatzlose Kurseingabe über das Front End

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

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

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

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

|                |   |  |
|----------------|---|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT                 | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId  |
|                | bc_broadcast_headerT                      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod <sup>15</sup><br>subType |
|                | bc_brd_confirm_tim_bypassT<br>bc_counterT | confirmTimBypass<br>counter  |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

<sup>15</sup> bei diesem Subtype immer mit Spaces belegt

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

*bis zu 30 Einträge*

bc\_brd\_ent\_block\_priceT

isinCod\*

tradMtchCod\*

tradMtchPrc\*

tradMtchPrcNo\*

trdResTypCod\*

lockTim\*

tradMtchPrcTim\*

tradMtchPrcTimFraction\*

tradMtchPrcDat\*

venueMic\*

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

#### 2.1.11.1.44 Kurseingabe manuell

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

Für nachfolgende manuelle Änderungen oder Löschungen (siehe Subtype **BCBE\_ENTER\_PRICE\_MODIFICATION\_MAN**) kann der neu eingefügte Kurs in der Kurskette über die Einstellzeit im Feld enterTim identifiziert werden.

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

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

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

#### 2.1.11.1.45 Kursänderung manuell

**Beschreibung** Über den Subtype **BCBE\_ENTER\_PRICE\_MODIFICATION\_MAN** werden die Maklersysteme eines skontroführenden Maklers über die manuellen „rein informativischen“ Änderungen und Löschungen von Kursfeststellungen informiert. Die Eingabe dieser Kursänderung / -löschung erfolgte über die Funktionen BCOS/KU bzw. BROS/KU in der Xontro Dialog-Anwendung oder über den Request BC\_RESET\_PRICE\_RID.

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

1. **über das Orderbuch** eingestellt wurde, wird im Feld „refTim“ die ursprüngliche **Kursbestätigungszeit** („execTranTim“ oder „tradMtchPrcTim“ aus den Broadcasts  
BCBE\_ENTER\_PRICE,  
BCFE\_ENTER\_PRICE,  
BCBE\_ENTER\_PRICE\_TAB,  
BCBE\_ENTER\_PRICE\_MODIFICATION\_TAB,  
BCFE\_ENTER\_BLOCK\_PRICE)  
geliefert.

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

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

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

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

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

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

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

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



### 2.1.11.1.46 Eingabe von Quotes am Front End

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

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

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

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

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

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

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

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



### 2.1.11.1.47 Deaktivierung von Quotes am Front End

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

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

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

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

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

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

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

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

### 2.1.11.2 XONTRO Order Update Retransmission

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

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

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

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

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

### 2.1.11.2.1 XONTRO Request Update Retransmission

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

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

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

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_RET\_ORDER\_UPDATE\_RID

|              |                         |   |
|--------------|-------------------------|---|
| Request Data | bc_qsam_request_headerT | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|              | bc_request_headerT      | inSeqNo <sup>o</sup>  |
|              | bc_request_retransT     | startStmSeqNo <sup>m</sup><br>stopStmSeqNo <sup>m</sup>   |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

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

qsamStreamId → BC\_RET\_ORDER\_UPDATE\_STREAM\_TYPE

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

|      |                           |   |
|------|---------------------------|---|
| Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId   |
|      | bc_broadcast_headerT      | tranDat*<br>tranTim*<br>execTranDat*<br>execTranTim*<br>errFieldRef*<br>outSeqNo*<br>bkrUserNo*<br>isinCod*<br>subType* |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

(bc\_orderT,  
bc\_brd\_mod\_orderT,  
bc\_brd\_del\_orderT,  
bc\_nrT,  
bc\_brd\_pend\_ent\_orderT,  
bc\_brd\_pend\_mod\_orderT,  
bc\_brd\_pend\_del\_orderT,  
bc\_brd\_lockT,  
bc\_brd\_unlockT,  
bc\_brd\_ent\_priceT,  
bc\_brd\_ent\_price\_plusT,  
bc\_brd\_ent\_block\_priceT,  
bc\_brd\_finish\_pricingT,  
bc\_brd\_ent\_quoteT,  
bc\_brd\_deact\_quoteT,  
bc\_brd\_ent\_price\_manT,  
bc\_brd\_ent\_quote\_feT,  
bc\_brd\_deact\_quote\_feT)

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

### 2.1.12 Aktualisierung der Orderausführungen

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsinformationen:

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

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

### 2.1.12.1 XONTRO Execution Confirmation Update

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

| Subtype                          | Verwendung   |
|----------------------------------|--|
| BCBE_EXECUTION_SKM               | Orderauszeichnung durch den Skontroführer, Nachricht für den Skontroführer |
| BCBE_END_EXECUTION <sup>16</sup> | Abschluss der Ausführungen zu einem Kurs für einen Skontroführer           |
| BCBE_EXECUTION_SKM_TO_FM         | Orderauszeichnung durch den Skontroführer, Nachricht für den Freimakler    |

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

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

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

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

### 2.1.12.1.1 Ausführungsbestätigungen

Beschreibung Über die Subtypes **BCBE\_EXECUTION\_SKM** und **BCBE\_EXECUTION\_SKM\_TO\_FM** werden die Orderausführungen zugestellt:  
Die Felder tradMtchPrcTim und tradMtchPrcDat enthalten den Zeitpunkt und das Datum der Kursfeststellung.

qsamStreamId → BC\_PRIVATE\_ORDER\_EXECUTION\_UPDATE\_STREAM\_TYPE

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

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

### 2.1.12.1.2 Abschluss der Ausführungen

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

qsamStreamId→ BC\_PRIVATE\_ORDER\_EXECUTION\_UPDATE\_STREAM\_TYPE

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

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

### 2.1.12.2 XONTRO Execution Confirmation Retransmission

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

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

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

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

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

### 2.1.12.2.1 XONTRO Request Execution Confirmation Retransmission

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

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

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_RET\_ORDER\_EXECUTION\_UPDATE\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>o</sup>  |
|               | bc_request_retransT      | startStmSeqNo <sup>m</sup><br>stopStmSeqNo <sup>m</sup>   |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |

*Diese Struktur wird auf der  
folgenden Seite fortgesetzt*

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

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

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

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

### 2.1.13 Quoteverwaltung Front End für skontroführende Makler

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

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

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

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

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

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

### 2.1.13.1 XONTRO Enter Quote

**Beschreibung** Der Request **XONTRO Enter Quote** dient dem skontroführenden Makler zur Einstellung (bzw. Löschung<sup>17</sup>) eines Quotes in das Orderbuch der Dialoganwendung (BxOS/OM) auf dem XONTRO Back End. Zusätzlich werden diese Quotes über die Börsen-Anwendung der Kurs- und Quotevermarktung veröffentlicht.

Alle Angaben sind verbindlich.

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

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

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

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

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

Ist noch keine aktuelle **confirmTim** verfügbar, so ist die **confirmTim** mit **BC\_INIT\_CONFIRM\_TIM** zu belegen.

Sollen die Quotes ohne Prüfung der **confirmTim** am Back End eingestellt werden, so ist die **confirmTim** im Request mit dem Wert **BC\_DO\_NOT\_CHECK\_CONFIRM\_TIM** zu belegen.

**Achtung: Dies kann zu nicht marktgerechten Quotes führen.**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ELB\_BC\_INSEQNO\_OUTDATED

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

Bei einer Ablehnung mit

ELB\_BC\_CONFIRM\_TIM\_OUTDATED

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

Wird der Request mit dem qsamComplCode

ELB\_BC\_QUOTING\_STOPPED

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

Eine mögliche Wiederaufnahme wird ebenfalls über diesen Stream publiziert.

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

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

qsamRequestId → BC\_ENTER\_QUOTE\_RID

|              |                         |  |
|--------------|-------------------------|--|
| Request Data | bc_qsam_request_headerT | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup>  |
|              | bc_request_headerT      | inSeqNo <sup>m</sup>   |
|              | bc_request_ent_quoteT   | isinCod <sup>m</sup><br>ordrExePrcAsk <sup>m</sup><br>ordrQtyAsk <sup>m</sup><br>ordrExePrcBid <sup>m</sup><br>ordrQtyBid <sup>m</sup><br>confirmTim <sup>m</sup><br>quoteTimeStamp <sup>o</sup> |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

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

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

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

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

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

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

### 2.1.13.2 XONTRO Enter Mass Quote

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

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

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

Für die Quote-Bypass-Verarbeitung ist pro Börsenplatz und KV-Nummer ein gesonderter Login mit der Request-Id **BC\_LOGIN\_QUOTE\_BYASS\_RID** erforderlich, siehe Kapitel Login.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

bc\_response\_headerT

tranDat  
tranTim  
execTranDat  
execTranTim  
errFieldRef  
inSeqNo

*bis zu 50 Einträge:*

bc\_response\_ent\_mass\_quoteT

quoteReturnCod \*

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

## 2.1.14 Aufgabenverwaltung Front End

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

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

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

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

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

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

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

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

### 2.1.14.1 XONTRO Enter Broker Trade

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

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

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests wird zusätzlich der Broadcast BCFE\_ENTER\_BTRADE oder BCFE\_ENTER\_BTRADE\_2 generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat kann entscheiden, ob sie die Response verarbeitet oder ignoriert. Im zweiten Fall muss der Broadcast ausgewertet werden.

qsamRequestId → BC\_ENTER\_BROKER\_TRADE\_RID

|              |                         |  |
|--------------|-------------------------|--|
| Request Data | bc_qsam_request_headerT | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup>  |
|              | bc_request_headerT      | inSeqNo <sup>m</sup>   |
|              | bc_request_ent_btradeT  | bkrNo <sup>m</sup><br>buyCod <sup>m</sup><br>ctpyNo <sup>m</sup><br>tradMtchPrc <sup>m</sup><br>tradMtchQty <sup>m</sup><br>currExcRat <sup>o</sup><br>valueDatCod <sup>o</sup><br>valueDat <sup>o</sup><br>acrIntDay <sup>o</sup><br>acrIntDayCod <sup>o</sup><br>bonusRat <sup>o</sup><br>acctTypCodXontro <sup>o</sup><br>matchFlag <sup>o</sup><br>iwOrdCod <sup>o</sup><br>isinCod <sup>m</sup> |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

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

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
|               |                          | feeFlag °<br>fee °<br>textTrad °<br>tradBegDat °<br>tradContTim <sup>m</sup><br>tradContDat <sup>r</sup><br>trdTypXontro °<br>repExchangeld °<br>shortSellCod ° |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

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

### 2.1.14.2 XONTRO Delete Broker Trade

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

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene Aufgabennummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB\_BC\_BTRADE\_ERROR.

In der Response ist nur der Header belegt.

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests erhält die MISS eine positive Response, in der nur der Header belegt ist.

Zusätzlich wird ein Broadcast generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, kann entscheiden, ob sie die Response verarbeitet oder ignoriert. Im zweiten Fall muss der Broadcast ausgewertet werden. Dabei wird die inSeqNo dieses Request im Feld inSeqNoRef des Broadcasts zurückgegeben.

qsamRequestId → BC\_DELETE\_BROKER\_TRADE\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_del_btradeT   | btradeNo <sup>m</sup><br>isinCod <sup>m</sup>   |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT      | tranDat   |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 154                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

tranTim  
execTranDat  
execTranTim  
errFieldRef  
inSeqNo

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 155                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.14.3 XONTRO Match Broker Trade

**Beschreibung** Der Request **XONTRO Match Broker Trade** dient dem Makler zum Schließen von Aufgaben. Dabei können Aufgaben sowohl gegeneinander als auch gegen halbe Geschäfte geschlossen werden. Eine Aufgabe wird dabei durch die Aufgabennummer (btradeNoAsk oder btradeNoBid) identifiziert.

Durch die Belegung des Feldes settlementFlag mit dem Wert „KM“ (keine Meldesatzgenerierung) kann bei der Schließung von zwei vorläufigen Aufgaben die Meldesatzgenerierung unterdrückt werden. Das Feld wird auf Vorrat eingerichtet, nähere Erläuterungen erfolgen zu einem späteren Zeitpunkt durch die BrainTrade.

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene Aufgabennummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB\_BC\_BTRADE\_ERROR.

In der Response ist nur der Header belegt.

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests erhält die MISS eine positive Response, in der nur der Header belegt ist.

Bei erfolgreicher Durchführung der Folgeverarbeitung auf dem Back End wird zusätzlich ein Broadcast generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, muss den Broadcast auswerten, da aus einer positiven Response nicht auf eine erfolgreiche Durchführung der asynchron ablaufenden Folgeverarbeitung auf dem Back End geschlossen werden kann. Dabei wird die inSeqNo dieses Request im Feld inSeqNoRef des Broadcasts zurückgegeben.

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 156                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

qsamRequestId → BC\_MATCH\_BROKER\_TRADE\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup>   |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_match_btradeT | btradeNoAsk <sup>o</sup><br>btradeNoBid <sup>o</sup><br>ctpyNo <sup>o</sup><br>tradMtchPrc <sup>o</sup><br>redQty <sup>m</sup><br>isinCod <sup>m</sup><br>feeFlag <sup>o</sup><br>fee <sup>o</sup><br>currExcRat <sup>o</sup><br>acctTypCodXontro <sup>o</sup><br>tradBegDat <sup>o</sup><br>tradContTim <sup>m</sup><br>tradContDat <sup>o</sup><br>trdTypXontro <sup>o</sup><br>repExchangeld <sup>o</sup><br>customerIdClass <sup>o</sup><br>customerId <sup>o</sup><br>commissionAgentFlag <sup>o</sup><br>settlementFlag <sup>o</sup><br>textTrad <sup>o</sup> |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 157                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

#### 2.1.14.4 XONTRO Match All Broker Trades

**Beschreibung** Der Request **XONTRO Match All Broker Trades** dient dem Makler dazu, das Back End zum Schließen aller möglichen Aufgaben einer ISIN gegeneinander zu veranlassen. Diese Funktion ist auf der Ebene ISIN/bkrUserNo nur exklusiv verwendbar.

Erkennt das Back End, dass diese Funktion bereits für die gleiche Kombination ISIN/bkrUserNo in Benutzung ist, dann erhält das Front End den Completion Codes (qsamComplCode) ELB\_BC\_NOT\_AVAILABLE.

In der Response ist nur der Header belegt.

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests erhält die MISS eine positive Response, in der nur der Header belegt ist. Bei erfolgreicher Durchführung der Folgeverarbeitung auf dem Back End wird zusätzlich ein Broadcast generiert. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, muss den Broadcast zur Ermittlung der durchgeführten Schließungen auswerten, da aus einer positiven Response nicht auf eine erfolgreiche Durchführung der asynchron ablaufenden Folgeverarbeitung auf dem Back End geschlossen werden kann. Jede Aufgabenschließung wird über diesen Broadcast mitgeteilt. Dabei wird die inSeqNo dieses Request im Feld inSeqNoRef des Broadcasts zurückgegeben.

Die Anzahl der Aufgaben, welche mit diesem Request geschlossen werden können, ist wegen technischer Restriktionen beschränkt. Liegt die Anzahl der zu schließenden Aufgaben unter 403, können sie mit einem Request geschlossen werden. Bis zu einer Anzahl von 700 können sie mit zwei Requests geschlossen werden. Eine Schließung von mehr als 700 Aufgaben ist nicht möglich.

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 158                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

qsamRequestId → BC\_MATCH\_ALL\_BROKER\_TRADES\_RID

|               |                               |   |
|---------------|-------------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT       | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT            | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_match_all_btradesT | isinCod <sup>m</sup>  |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT      | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT           | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 159                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.15 Bestandsinformationen Aufgaben

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsstrukturen:

|                        |  |
|------------------------|--|
| qsamStreamId           | BC_INQUIRE_BROKER_TRADES_STREAM_TYPE   |
| qsamMsgType            | I = Bestandstransfer (Initialbestand)  |
| Correlation ID         | qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId   |
| Message ID             | bKeyInq  |
| Bestandstransfer Queue | XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>  |
| Data                   | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_btradeT) oder bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_btrade_2T) |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 160                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.15.1 XONTRO Inquire Broker Trades

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

Es werden zwei unterschiedliche Datenformate zu Verfügung gestellt. Welches der beiden Formate ein Anwender erhält, wird über das Profiling gesteuert. Die Struktur **bc\_btrade\_2T** kann nicht von allen Teilnehmern angefordert werden. Die Teilnehmer sind selbst dafür verantwortlich, dass in ihren Applikationen die jeweils korrekte Struktur benutzt wird.

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

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

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType **BCBE\_BTRADES\_END** feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn für eine KV-Nummer keine Aufgaben vorliegen. Im Standardfall ist subType mit **BCBE\_BTRADE** bzw. **BCBE\_BTRADE\_2** belegt.

|                |                                      |   |
|----------------|--------------------------------------|---|
| qsamStreamId → | BC_INQUIRE_BROKER_TRADES_STREAM_TYPE | <b>Format 1</b>   |
| Data           | bc_qsam_broadcast_headerT            | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId |
|                | bc_key_inquireT                      | bKeyInq   |
|                | <b>mehrfach</b><br>bc_subTypeT       | subType*  |
|                | bc_btradeT                           | btradeNo*<br><br>bkrNo*<br>bkrSubNo*  |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 161                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

exchangeld\*  
 buyCod\*  
 ctpyNo\*  
 ctpySubNo\*  
 ctpyExchangeld\*  
 ctpyLei\*  
 tranExchangeld\*  
 btradeCod\*  
 tradMtchPrc\*  
 tradMtchQty\*  
 ordrQty\*  
 clearingCurrTypCod\*  
 currExcRat\*  
 valueDatCod\*  
 valueDat\*  
 acrIntDay\*  
 acrIntDayCod\*  
 bonusRat\*  
 tradMtchPrcNo\*  
 acctTypCodXontro \*  
 iwOrdCod\*  
 isinCod\*  
 isinCodSrs\*  
 tradBegDat\*  
 tradContTim\*  
 tradContTimFraction\*  
 tradContDat\*  
 repExchangeld\*  
 trdTypXontro\*  
 tvTic\*  
 venueMic\*  
 shortSellCod\*  
 otcPostTradInd\*

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 162                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

|                |  |   |
|----------------|--|---|
| qsamStreamId → | BC_INQUIRE_BROKER_TRADES_STRE<br>AM_TYPE | <b>Format 2</b>   |
| Data           | bc_qsam_broadcast_headerT                | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId   |
|                | bc_key_inquireT                          | bKeyInq <sup>m</sup>  |
|                | <b>mehrfach</b>                          |   |
|                | bc_subTypeT                              | subType*  |
|                | bc_btrade_2T                             | btradeNo*<br>bkrNo*<br>bkrSubNo*<br>exchangeld*<br>buyCod*<br>ctpyNo*<br>ctpySubNo*<br>ctpyExchangeld*<br>ctpyLei*<br>tranExchangeld*<br>btradeCod*<br>tradMtchPrc*<br>tradMtchQty*<br>ordrQty*<br>clearingCurrTypCod*<br>currExcRat*<br>valueDatCod*<br>valueDat*<br>acrIntDay*<br>acrIntDayCod*<br>bonusRat*<br>tradMtchPrcNo*<br>acctTypCodXontro *<br>iwOrdCod*<br>isinCod*<br>isinCodSrs*<br>tradBegDat*<br>tradContTim* |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 163                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

*Diese Struktur wird auf der folgenden  
Seite fortgesetzt*

tradContTimFraction\*  
tradContDat\*  
repExchangeld\*  
feeFlag\*  
fee\*  
textTrad\*  
ctpyTradMtchPrc\*  
trdTypXontro\*  
tvTic\*  
venueMic\*  
shortSellCod\*  
otcPostTradInd\*

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 164                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16 Aktualisierung des Aufgabenbestands

Die folgenden Tabellen beschreiben die Subtypes und Datenstrukturen der Broadcasts.

|                 |   |
|-----------------|---|
| qsamStreamId    | BC_PRIVATE_BROKER_TRADE_UPDATE_STREAM_TYPE  |
| qsamMsgId       | B = Broadcast   |
| Correlation ID  | qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId  |
| Message ID      | outSeqNo  |
| Broadcast Queue | XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>   |
| Response Data   | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + (eine der Strukturen vom Typ bc_brd_ent_temp_btradeT, bc_brd_mod_temp_btradeT, bc_brd_del_temp_btradeT, bc_brd_ent_btradeT, bc_brd_ent_btrade_2T, bc_brd_ent_btrade_feT, bc_brd_ent_btrade_fe_2T, bc_brd_can_btradeT, bc_brd_del_btradeT, bc_brd_can_btrade_feT, bc_brd_del_btrade_feT, bc_brd_match_btradeT, bc_brd_mod_btradeT, bc_brd_match_btrade_feT) |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 165                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.16.1 XONTRO Broker Trade Update

**Beschreibung** Der Stream XONTRO Broker Trade Update versorgt das Front End mit allen auf dem Back End durchgeführten Änderungen des Aufgabenbestands. Folgende Subtypes werden hierfür<sup>18</sup> angeliefert:

| Subtype                 | Verwendung  |
|-------------------------|---|
| BCBE_ENTER_TEMP_BTRADE  | Erzeugung einer temporären Aufgabe (Seitenüberhang)   |
| BCBE_MODIFY_TEMP_BTRADE | Änderung einer temporären Aufgabe                     |
| BCBE_DELETE_TEMP_BTRADE | Löschung einer temporären Aufgabe                     |
| BCBE_ENTER_BTRADE       | Erzeugung einer neuen Aufgabe am Back End             |
| BCBE_ENTER_BTRADE_2     | Erzeugung einer neuen Aufgabe am Back End (Format 2)  |
| BCFE_ENTER_BTRADE       | Erzeugung einer neuen Aufgabe am Front End            |
| BCFE_ENTER_BTRADE_2     | Erzeugung einer neuen Aufgabe am Front End (Format 2) |
| BCBE_DELETE_BTRADE      | Löschung einer neuen Aufgabe am Back End              |
| BCBE_CANCEL_BTRADE      | Stornierung einer neuen Aufgabe am Back End           |
| BCFE_DELETE_BTRADE      | Löschung einer neuen Aufgabe am Front End             |
| BCFE_CANCEL_BTRADE      | Stornierung einer neuen Aufgabe am Front End          |
| BCBE_MATCH_BTRADE       | Schließung von Aufgaben am Back End                   |
| BCFE_MATCH_BTRADE       | Schließung von Aufgaben am Front End                  |
| BCBE_MODIFY_BTRADE      | Änderung einer Aufgabe am Back End                    |

<sup>18</sup> Über diesen Stream werden auch die Broadcastnachrichten für den Handel unter Maklern (HUM) verschickt. Diese Subtypes und ihre Strukturen werden im Abschnitt **Informationen zum Handel unter Maklern (HUM)** beschrieben.

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

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 166                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.1 Erzeugung einer temporären Aufgabe

Beschreibung Über den Subtype **BCBE\_ENTER\_TEMP\_BTRADE** werden dem Front End auf dem Back End erzeugte temporäre Aufgaben (Seitenüberhänge die direkt bei der Kursfeststellung entstehen) zugestellt:

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_ent_temp_btradeT   | buyCod<br>tradMtchPrc<br>tradMtchQty<br>tradMtchPrcNo<br>isinCod<br>isinCodSrs<br>tradEnterDat                 |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 167                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.2 Änderung einer temporären Aufgabe

Beschreibung Über den Subtype **BCBE\_MODIFY\_TEMP\_BTRADE** werden dem Front End die auf dem Back End erzeugten Änderungen temporärer Aufgaben zugestellt:

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_mod_temp_btradeT   | buyCod<br>changeQty<br>tradMtchPrcNo<br>isinCod  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 168                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.3 Löschung einer temporären Aufgabe

Beschreibung Über den Subtype **BCBE\_DELETE\_TEMP\_BTRADE** werden dem Front End die auf dem Back End durchgeführten Löschungen temporärer Aufgaben zugestellt:

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_del_temp_btradeT   | buyCod<br>changeQty<br>tradMtchPrcNo<br>isinCod  |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 169                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

#### 2.1.16.1.4 Erzeugung einer Aufgabe am Back End

**Beschreibung** Abhängig von den Einstellungen des Profilings werden dem Front End die auf dem Back End neu erzeugte Aufgaben (vorläufig oder endgültig) über einen der beiden Subtypes **BCBE\_ENTER\_BTRADE** oder **BCBE\_ENTER\_BTRADE\_2** zugestellt. Zu beachten ist, dass für den Subtype **BCBE\_ENTER\_BTRADE\_2** die zusätzlichen Angaben fee, feeFlag und textTrad nur für endgültige Aufgaben geliefert werden.

Kommt ein solcher Broadcast durch die Stornierung einer Schließung zustande, dann werden die Zusatzangaben für eine wieder aktivierte, endgültige Aufgabe nur dann geliefert, wenn sie nicht früher als zwei Tage zuvor entstanden ist.

Ist dies nicht der Fall, dann werden die Zusatzangaben mit ihren Initialwerten belegt.

#### BCBE\_ENTER\_BTRADE

#### Format 1

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId  |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType   |
|                | bc_brd_ent_btradeT        | btradeNo<br>bkrNo<br>bkrSubNo<br>exchangeld<br>buyCod<br>ctpyNo<br>ctpySubNo<br>ctpyExchangeld<br>ctpyLei<br>tranExchangeld<br>btradeCod<br>tradMtchPrc<br>tradMtchQty |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 170                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

ordQty  
 clearingCurrTypCod  
 currExcRat  
 valueDatCod  
 valueDat  
 acrIntDay  
 acrIntDayCod  
 bonusRat  
 tradMtchPrcNo  
 acctTypCodXontro  
 iwOrdCod  
 isinCod  
 isinCodSrs  
 tradBegDat  
 tradContTim  
 tradContTimFraction  
 tradContDat  
 repExchangeld  
 trdTypXontro  
 tvTic  
 venueMic  
 shortSellCod  
 otcPostTradInd

## BCBE\_ENTER\_BTRADE\_2

Broadcast Data      bc\_qsam\_broadcast\_headerT

## Format 2

qsamId  
 qsamMsgType  
 qsamExchangeld  
 qsamDat  
 qsamBkrNo  
 qsamStreamId

bc\_broadcast\_headerT

tranDat  
 tranTim  
 execTranDat  
 execTranTim  
 errFieldRef  
 outSeqNo  
 bkrUserNo  
 isinCod

*Diese Struktur wird auf der  
folgenden Seite fortgesetzt*

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



|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 171                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

bc\_brd\_ent\_btrade\_2T

subType  
btradeNo  
bkrNo  
bkrSubNo  
exchangeld  
buyCod  
ctpyNo  
ctpySubNo  
ctpyExchangeld  
ctpyLei  
tranExchangeld  
btradeCod  
tradMtchPrc  
tradMtchQty  
ordrQty  
clearingCurrTypCod  
currExcRat  
valueDatCod  
valueDat  
acrIntDay  
acrIntDayCod  
bonusRat  
tradMtchPrcNo  
acctTypCodXontro  
iwOrdCod  
isinCod  
isinCodSrs  
tradBegDat  
tradContTim  
tradContTimFraction  
tradContDat  
repExchangeld  
feeFlag  
fee  
textTrad  
ctpyTradMtchPrc  
trdTypXontro  
tvTic  
venueMic  
shortSellCod  
otcPostTradInd

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 172                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.5 Erzeugung einer neuen Aufgabe am Front End

**Beschreibung** Abhängig von den Einstellungen des Profilings werden dem Front End die auf dem Front End neu erzeugte Aufgaben (vorläufig oder endgültig) über einen der beiden Subtypes **BCFE\_ENTER\_BTRADE** oder **BCFE\_ENTER\_BTRADE\_2** zugestellt.

Kommt ein solcher Broadcast durch die Stornierung einer Schließung zustande, dann werden die Zusatzangaben für eine wieder aktivierte, endgültige Aufgabe nur dann geliefert, wenn sie nicht früher als zwei Tage zuvor entstanden ist.

Ist dies nicht der Fall, dann werden die Zusatzangaben mit ihren Initialwerten belegt.

#### BCFE\_ENTER\_BTRADE

#### Format 1

|                |                           |   |
|----------------|---------------------------|---|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId   |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType  |
|                | bc_brd_ent_btrade_feT     | btradeNo<br>bkrNo<br>bkrSubNo<br>exchangeld<br>buyCod<br>ctpyNo<br>ctpySubNo<br>ctpyExchangeld<br>ctpyLei<br>tranExchangeld<br>btradeCod<br>tradMtchPrc<br>tradMtchQty<br>ordrQty |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 173                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

clearingCurrTypCod  
currExcRat  
valueDatCod  
valueDat  
acrIntDay  
acrIntDayCod  
bonusRat  
tradMchPrcNo  
acctTypCodXontro  
iwOrdCod  
isinCod  
isinCodSrs  
tradBegDat  
tradContTim  
tradContTimFraction  
tradContDat  
repExchangeld  
inSeqNoRef  
trdTypXontro  
tvTic  
venueMic  
shortSellCod  
otcPostTradInd

## BCFE\_ENTER\_BTRADE\_2

Broadcast Data      bc\_qsam\_broadcast\_headerT

## Format 2

qsamId  
qsamMsgType  
qsamExchangeld  
qsamDat  
qsamBkrNo  
qsamStreamId

bc\_broadcast\_headerT

tranDat  
tranTim  
execTranDat  
execTranTim  
errFieldRef  
outSeqNo  
bkrUserNo  
isinCod  
subType

*Diese Struktur wird auf der  
folgenden Seite fortgesetzt*

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



|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 174                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

bc\_brd\_ent\_btrade\_fe\_2T

btradeNo  
 bkrNo  
 bkrSubNo  
 exchangeld  
 buyCod  
 ctpyNo  
 ctpySubNo  
 ctpyExchangeld  
 ctpyLei  
 tranExchangeld  
 btradeCod  
 tradMtchPrc  
 tradMtchQty  
 ordrQty  
 clearingCurrTypCod  
 currExcRat  
 valueDatCod  
 valueDat  
 acrlntDay  
 acrlntDayCod  
 bonusRat  
 tradMtchPrcNo  
 acctTypCodXontro  
 iwOrdCod  
 isinCod  
 isinCodSrs  
 tradBegDat  
 tradContTim  
 tradContTimFraction  
 tradContDat  
 repExchangeld  
 feeFlag  
 fee  
 textTrad  
 inSeqNoRef  
 ctpyTradMtchPrc  
 trdTypXontro  
 tvTic  
 venueMic  
 shortSellCod  
 otcPostTradInd

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 175                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.6 Löschung einer Aufgabe am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE\_DELETE\_BTRADE** werden am Back End durchgeführte Löschungen von Aufgaben zugestellt.

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_del_btradeT        | btradeNo<br>isinCod  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 176                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.7 Stornierung einer Aufgabe am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE\_CANCEL\_BTRADE** werden am Back End durchgeführte Stornierungen von Aufgaben zugestellt.

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_can_btradeT        | btradeNo<br>isinCod  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 177                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.8 Löschung einer Aufgabe am Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE\_DELETE\_BTRADE** werden am Front End durchgeführte Löschungen von Aufgaben zugestellt:

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_del_btrade_feT     | btradeNo<br>isinCod<br>inSeqNoRef  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 178                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.9 Stornierung einer Aufgabe am Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE\_CANCEL\_BTRADE** werden am Front End durchgeführte Stornierungen von Aufgaben zugestellt:

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_can_btrade_feT     | btradeNo<br>isinCod<br>inSeqNoRef  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 179                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.10 Schließung von Aufgaben am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE\_MATCH\_BTRADE** werden am Back End durchgeführte Schließungen von Aufgaben zugestellt.

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_match_btradeT      | btradeNo<br>changeQty<br>isinCod   |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 180                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.11 Schließung von Aufgaben am Front End

Beschreibung Über den Subtype **BCFE\_MATCH\_BTRADE** werden am Front End durchgeführte Schließungen von Aufgaben zugestellt:

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_match_btrade_feT   | btradeNo<br>changeQty<br>isinCod<br>inSeqNoRef   |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 181                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.16.1.12 Änderung einer Aufgabe am Back End

Beschreibung Über den Subtype **BCBE\_MODIFY\_BTRADE** werden am Back End durchgeführte Änderungen von Aufgaben zugestellt.

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_mod_btradeT        | btradeNo<br>changeQty<br>isinCod   |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 182                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.16.2 XONTRO Request Broker Trade Update Retransmission

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

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

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

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_RET\_BROKER\_TRADE\_UPDATE\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>o</sup>  |
|               | bc_request_retransT      | startStmSeqNo <sup>m</sup><br>stopStmSeqNo <sup>m</sup>   |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 183                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

|                |   |   |
|----------------|---|---|
|                | bc_response_headerT   | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |
| qsamStreamId → | BC_RET_BROKER_TRADE_UPDATE_STREAM_TYPE  |   |
|                | mehrere Nachrichten: jeweils ein Broadcast Header und eine der aufgeführten Strukturen  |   |
| Data           | bc_qsam_broadcast_headerT   | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId   |
|                | bc_broadcast_headerT  | tranDat*<br>tranTim*<br>execTranDat*<br>execTranTim*<br>errFieldRef*<br>outSeqNo*<br>bkrUserNo*<br>isinCod*<br>subType* |
|                | (bc_brd_ent_temp_btradeT,<br>bc_brd_mod_temp_btradeT,<br>bc_brd_del_temp_btradeT,<br>bc_brd_ent_btradeT,<br>bc_brd_ent_btrade_2T,<br>bc_brd_ent_btrade_feT,<br>bc_brd_ent_btrade_fe_2T,<br>bc_brd_can_btradeT,<br>bc_brd_del_btradeT,<br>bc_brd_can_btrade_feT,<br>bc_brd_del_btrade_feT,<br>bc_brd_match_btradeT,<br>bc_brd_mod_btradeT,<br>bc_brd_match_btrade_feT) |   |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 184                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.17 Informationen zum Handel unter Maklern (HUM)

Die folgenden Tabellen beschreiben die Subtypes und Datenstrukturen der Broadcasts.

|                 |   |
|-----------------|---|
| qsamStreamId    | BC_PRIVATE_BROKER_TRADE_UPDATE_STREAM_TYPE                            |
| qsamMsgId       | B = Broadcast   |
| Correlation ID  | qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId                                    |
| Message ID      | outSeqNo  |
| Broadcast Queue | XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>                             |
| Response Data   | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT +<br>bc_brd_mod_humT |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 185                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.17.1 XONTRO Broker Trade Update (HUM)

**Beschreibung** Der Stream **XONTRO Broker Trade Update** versorgt das Front End – neben den zahlreichen Nachrichten zur Aktualisierung der Aufgabensituation – auch mit allen erforderlichen Informationen zum Handel unter Maklern. Übermittelt werden zwei Subtypes BCBE\_MODIFY\_HUM und BCFE\_MODIFY\_HUM – abhängig davon, ob das auslösende Ereignis auf dem Back End oder dem Front End auftrat. Die Informationsinhalte der Nachrichten sind für beide Subtypes identisch.

Ein Teilnehmer erhält immer dann eine Nachricht, wenn er neu in die Position des Endkontrahenten einer HUM-Kette eintritt oder diese verlässt und sofern es sich bei dieser Position nicht um eine Aufgabe handelt. Dabei bleibt die eigentliche Kette anonym, die Information wird lediglich über die Schlüsselwerte

isinCod, buyCod, ctpyNo, tradMtchPrc identifiziert.

Mit diesen Informationen kann er eine Positionsführung seiner HUM-Geschäfte aufbauen.

Neben der reinen Informationsfunktion erhält der Teilnehmer die Möglichkeit, über das XONTRO VALUES API Gegeneingaben einzustellen und damit seine eigenen HUM-Positionen zu reduzieren.

Hierzu kann er die bestehenden Requests XONTRO Enter Single Trade oder XONTRO Enter Broker Trade nutzen.

Folgende Subtypes (subType) werden hierfür<sup>19</sup> angeliefert:

| Subtype         | Verwendung                                      |
|-----------------|---|
| BCBE_MODIFY_HUM | Änderung einer HUM-Position durch das Back End  |
| BCFE_MODIFY_HUM | Änderung einer HUM-Position durch das Front End |

<sup>19</sup> über diesen Stream werden auch die Broadcastnachrichten für die Aktualisierung des Aufgabenbestands verschickt. Diese Subtypes sowie ihre Strukturen werden in **2.1.14 Aktualisierung des Aufgabenbestands** beschrieben

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



|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 187                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.17.2 XONTRO Request Broker Trade Update Retransmission (HUM)

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

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

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

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_RET\_BROKER\_TRADE\_UPDATE\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>o</sup>  |
| Data          | bc_request_retransT      | startStmSeqNo <sup>m</sup><br>stopStmSeqNo <sup>m</sup>   |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 188                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

|                |   |   |
|----------------|---|---|
|                | <i>bc_response_headerT</i>  | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |
| qsamStreamId → | BC_RET_BROKER_TRADE_<br>UPDATE_STREAM_TYPE  |   |
|                | mehrere Nachrichten: jeweils ein<br>Broadcast Header und eine der<br>aufgeführten Strukturen        |   |
| Data           | bc_qsam_broadcast_headerT   | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId   |
|                | mehrere Nachrichten: jeweils ein<br>Broadcast Header und eine Struk-<br>tur vom Typ bc_brd_mod_humT |   |
|                | bc_broadcast_headerT  | tranDat*<br>tranTim*<br>execTranDat*<br>execTranTim*<br>errFieldRef*<br>outSeqNo*<br>bkrUserNo*<br>isinCod*<br>subType* |
|                | bc_brd_mod_humT   |   |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 189                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.18 Geschäftseingabe über das Front End (allgemein)

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

|                |  |
|----------------|--|
| Request Name   | XONTRO Enter Single Trade  |
| Request ID     | BC_ENTER_SINGLE_TRADE_RID  |
| Correlation ID | qsamExchangeld   |
| Request Queue  | XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>   |
| Request Data   | bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT +<br>bc_request_enter_single_tradeT |
| Response Queue | XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>   |
| Response Data  | bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT                                    |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 190                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.18.1 XONTRO Enter Single Trade

**Beschreibung** Der Request **XONTRO Enter Single Trade** dient dem Makler zur Einstellung von Geschäften.

Bei erfolgreicher Einstellung eines Geschäfts erfolgt lediglich eine formale Quittung über die Annahme des Auftrags. Es werden keine inhaltlichen Informationen zurückgeliefert.

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

Falls es sich bei der übermittelten Nachricht um eine Aufgabe handelt, wird bei erfolgreicher Durchführung des Requests ein Broadcast generiert.

Er enthält alle für diese Aufgabe vom Back End zusätzlich erzeugten Daten. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, muss den Broadcast auswerten. Hierzu ist der Stream **XONTRO Broker Trade Update** zu verwenden.

Dieser Broadcast wird nach der endgültigen Ermittlung der Aufgabennummer im Rahmen der Geschäftsabwicklung erzeugt.

qsamRequestId → BC\_ENTER\_SINGLE\_TRADE\_RID

|              |                                |  |
|--------------|--------------------------------|--|
| Request Data | bc_qsam_request_headerT        | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup>  |
|              | bc_request_headerT             | inSeqNo <sup>m</sup>   |
|              | bc_request_enter_single_tradeT | isinCod <sup>m</sup><br>tradMtchPrc <sup>m</sup><br>bkrNo <sup>m</sup><br>tradMtchQty <sup>m</sup><br>tradBegDat <sup>o</sup><br>tradContTim <sup>m</sup><br>tradContDat <sup>o</sup><br>currExcRat <sup>o</sup><br>acrIntDay <sup>o</sup><br>acrIntDayCod <sup>o</sup><br>bonusRat <sup>o</sup> |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 191                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

valueDatCod °  
valueDat °  
trdTypXontro °  
settlementFlag °  
shortSellCod °  
venueSegMic °  
ctpyNoAsk <sup>m</sup>  
btradeNoAsk °  
matchFlagAsk °  
acctTypCodXontroAsk °  
iwOrdCodAsk °  
tradMtchPrcAsk °  
feeFlagAsk °  
feeAsk °  
tranFeeFlagAsk °  
tranFeeAsk °  
repExchangeldAsk °  
textTradAsk °  
ctpyNoBid <sup>m</sup>  
btradeNoBid °  
matchFlagBid °  
acctTypCodXontroBid °  
iwOrdCodBid °  
tradMtchPrcBid °  
feeFlagBid °  
feeBid °  
tranFeeFlagBid °  
tranFeeBid °  
repExchangeldBid °  
textTradBid °

Response Data      bc\_qsam\_response\_headerT

qsamId  
qsamMsgType  
qsamRequestId  
qsamExchangeld  
qsamUserId  
qsamComplCode

bc\_response\_headerT

tranDat  
tranTim  
execTranDat  
execTranTim  
errFieldRef  
inSeqNo

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 192                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.19 Geschäftseingabe über das Front End (MAX-ONE)



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

|                |  |
|----------------|--|
| Request Name   | XONTRO Enter Exchange Trade  |
| Request ID     | BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_RID  |
| Correlation ID | qsamExchangeld   |
| Request Queue  | XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>   |
| Request Data   | bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT +<br>bc_request_header_moT + bc_request_enter_exchange_tradeT +<br>bc_request_enter_exchange_orderT |
| Response Queue | XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>   |
| Response Data  | bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT +<br>bc_response_header_moT   |

|                |  |
|----------------|--|
| Request Name   | XONTRO Enter Exchange Trade Reference  |
| Request ID     | BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_REF_RID  |
| Correlation ID | qsamExchangeld   |
| Request Queue  | XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>   |
| Request Data   | bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT +<br>bc_request_header_moT + bc_request_enter_exchange_orderT |
| Response Queue | XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>   |
| Response Data  | bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT +<br>bc_response_header_moT                                  |

Ein in MAX-ONE entstandenes Geschäft kann zusätzlich zu den für ein Geschäft fest definierten Informationsinhalten Referenzdaten zu jeder Order enthalten, welche in das Geschäft eingeflossen ist. Die Anzahl der Orders ist nicht beschränkt; damit gibt es auch keinen Grenzwert für die Länge einer solchen Nachricht. Für die Übermittlung eines MAX-ONE Geschäfts an XONTRO müssen die Daten in der MAX-ONE Applikation in mehrere Nachrichten aufgeteilt werden. Das XONTRO Values API stellt hierzu zwei Requests zur Verfügung:

Einen Request **XONTRO Enter Exchange Trade**, welcher alle Basisdaten des Geschäfts und optional Orderreferenzen und einen Request **XONTRO Enter Exchange Trade Reference**, welcher ausschließlich Orderreferenzen überträgt. Die einzelnen Teilnachrichten werden in XONTRO wieder zusammengesetzt und als ein Geschäft weiter verarbeitet. Dies gilt nur, wenn alle Teilnachrichten fehlerfrei waren. Bei Fehlern wird – ebenso wie bei einem nicht vorhandenen Request **XONTRO Enter Exchange Trade** – die gesamte Kette der Teilnachrichten verworfen.

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

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 193                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

Die Reihenfolge der Requests ist nicht beliebig: Zunächst sind alle Teilnachrichten zu versenden, welche nur Orderreferenzen enthalten (**XONTRO Enter Exchange Trade Reference**), dann die abschließende Teilnachricht (**XONTRO Enter Exchange Trade**), welche auch die Basisdaten enthält.

Besondere Bedeutung hat die erste Teilnachricht. Ihre Input Sequence Number muss in allen Folge-requests als Referenzschlüssel mitgegeben werden. Mit Hilfe dieses Schlüssels können die Teilnachrichten vom Back End wieder zusammengesetzt werden.

Können alle Orderreferenzen in der Nachrichtenstruktur des Request **XONTRO Enter Exchange Trade** untergebracht werden, dann genügt ein Aufruf dieses Requests zur Übertragung aller Daten des Geschäfts.

Der Teilnehmer ist selbst dafür verantwortlich, dass die in den Requests angegebenen Nominalsummen der Orders und die Gesamtnominalen des Geschäfts übereinstimmen. Die Aufteilung der Orderreferenzen auf Einzelnachrichten kann aber prinzipiell beliebig vorgenommen werden.

Werden bei der Verarbeitung des Geschäfts in XONTRO Trade Aufgaben oder Eigengeschäfte festgestellt, dann werden die entsprechenden Broadcaststreams bedient.

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 194                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.19.1 XONTRO Enter Exchange Trade

**Beschreibung** Der Request **XONTRO Enter Exchange Trade** dient zur Übermittlung der „Basisdaten“ eines in MAX-ONE zustande gekommenen Geschäfts an XONTRO. Optional können Orderreferenzen mitgegeben werden.



Wird die Übermittlung in mehrere Teilnachrichten aufgespalten, dann muss der Request der letzte in der Kette der Teilnachrichten sein. In diesem Fall ist im Feld inSeqNoRef die Input Sequence Number der ersten Teilnachricht mitzugeben. Ein Wert 0 im Feld inSeqNo wird nicht akzeptiert.

Es ist unbedingt darauf zu achten, dass der Request nur dann benutzt wird, wenn alle vorangegangenen Requests des Typs **XONTRO Exchange Trade Reference** vom Back End positiv quittiert wurden, s. **2.2.4** Programmierhinweise für MAX-ONE. **Hierfür ist der Teilnehmer selbst verantwortlich.**

Bei erfolgreicher Einstellung eines Geschäfts (das gegebenenfalls in mehreren fehlerfreien Teilnachrichten übermittelt wurde) erfolgt lediglich eine formale Quittung über die Annahme des Auftrags. Es werden keine inhaltlichen Informationen zurückgeliefert.

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

Liegt ein feldspezifischer Fehler in einer Wiederholgruppe vor, dann enthält das Feld occurrence die Nummer der Wiederholgruppe (Zählung ab 1), sonst 0.

Die Prüfung der Nachricht wird beim ersten Fehler beendet.

Trat bei einer der vorangegangenen Teilnachrichten ein formaler oder logischer Fehler auf, dann erhält das Front End ebenfalls einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

Falls es sich bei dem übermittelten Geschäft um eine Aufgabe oder ein Eigen-geschäft handelt, wird bei erfolgreicher Durchführung des Requests ein Broadcast generiert.

Dieser Broadcast wird nach der endgültigen Ermittlung der Aufgabennummer im Rahmen der Geschäftsabwicklung erzeugt.

Er enthält alle für diese Aufgabe vom Back End zusätzlich erzeugten Daten. Die Anwendung, die den Request gestellt hat, muss den Broadcast auswerten. Hierzu ist der Stream **XONTRO Broker Trade Update** oder der Stream **XONTRO Own Trade Update** zu verwenden.

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 195                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

qsamRequestId → BC\_ENTER\_EXCHANGE\_TRADE\_RID

|              |                                  |   |
|--------------|----------------------------------|---|
| Request Data | bc_qsam_request_headerT          | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeId <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup>   |
|              | bc_request_headerT               | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|              | bc_request_header_moT            | inSeqNoRef <sup>o</sup>   |
|              | bc_request_enter_exchange_tradeT | isinCod <sup>m</sup><br>tradMtchPrc <sup>m</sup><br>bkrNo <sup>m</sup><br>tradMtchQty <sup>m</sup><br>tradBegDat <sup>o</sup><br>tradContTim <sup>m</sup><br>tradContTimFraction <sup>m</sup><br>tradContDat <sup>o</sup><br>currExcRat <sup>o</sup><br>acrIntDay <sup>o</sup><br>acrIntDayCod <sup>o</sup><br>bonusRat <sup>o</sup><br>valueDatCod <sup>o</sup><br>valueDat <sup>o</sup><br>trdTypXontro <sup>o</sup><br>tvTic <sup>m</sup><br>otcPostTradInd <sup>o</sup><br>shortSellCod <sup>o</sup><br>venueSegMic <sup>o</sup><br>ctpyNoAsk <sup>m</sup><br>btradeNoAsk <sup>o</sup><br>matchFlagAsk <sup>o</sup><br>acctTypCodXontroAsk <sup>o</sup><br>iwOrdCodAsk <sup>o</sup><br>tradMtchPrcAsk <sup>o</sup><br>feeFlagAsk <sup>o</sup><br>feeAsk <sup>o</sup><br>repExchangeIdAsk <sup>o</sup><br>textTradAsk <sup>o</sup> |

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

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 196                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

|               |                                  |   |
|---------------|----------------------------------|---|
|               |                                  | onBehalfCtpyNoAsk <sup>r</sup><br>comCodAsk <sup>r</sup><br>comAmtAsk <sup>r</sup><br>comRateAsk <sup>r</sup><br>chargesAsk <sup>r</sup><br>ctpyNoBid <sup>m</sup><br>btradeNoBid <sup>o</sup><br>matchFlagBid <sup>o</sup><br>acctTypCodXontroBid <sup>o</sup><br>iwOrdCodBid <sup>o</sup><br>tradMtchPrcBid <sup>o</sup><br>feeFlagBid <sup>o</sup><br>feeBid <sup>o</sup><br>repExchangeldBid <sup>o</sup><br>textTradBid <sup>o</sup><br>onBehalfCtpyNoBid <sup>r</sup><br>comCodBid <sup>r</sup><br>comAmtBid <sup>r</sup><br>comRateBid <sup>r</sup><br>chargesBid <sup>r</sup> |
|               | <i>bis zu 60-mal</i>             |   |
|               | bc_request_enter_exchange_orderT | buyCod <sup>o</sup><br>tradMtchQty <sup>o</sup><br>origOrdQty <sup>o</sup><br>userOrdNum <sup>o</sup><br>exchangeOrdNum <sup>o</sup>  |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT         | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestld<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT              | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |
|               | bc_response_header_moT           | occurrence  |

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

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 197                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.19.2 XONTRO Enter Exchange Trade Reference

**Beschreibung** Der Request **XONTRO Enter Exchange Trade Reference** dient zur Übermittlung zusätzlicher Orderreferenzen eines in MAX-ONE zustande gekommenen Geschäfts an XONTRO.



Alle Requests dieses Typs müssen vor dem Basisrequest XONTRO Enter Exchange Trade geschickt werden.

Im ersten Request des Typs ist das Feld inSeqNo mit einer gültigen Input Sequence Number > 0 zu belegen. Das Feld inSeqNoRef muss mit 0 belegt werden.

Die folgenden Requests des Typs müssen das Feld inSeqNo ebenfalls mit einer gültigen Input Sequence Number > 0 belegen. Das Feld inSeqNoRef muss mit der Input Sequence Number des ersten Requests belegt werden.

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

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

In der Response ist nur der Header belegt. Liegt ein feldspezifischer Fehler in einer Wiederholgruppe vor, dann enthält das Feld occurrence die Nummer der Wiederholgruppe (Zählung ab 1), sonst 0.

Die Prüfung der Nachricht wird beim ersten Fehler beendet.

Tritt bei einer der Teilnachrichten ein formaler oder logischer Fehler auf, dann wird die gesamte Nachrichtenkette verworfen. Ein folgender Basisrequest erhält einen situationsspezifischen Completion Code (qsamComplCode).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 198                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

|                 |                                     |   |
|-----------------|-------------------------------------|---|
| qsamRequestId → | BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_REF_<br>RID |   |
| Request Data    | bc_qsam_request_headerT             | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|                 | bc_request_headerT                  | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|                 | bc_request_header_moT               | inSeqNoRef <sup>m</sup>   |
|                 | <i>bis zu 60-mal</i>                |   |
|                 | bc_request_enter_exchange_orderT    | buyCod <sup>o</sup><br>tradMtchQty <sup>o</sup><br>origOrdrQty <sup>o</sup><br>userOrdNum <sup>o</sup><br>exchangeOrdNum <sup>o</sup>   |
| Response Data   | bc_qsam_response_headerT            | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|                 | bc_response_headerT                 | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |
|                 | bc_response_header_moT              | occurrence  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 199                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.20 Stornierung von Aufgaben und Geschäften über das Front End

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

|                |   |
|----------------|---|
| Request Name   | XONTRO Cancel Trade   |
| Request ID     | BC_CANCEL_TRADE_RID   |
| Correlation ID | qsamExchangeld  |
| Request Queue  | XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>  |
| Request Data   | bc_qsam_request_headerT + bc_request_headerT +<br>bc_request_can_tradeT |
| Response Queue | XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>  |
| Response Data  | bc_qsam_request_headerT + bc_response_headerT                           |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 200                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.20.1 XONTRO Cancel Trade

**Beschreibung** Der Request **XONTRO Cancel Trade** dient dem Makler zum Stornieren von Aufgaben und Geschäften.

Das Identifikationskriterium für das **Stornieren von Geschäften** ist die Geschäftsnummer (tradNo) und die ISIN (isinCod). Die Eingabe der Geschäftsart (buyCod) und des Kontrahenten (ctpyNo) wird erforderlich, wenn der Makler in einer HUM-Kette der Eingaber für die Kauf- und Verkaufseite ist und jeweils auf beiden Seiten eine Bank als Kontrahent benannt ist.

Das Identifikationskriterium für das **Stornieren von Aufgaben** ist die Aufgabennummer (anzugeben im Feld tradNo) und die ISIN (isinCod). Es können sowohl vorläufige wie auch endgültige Aufgaben storniert werden.

Erkennt das Back End eine nicht vorhandene Aufgaben- oder Geschäftsnummer, dann erhält das Front End einen Completion Code (qsamComplCode) ELB\_BC\_BTRADE\_ERROR.

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

Bei erfolgreicher Durchführung des Requests erhält das Front End eine positive Response, in der nur der Header belegt ist. Zusätzlich können folgende Broadcasts generiert werden:

Bei der **Stornierung von Geschäften** wird der Broadcast BCBE\_BROKER\_DIARY verschickt.

Bei der **Stornierung von Aufgaben** wird im Broadcast BCFE\_CANCEL\_BTRADE die inSeqNo des Requests im Feld inSeqNoRef des Broadcasts zurückgegeben. Zusätzlich wird ein Broadcast BCBE\_BROKER\_DIARY verschickt.

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 201                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

qsamRequestId → BC\_CANCEL\_TRADE\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_can_tradeT    | tradNo <sup>m</sup><br>isinCod <sup>m</sup><br>buyCod <sup>o</sup><br>ctpyNo <sup>o</sup>   |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 202                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.21 Aktualisierung der Eigengeschäfte und des Maklertagebuchbestands

Die folgende Tabelle beschreibt die Subtypes und Datenstrukturen der Broadcasts.

|                 |   |
|-----------------|---|
| qsamStreamId    | BC_PRIVATE_OWN_TRADE_UPDATE_STREAM_TYPE   |
| qsamMsgId       | B = Broadcast   |
| Correlation ID  | qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId  |
| Message ID      | outSeqNo  |
| Broadcast Queue | XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>   |
| Response Data   | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT + (eine der Strukturen vom Typ bc_brd_own_tradeT, bc_diaryT) |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 203                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.21.1 XONTRO Own Trade Update

**Beschreibung** Der Stream **XONTRO Own Trade Update** versorgt das Front End mit allen Eigengeschäften und allen Geschäftsvorfällen im Maklertagebuch.

Folgende Subtypes (subType) werden hierfür angeliefert:

| Subtype           | Verwendung   |
|-------------------|--|
| BCBE_TRADE        | Erzeugung eines Eigengeschäfts                       |
| BCBE_BROKER_DIARY | Erzeugung eines Geschäftsvorfalles im Maklertagebuch |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 204                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.21.2 Erzeugung eines Eigengeschäfts

Beschreibung Über den Subtype **BCBE\_TRADE** werden dem Front End alle erzeugten Eigengeschäfte zugestellt. Es werden lediglich gekennzeichnete Eigengeschäfte übermittelt.

|                |                           |   |
|----------------|---------------------------|---|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                               |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDa<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_own_tradeT         | tradCod<br>isinCod<br>tradMtchQty<br>tradMtchPrc<br>ctpyNo<br>tradTimeStamp                                   |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 205                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.21.3 Erzeugung eines Geschäftsvorfalles im Maklertagebuch

Beschreibung Über den Subtype **BCBE\_BROKER\_DIARY** werden dem Front End alle für den Makler relevanten Geschäftsvorfälle im Maklertagebuch übermittelt.

Die Art des Geschäftsvorfalles ist im Feld tradCICod aufgeschlüsselt (siehe Feldbeschreibung).

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |

#### bc\_diaryT

(Die Datenstruktur entspricht dem Xontro Inquire Broker Diary)

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 206                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

#### 2.1.21.4 XONTRO Request Own Trade Update Retransmission

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

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

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

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

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

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

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

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

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 207                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

qsamRequestId → BC\_RET\_OWN\_TRADE\_UPDATE\_RID

|              |                         |   |
|--------------|-------------------------|---|
| Request Data | bc_qsam_request_headerT | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|--------------|-------------------------|---|

|  |                    |                      |
|--|--------------------|----------------------|
|  | bc_request_headerT | inSeqNo <sup>o</sup> |
|--|--------------------|----------------------|

|  |                     |   |
|--|---------------------|---|
|  | bc_request_retransT | startStmSeqNo <sup>m</sup><br>stopStmSeqNo <sup>m</sup> |
|--|---------------------|---|

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode |
|---------------|--------------------------|---|

|  |                     |  |
|--|---------------------|--|
|  | bc_response_headerT | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo |
|--|---------------------|--|

qsamStreamId → BC\_RET\_OWN\_TRADE\_UPDATE\_STREAM\_TYPE

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

|      |                           |   |
|------|---------------------------|---|
| Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId |
|------|---------------------------|---|

|  |                      |                      |
|--|----------------------|----------------------|
|  | bc_broadcast_headerT | tranDat*<br>tranTim* |
|--|----------------------|----------------------|

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 208                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

execTranDat\*  
execTranTim\*  
errFieldRef\*  
outSeqNo\*  
bkrUserNo\*  
isinCod\*  
subType\*

(bc\_brd\_own\_tradeT,  
bc\_diaryT)

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 209                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

## 2.1.22 Bestandsinformationen Maklertagebuch

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsinformationen.

|                        |   |
|------------------------|---|
| qsamStreamId           | BC_INQUIRE_BROKER_DIARY_STREAM_TYPE   |
| qsamMsgType            | I = Bestandstransfer (Initialbestand)   |
| Correlation ID         | qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId  |
| Message ID             | bKeyInq   |
| Bestandstransfer Queue | XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>   |
| Data                   | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach<br>(bc_subTypeT + bc_diaryT) |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 210                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.22.1 XONTRO Inquire Broker Diary

**Beschreibung** Der Stream **BC\_INQUIRE\_BROKER\_DIARY\_STREAM\_TYPE** liefert dem Front End die Daten des Maklertagebuchs zum Zeitpunkt des Abschlusses des vorherigen Börsentags.

Der Stream liefert mehrere Einträge in einer Nachricht. Die tatsächliche Länge der Antwort (MQ Layer) ermittelt werden. Die Nachricht muss von der Anwendung in einzelne Aufgaben aufgeteilt werden. Die erste Nachricht wird mit bKeyInq = 1 geliefert. Alle Folgenachrichten enthalten eine lückenlos aufsteigende Sequenz-Nummer.

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

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType BCBE\_DIARY\_END feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn für eine KV-Nummer keine Einträge für das Maklertagebuch vorliegen. Im Standardfall ist subType mit BCBE\_DIARY belegt.

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 211                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

qsamStreamId → BC\_INQUIRE\_BROKER\_DIARY\_  
STREAM\_TYPE

|      |                                |  |
|------|--------------------------------|--|
| Data | bc_qsam_broadcast_headerT      | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId  |
|      | bc_key_inquireT                | bKeyInq  |
|      | <b>mehrfach</b><br>bc_subTypeT | subType*   |
|      | bc_diaryT                      | acctTypCodXontroAsk*<br>acctTypCodXontroBid*<br>acrIntDay*<br>acrIntDayCod*<br>bkrDiaryNo*<br>bkrSubNo*<br>bkrUserNo*<br>bonusDifAmtAsk*<br>bonusDifAmtBid*<br>bonusRat*<br>bonusRatAsk*<br>bonusRatBid*<br>btradeCodAsk*<br>btradeCodBid*<br>btradeEnfCod*<br>btradeTextAsk*<br>btradeTextBid*<br>busDat*<br>clearingCurrTypCod*<br>ctpyNoAsk*<br>ctpyLeiAsk*<br>ctpyNoBid*<br>ctpyLeiBid*<br>currExcRat*<br>currExcRatAsk*<br>currExcRatBid*<br>eccpCod*<br>exchangeldAsk* |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 212                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

exchangeldBid\*  
 feeAsk\*  
 feeBid\*  
 feeFlagAsk\*  
 feeFlagBid\*  
 tranFeeAsk\*  
 tranFeeBid\*  
 tranFeeFlagAsk\*  
 tranFeeFlagBid\*  
 humNo\*  
 isinCod\*  
 iwOrdCodAsk\*  
 iwOrdCodBid\*  
 textTradAsk\*  
 textTradBid\*  
 tradBegDat\*  
 tradCICod\*  
 tradClearingPrc\*  
 tradDifAmtAsk\*  
 tradDifAmtBid\*  
 tradMtchPrc\*  
 tradMtchPrcAsk\*  
 tradMtchPrcBid\*  
 tradMtchPrcNoAsk\*  
 tradMtchPrcNoBid\*  
 tradMtchPrcType\*  
 tradMtchQty\*  
 tradNo\*  
 tradNoAsk\*  
 tradNoBid\*  
 tradNoOld\*  
 tradTim\*  
 tranContDatAsk\*  
 tranContDatBid\*  
 tranContTimAsk\*  
 tranContTimFractionAsk\*  
 tranContTimBid\*  
 tranContTimFractionBid\*  
 tranExchangeld\*  
 trdTypXontroAsk\*  
 trdTypXontroBid\*  
 userNo\*  
 valueDat\*

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 213                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

valueDatCod\*  
xontroOdrCodAsk\*  
xontroOdrCodBid\*  
repExchangeldAsk\*  
repExchangeldBid\*  
customerldClassAsk\*  
customerldClassBid\*  
customerldAsk\*  
customerldBid\*  
commissionAgentFlagAsk\*  
commissionAgentFlagBid\*  
settlementFlag\*  
tvTicAsk\*  
tvTicBid\*  
venueMic\*  
shortSellCod\*  
otcPostTradIndAsk\*  
otcPostTradIndBid\*  
venueSegMic\*

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 214                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.23 Supportfunktionen zur Behandlung von Mistrades

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für Request und Response.

|                |  |
|----------------|--|
| Request Name   | XONTRO Reset Price   |
| qsamRequestId  | BC_RESET_PRICE_RID   |
| Correlation ID | qsamExchangeld   |
| Request Queue  | XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>   |
| Request Data   | bc_qsam_response_headerT + bc_request_headerT +<br>bc_request_reset_priceT |
| Response Queue | XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>   |
| Response Data  | bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT                             |

|                |   |
|----------------|---|
| Request Name   | XONTRO Reset Price Info   |
| qsamRequestId  | BC_RESET_PRICE_INFO_RID   |
| Correlation ID | qsamExchangeld  |
| Request Queue  | XOSAM.QA.REQTOH.<qsamId>  |
| Request Data   | bc_qsam_response_headerT + bc_request_headerT +<br>bc_request_reset_price_infoT |
| Response Queue | XOSAM.QA.RESFRH.<qsamId>  |
| Response Data  | bc_qsam_response_headerT + bc_response_headerT                                  |

|                        |  |
|------------------------|--|
| qsamStreamId           | BC_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE  |
| qsamMsgType            | B = Broadcast  |
| Correlation ID         | qsamDate + qsamBkrNo + qsamStreamId  |
| Message ID             | outSeqNo   |
| Bestandstransfer Queue | XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>  |
| Data                   | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT ( + eine<br>Struktur vom Typ bc_brd_reset_priceT oder<br>bc_brd_reset_order_skmT oder<br>bc_brd_reset_order_fmT ) |

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

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 215                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 216                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.23.1 XONTRO Reset Price

**Beschreibung** Mit Hilfe des Requests **XONTRO Reset Price** kann ein skontroführender Makler eine bestimmte Kursfeststellung annullieren oder korrigieren<sup>20</sup>.

Ist das Feld tradMtchPrc = ‚Zero‘ und das Feld tradMtchCod = ‚blank‘, so wird eine Kurslöschung durchgeführt.

Im Feld refTim ist die Kursbestätigungszeit des Kurses (execTranTim oder tradMtchPrcTim) aus den Broadcasts

BCBE\_ENTER\_PRICE,  
BCFE\_ENTER\_PRICE,  
BCBE\_ENTER\_PRICE\_TAB,  
BCBE\_ENTER\_PRICE\_MODIFICATION\_TAB,  
BCFE\_ENTER\_BLOCK\_PRICE  
mitzugeben.

Für die Kursänderung und -löschung gelten folgende Restriktionen:

- es können nur Kursfeststellungen vom aktuellen Börsentag geändert bzw. gelöscht werden
- manuell **eingefügte** Kurse können weder geändert noch gelöscht werden
- der erste Kurs und der Kassakurs können nicht gelöscht werden
- ist der erste Kurs als „abweichender variabler Kurs“ durch einen Kassakurs generiert, kann dieser nicht geändert werden
- bei Änderung bzw. Löschung eines Kurses muss die Auszeichnung aller betroffenen Orders abgeschlossen sein

Nach erfolgreicher Durchführung erhält der skontroführende Makler eine Nachricht vom Subtype BCBE\_ENTER\_PRICE\_MODIFICATION\_MAN auf dem Stream BC\_PRIVATE\_ORDER\_UPDATE\_STREAM\_TYPE.

Weiterhin werden dem skontroführenden Makler alle von der Kursfeststellung betroffenen, an ihn gerichteten Orders im Stream der Private Status News in einer oder mehreren Nachrichten des Subtypes BCFE\_RESET\_ORDER\_SKM übermittelt. Alle weiteren Verarbeitungsschritte – Stornierung der Geschäfte etc. – müssen vom skontroführenden Makler getrennt angestoßen werden.

Nach erfolgreicher Durchführung wird außerdem eine Nachricht hierüber an jeden Freimakler des betroffenen Börsenplatzes geschickt. Verwendet werden hierzu der Stream der Private Status News und der Subtype BCFE\_RESET\_PRICE.

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

<sup>20</sup> eine Neueingabe eines Kurses ist mit diesem Request nicht möglich

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

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 217                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

qsamRequestId → BC\_RESET\_PRICE\_RID

|               |                          |  |
|---------------|--------------------------|--|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup>                        |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>m</sup>   |
|               | bc_request_reset_priceT  | isinCod <sup>m</sup><br>tradMtchCod <sup>o</sup><br>tradMtchPrc <sup>m</sup><br>tradMtchPrcNo <sup>m</sup><br>ordrBkExeQty <sup>o</sup><br>refTim <sup>m</sup> |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode  |
|               | bc_response_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo   |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 218                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.23.2 XONTRO Reset Price Info

**Beschreibung** Hat ein skontroführender Makler eine bestimmte Kursfeststellung annulliert oder korrigiert, dann kann jeder Freimakler des betroffenen Börsenplatzes mit Hilfe des Requests **XONTRO Reset Price Info** alle von der Kursfeststellung betroffenen Orders ermitteln, in denen er Empfänger oder Aufgeber war.

Zur Versorgung des Requests sind die Daten zu verwenden, die dem Freimakler über den Stream der Private Status News im Subtype BCFE\_RESET\_PRICE mitgeteilt wurden.

Bei erfolgreicher Durchführung werden dem Freimakler alle von der Kursfeststellung betroffenen Orders im Stream der Private Status News in einer oder mehreren Nachrichten des Subtypes BCFE\_RESET\_ORDER\_FM übermittelt.

Der Request wird nicht akzeptiert, wenn für die betroffene Kursfeststellung kein Request **XONTRO Reset Price** durchgeführt wurde.

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

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

In der Response ist nur der Header belegt.

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 219                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

qsamRequestId → BC\_RESET\_PRICE\_INFO\_RID

|               |                              |   |
|---------------|------------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT      | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT           | inSeqNo <sup>m</sup>  |
|               | bc_request_reset_price_infoT | isinCod <sup>m</sup><br>tradMchPrcNo <sup>m</sup><br>refTim <sup>m</sup>  |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT     | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |
|               | bc_response_headerT          | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 220                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.23.3 XONTRO Subscribe Private Status News

**Beschreibung** Im Stream **BC\_PRIVATE\_STATUS\_STREAM\_TYPE** erhält ein skontroführender Makler über den Subtype **BCFE\_RESET\_ORDER\_SKM** alle eigenen Orders zu Kursfeststellungen, die er mit Hilfe des Requests **XONTRO Reset Price** annulliert oder geändert hat.

Ein Freimakler erhält in diesem Stream über den Subtype **BCFE\_RESET\_PRICE** zunächst nur die Information, dass ein bestimmter Kurs annulliert oder geändert wurde. Er kann die übermittelten Daten dazu verwenden mit einem Request **XONTRO Reset Price Info** alle eigenen Orders anzufordern die betroffen waren. Diese werden im gleichen Stream mit dem Subtype **BCFE\_RESET\_ORDER\_FM** zugestellt.

Die Nachrichten vom Subtype **BCFE\_RESET\_ORDER\_SKM** bzw. **BCFE\_RESET\_ORDER\_FM** enthalten mehrere Orders pro Nachricht. Folgt keine weitere Nachricht, dann werden die Subtypes **BCFE\_RESET\_ORDER\_SKM\_END** bzw. **BCFE\_RESET\_ORDER\_FM\_END** geliefert.

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 221                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.23.3.1 Kursanullierung/Kursänderung

Beschreibung Der Subtype BCFE\_RESET\_PRICE liefert folgende Daten:

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_reset_priceT       | tradMtchPrcNo<br>refTim  |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 222                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.23.3.2 Orderinformation für den skontroführenden Makler

**Beschreibung** Die Subtypes BCFE\_RESET\_ORDER\_SKM bzw. BCFE\_RESET\_ORDER\_SKM\_END liefern die unten aufgeführten Daten. Es ist möglich, dass in einer letzten Nachricht (BCFE\_RESET\_ORDER\_SKM\_END) keine Orderdaten vorhanden sind. Dann enthält bc\_counterT den Wert 0. Die Nachricht ist dennoch notwendig um dem Teilnehmer das Ende der Übertragung für diese Kursfeststellung zu signalisieren.

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|                | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|                | bc_brd_reset_priceT       | tradMtchPrcNo<br>refTim  |
|                | bc_counterT               | counter  |
|                | <i>bis zu 30 Einträge</i> |  |
|                | bc_brd_reset_order_skmT   | buyCod<br>ctpyNo<br>ordrExePrc<br>ordrExpDat<br>ordrNo<br>ordrQty<br>ordrResCod<br>trdResTypCod<br>userOrdNum  |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 223                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.23.3.3 Orderinformation für den Freimakler

**Beschreibung** Die Subtypes BCFE\_RESET\_ORDER\_FM bzw. BCFE\_RESET\_ORDER\_FM\_END liefern die unten aufgeführten Daten. Es ist möglich, dass in einer letzten Nachricht (BCFE\_RESET\_ORDER\_FM\_END) keine Orderdaten vorhanden sind. Dann enthält bc\_counterT den Wert 0. Die Nachricht ist dennoch notwendig um dem Teilnehmer das Ende der Übertragung für diese Kursfeststellung zu signalisieren.

|                |                           |  |
|----------------|---------------------------|--|
| Broadcast Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId  |
| Response Data  | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType         |
|                | bc_brd_reset_priceT       | tradMtchPrcNo<br>refTim  |
|                | bc_counterT               | counter  |
|                | <i>bis zu 30 Einträge</i> |  |
|                | bc_brd_reset_order_fmT    | buyCod<br>bkrNo<br>ctpyNo<br>ordrExePrc<br>ordrExpDat<br>ordrNo<br>ordrQty<br>ordrResCod<br>trdResTypCod<br>userOrdNum |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 224                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

#### 2.1.23.4 XONTRO Request Private Status News Retransmission

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

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

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

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

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

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

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

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

qsamRequestId → BC\_RET\_PRIVATE\_STATUS\_NEWS\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>o</sup>  |
|               | bc_request_retransT      | startStmSeqNo <sup>m</sup><br>stopStmSeqNo <sup>m</sup>   |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

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

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 225                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

|                |  |   |
|----------------|--|---|
|                | bc_response_headerT  | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |
| qsamStreamId → | BC_RET_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE  |   |
|                | mehrere Nachrichten: jeweils ein Broadcast Header und eine der aufgeführten Strukturen |   |
| Data           | bc_qsam_broadcast_headerT  | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId   |
|                | bc_broadcast_headerT   | tranDat*<br>tranTim*<br>execTranDat*<br>execTranTim*<br>errFieldRef*<br>outSeqNo*<br>bkrUserNo*<br>isinCod*<br>subType* |
|                | bc_brd_reset_priceT  |   |
|                | <u>oder</u>  |   |
|                | bc_brd_reset_priceT + bc_counterT<br>+ bc_brd_reset_order_skmT                         |   |
|                | <u>oder</u>  |   |
|                | bc_brd_reset_priceT + bc_counterT<br>+ bc_brd_reset_order_fmT                          |   |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 226                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

## 2.1.24 Bestandsinformationen Nebenrechte

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsinformationen:

|                        |   |
|------------------------|---|
| qsamStreamId           | BC_INQUIRE_SP_RIGHTS_STREAM_TYPE  |
| qsamMsgType            | I = Bestandstransfer (Initialbestand)   |
| Correlation ID         | qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId  |
| Message ID             | bKeyInq   |
| Bestandstransfer Queue | XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>   |
| Data                   | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_sp_rightT) |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 227                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.24.1 XONTRO Inquire Special Rights



**Beschreibung** Der Stream **BC\_INQUIRE\_SP\_RIGHTS\_STREAM\_TYPE** liefert dem Front End den Nebenrechtsbestand zum Zeitpunkt des Abschlusses des vorherigen Börsentags. Nebenrechte des aktuellen Börsentages werden über die Subtypes **BCBE\_ENTER\_SP\_RIGHT** und **BCFE\_ENTER\_SP\_RIGHT** des **BC\_PUBLIC\_SYSTEM\_STATUS\_STREAM\_TYPE** verteilt.

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

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

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType **BCBE\_BT\_END** feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn keine Nebenrechte vorliegen. Im Standardfall ist subType mit **BCBE\_BT** belegt.

qsamStreamId → BC\_INQUIRE\_SP\_RIGHTS\_STREAM\_TYPE

|      |                           |   |
|------|---------------------------|---|
| Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId |
|      | bc_key_inquireT           | bKeyInq   |
|      | <b>mehrfach</b>           |   |
|      | bc_subTypeT               | subType*  |
|      | bc_sp_rightT              | nrCod*<br>isinCod*<br>isinCodNew*<br>ordrExePrcMod*<br>nrDat*                   |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 228                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

## 2.1.25 Bestandsinformationen Stammdaten

Die folgenden Tabellen beschreiben die Datenstrukturen für die Bestandsinformationen:

|                        |   |
|------------------------|---|
| qsamStreamId           | BC_INQUIRE_SKONTRO_DATA_STREAM_TYPE   |
| Correlation ID         | qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId  |
| qsamMsgType            | I = Bestandstransfer (Initialbestand)   |
| Message ID             | bKeyInq   |
| Bestandstransfer Queue | XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>   |
| Response Data          | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_skontro_dataT) |

|                        |   |
|------------------------|---|
| qsamStreamId           | BC_INQUIRE_SKONTRO_ISIN_STREAM_TYPE   |
| qsamMsgType            | I = Bestandstransfer (Initialbestand)   |
| Correlation ID         | qsamDate + qsamBkrNo + qsamStreamId   |
| Message ID             | bKeyInq   |
| Bestandstransfer Queue | XOSAM.QA.BTRFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>   |
| Response Data          | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_key_inquireT + mehrfach (bc_subTypeT + bc_skontro_isinT) |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 229                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.25.1 XONTRO Inquire Skontro Data

**Beschreibung** Der Stream **BC\_INQUIRE\_SKONTRO\_DATA\_STREAM\_TYPE** liefert einem Teilnehmer Stammdaten zu den ISINs, in welchen er skontroführender Makler ist. Dabei werden sowohl aktive als auch historische ISINs geliefert. Historische Notierungen sind am Inhalt des Feldes `instHistCod (= 2)` zu erkennen.

Das Feld `deactCod` enthält die Information, ob eine Gattung (ISIN) kursausgesetzt ist oder nicht.

In den Feldern `tradMtchPrc` und `tradMtchCod` wird der jeweils letzte Kurs des vorhergehenden Börsentages übermittelt. Hat es an dem vorhergehenden Börsentag keinen (letzten) Kurs gegeben, so werden die Felder initialisiert übertragen.

Mit Hilfe der Depotwährung kann festgestellt werden, ob bei einer Gattung die Eingabe eines Devisenkurses notwendig ist. Dies ist dann der Fall, wenn die Gattung %-notiert (vgl. `untOfTrad`) ist und die Depotwährung nicht auf Euro lautet (Ausnahme: bei ehemaligen Währungen der Euro-Länder ist der fixe Devisenkurs im System hinterlegt).

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

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

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType `BCBE_SKONTRO_END` feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn keine Stammdaten vorliegen. Im Standardfall ist subType mit `BCBE_SKONTRO_DATA` belegt.

`qsamStreamId` → `BC_INQUIRE_SKONTRO_DATA_STREAM_TYPE`

**Data**

|  |   |
|--|---|
| <code>bc_qsam_broadcast_headerT</code> | <code>qsamId</code><br><code>qsamMsgType</code><br><code>qsamExchangeld</code><br><code>qsamDat</code><br><code>qsamBkrNo</code><br><code>qsamStreamId</code> |
| <code>bc_key_inquireT</code>           | <code>bKeyInq</code>  |

**mehrfach**

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 230                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

bc\_subTypeT

subType\*

bc\_skontro\_dataT

isinCod\*  
instMnem\*  
instShtNam\*  
instAlphaCod\*  
instSecCod\*  
instSubSecCod\*  
instStrtTradDat\*  
instStpTradDat\*  
instLastRedemptDat\*  
instXontroStrtTradDat\*  
instHistCod\*  
instRondLotInc\*  
instRondLotQty\*  
instRondLotMinQty\*  
emiCod\*  
currTypCod\*  
ordrResCodInd\*  
untOfTrad\*  
midAuctInd\*  
auctRondLotInc\*  
auctRondLotQty\*  
auctRondLotMinQty\*  
contAuctInd\*  
contAuctRondLotInc\*  
contAuctRondLotQty\*  
contAuctRondLotMinQty\*  
deactCod\*  
tradMtchPrc\*  
tradMtchCod\*  
tickSizeXontro\*  
cutoffTim\*  
fwdPricingDays\*  
fwdPricingInd\*  
strtSubscrptDat\*  
endSubscrptDat\*  
currTypCodDep\*  
custodyTypCod\*

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 231                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

## 2.1.25.2 XONTRO Inquire Skontro ISIN

**Beschreibung** Der Stream **BC\_INQUIRE\_SKONTRO\_ISIN\_STREAM\_TYPE** liefert einem Teilnehmer die Information, in welchen Gattungen er skontroführender Makler ist.

Das Feld deactCod enthält die Information, ob eine Gattung (ISIN) kursausgesetzt ist oder nicht.

In den Feldern tradMtchPrc und tradMtchCod wird der jeweils letzte Kurs des vorhergehenden Börsentages übermittelt. Hat es an dem vorhergehenden Börsentag keinen (letzten) Kurs gegeben, so werden die Felder initialisiert übertragen.

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

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

Ob der gesamte Bestand übertragen wurde, kann die Anwendung an einer speziellen Nachricht vom subType BCBE\_SKONTRO\_END feststellen. Diese Nachricht wird auch dann verschickt, wenn keine Stammdaten vorliegen. Im Standardfall ist subType mit BCBE\_SKONTRO\_ISIN belegt.

|                |                                     |   |
|----------------|-------------------------------------|---|
| qsamStreamId → | BC_INQUIRE_SKONTRO_ISIN_STREAM_TYPE |   |
| Data           | bc_qsam_broadcast_headerT           | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId |
|                | bc_key_inquireT                     | bKeyInq   |
|                | <b>mehrfach</b>                     |   |
|                | bc_subTypeT                         | subType*  |
|                | bc_skontro_isinT                    | isinCod*<br>deactCod*<br>tradMtchPrc*<br>tradMtchCod*                           |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 232                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

## 2.1.26 Administration

Die folgenden Tabellen beschreiben die Subtypes und Datenstrukturen der Broadcasts:

|                 |  |
|-----------------|--|
| qsamStreamId    | BC_PUBLIC_SYSTEM_STATUS_STREAM_TYPE  |
| qsamMsgId       | B = Broadcast  |
| Correlation ID  | qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId   |
| Message ID      | outSeqNo   |
| Broadcast Queue | XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>  |
| Data            | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT ( +<br>gegebenenfalls eine Struktur vom Typ bc_brd_dea_pricingT oder<br>bc_sp_rightT) |

|                 |   |
|-----------------|---|
| qsamStreamId    | BC_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE   |
| qsamMsgId       | B = Broadcast   |
| Correlation ID  | qsamDat + qsamBkrNo + qsamStreamId  |
| Message ID      | outSeqNo  |
| Broadcast Queue | XOSAM.QA.BRDFRH.<qsamId>.<qsamExchangeld>   |
| Response Data   | bc_qsam_broadcast_headerT + bc_broadcast_headerT ( +<br>gegebenenfalls eine Struktur vom Typ bc_brd_pw_expiration_datT<br>oder bc_brd_exchange_quote_volume_infoT oder<br>bc_brd_bypass_quote_volume_infoT) |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 233                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.26.1 XONTRO System Status News

**Beschreibung** Der Stream **XONTRO System Status News** erhält vom Back End alle relevanten Änderungen des Systemstatus der Back End Applikation und des Back End. Außerdem werden über diesen Stream alle eingegebenen Nebenrechte übermittelt.

Es wird eine der Nachrichten

|                               |   |
|-------------------------------|---|
| BCBE_BUS_START                | (Start Buchungsschnitt)   |
| BCBE_BUS_END                  | (Ende Buchungsschnitt)  |
| BCBE_ENDOFDAY_START           | (Start Tagesendeverarbeitung)   |
| BCBE_DEACTIVATE_PRICING       | (Kursaussetzung Back End)   |
| BCFE_DEACTIVATE_PRICING       | (Kursaussetzung Front End)  |
| BCFE_DEACTIVATE_PRICING_BLOCK | (geblockte Kursaussetzungen Front End)                                  |
| BCBE_REACTIVATE_PRICING       | (Wiederaufnahme nach Kursaussetzung Back End)                           |
| BCFE_REACTIVATE_PRICING_BLOCK | (geblockte Rücknahmen Kursaussetzungen Front End)                       |
| BCFE_REACTIVATE_PRICING       | (Wiederaufnahme nach Kursaussetzung Front End)                          |
| BCBE_DEACTIVATE_ANY_PRICING   | (Unterbrechung der Kursfeststellung)                                    |
| BCBE_REACTIVATE_ANY_PRICING   | (Wiederaufnahme nach Unterbrechung der Kursfeststellung <sup>21</sup> ) |
| BCBE_STOP_TRADE               | (Unterbrechung der Börsenversammlung)                                   |
| BCBE_START_TRADE              | (Wiederaufnahme der Börsenversammlung)                                  |
| BCBE_ENTER_SP_RIGHT           | (Nebenrecht Back End)   |
| BCFE_ENTER_SP_RIGHT           | (Nebenrecht Front End)  |

im Feld subType geliefert. Belegt ist nur der Broadcast Header (außer bei Kursaussetzung, Wiederaufnahme nach Kursaussetzung und Nebenrecht, s.u.).

<sup>21</sup> Eine Wiederaufnahme der Kursfeststellung impliziert die Wiederaufnahme der Börsenversammlung. Der Broadcast BCBE\_START\_TRADE wird in diesem Fall nicht verschickt.

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 234                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

qsamStreamId → BC\_PUBLIC\_SYSTEM\_STATUS\_STREAM\_TYPE

|      |                           |  |
|------|---------------------------|--|
| Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId                                |
|      | bc_broadcast_headerT      | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |

Ein abweichendes Format besitzen die Broadcasts

BCBE\_DEACTIVATE\_PRICING,  
BCFE\_DEACTIVATE\_PRICING,  
BCBE\_REACTIVATE\_PRICING und  
BCFE\_REACTIVATE\_PRICING.

Zusätzlich zum Broadcast Header wird die folgende Struktur geliefert:

|                     |                            |
|---------------------|----------------------------|
| bc_brd_dea_pricingT | deactFromDat<br>deactToDat |
|---------------------|----------------------------|

Ein abweichendes Format besitzen die Broadcasts

BCFE\_DEACTIVATE\_PRICING\_BLOCK und  
BCFE\_REACTIVATE\_PRICING\_BLOCK.

Zusätzlich zum Broadcast Header werden die folgenden Strukturen geliefert:

|                       |                                       |
|-----------------------|---------------------------------------|
| bc_counterT           | counter                               |
| bc_brd_pricing_blockT | isinCod<br>deactFromDat<br>deactToDat |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 235                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

Ein abweichendes Format besitzen die Broadcasts

BCBE\_ENTER\_SP\_RIGHT und  
BCFE\_ENTER\_SP\_RIGHT.

Zusätzlich zum Broadcast Header wird die folgende Struktur geliefert:

|              |                |
|--------------|----------------|
| bc_sp_rightT | nrCod*         |
|              | isinCod*       |
|              | isinCodNew*    |
|              | ordrExePrcMod* |
|              | nrDat*         |



**Wir weisen darauf hin, dass für alle Subtypes bkrUserNo und qsamBkrNo mit „0000“ belegt ist.  
Der Stream hat kein Subject.**

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 236                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.26.2 XONTRO Request System Status News Retransmission

**Beschreibung** Stellt eine Applikation über die Kontrolle der Output Sequence Number fest, dass Nachrichten des Streams verloren wurde, kann sie diese Nachrichten mit dem Request **XONTRO Request System Status News Retransmission** vom XONTRO Back End nachfordern.

Voraussetzung hierfür ist die korrekte Verwaltung der Output Sequence Number in der Teilnehmerapplikation.

Die Wiederholung einer Übertragung ist nur für den Notfall vorgesehen. Aufgrund eines Fehlers der Teilnehmerapplikation wurden eventuell Nachrichten verloren.

Die Synchronisierung mit dem Empfang des Broadcast Streams ist ebenfalls Sache der Teilnehmerapplikation.

Der Request fordert Nachrichten (Sequenz-Nummern-Bereiche) vom Back End an und erhält eine Bestätigung per Response.

Die angeforderten Nachrichten werden vom Xontro Back End in der Bestandstransfer-Queue mit dem Wert „T“ im Feld **qsamMsgType** bereitgestellt. Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmerapplikation, die nachgeforderten Broadcasts gesondert zu verarbeiten.

Es können maximal 100 Sequenz-Nummern (von/bis) mit einem Retransmission Request angefordert werden. Es ist Sache der Anwendung, zu entscheiden, ob ein Folgerequest erforderlich ist.

Sind zu einem Request bzw. zu einer Sequenz-Nummer keine Daten vorhanden, dann erhält die Applikation den Completion Code „28060“ (qsamComplCode) in der Response.



|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 238                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

bc\_broadcast\_headerT

tranDat\*  
tranTim\*  
execTranDat\*  
execTranTim\*  
errFieldRef\*  
outSeqNo\*  
bkrUserNo\*  
isinCod\*  
subType\*

(bc\_brd\_dea\_pricingT,  
bc\_sp\_rightT)

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 239                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.1.26.3 XONTRO Private Status News

#### 2.1.26.3.1 Standardnachrichten (Format 1)

Beschreibung Der Stream **XONTRO Private Status News** erhält vom Back End alle relevanten Änderungen des Status einer KV-Nummer.

Es wird eine der Nachrichten

|                                 |  |
|---------------------------------|--|
| BCBE_START_QUOTE                | (Anforderung Start Quote Machine)                                    |
| BCBE_STOP_QUOTE                 | (Anforderung Stop Quote Machine)                                     |
| BCBE_EXCHANGE_QUOTE_VOLUME_INFO | (Status-Information über den Quote-Verbrauch des Börsen-Kontingents) |
| BCBE_BYPASS_QUOTE_VOLUME_INFO   | (Status-Information über den Quote-Verbrauch des Bypass-Kontingents) |
| BCBE_NOTIFY_PW_EXPIRATION_DATE  | (Restgültigkeit Passwort)  |

im Feld subType geliefert.

qsamStreamId → BC\_PRIVATE\_STATUS\_STREAM\_TYPE

|      |                           |   |
|------|---------------------------|---|
| Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId |
|------|---------------------------|---|

|  |                      |  |
|--|----------------------|--|
|  | bc_broadcast_headerT | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|--|----------------------|--|

(bc\_brd\_pw\_expiration\_datT oder  
bc\_brd\_exchange\_quote\_volume\_infoT oder  
bc\_brd\_bypass\_quote\_volume\_infoT)

In **errFieldRef** wird eine nähere Information für einen BCBE\_STOP\_QUOTE bzw. BCBE\_START\_QUOTE mitgeliefert:

|                             |   |
|-----------------------------|---|
| BC_ON_REQUEST               | (auf manuelle Anforderung)  |
| BC_VOLUME_OVERFLOW          | (Stopp wegen Überschreitung des Makler-Kontingentes oder Start nach Überschreitung des Makler-Kontingentes) |
| BC_EXCHANGE_VOLUME_OVERFLOW | (Stopp wegen Überschreitung des Börsen-   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 240                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

Kontingentes oder Start nach Überschreitung des Börsen-Kontingentes)

Für den Broadcast BCBE\_NOTIFY\_PW\_EXPIRATION\_DATE wird zusätzlich zum Broadcast Header folgende Struktur geliefert:

```
bc_brd_pw_expiration_datT      userNo
                                pwExpirationDat
```

Das gelieferte Datum ist in jedem Fall ein gültiges Kalenderdatum. Es muss jedoch kein Börsentag sein.

Für den Broadcast BCBE\_EXCHANGE\_QUOTE\_VOLUME\_INFO wird zusätzlich zum Broadcast Header folgende Struktur geliefert:

```
bc_brd_exchange_quote_       exchangeQuoteVolRate
volume_infoT                  exchangeQuoteVolMax
```

Für den Broadcast BCBE\_BYPASS\_QUOTE\_VOLUME\_INFO wird zusätzlich zum Broadcast Header folgende Struktur geliefert:

```
bc_brd_bypass_quote_        bypassQuoteVolAct
volume_infoT                  bypassQuoteVolMax
```

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 241                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 2.1.26.3.2 Versand fehlgeschlagener Broadcasts (Format 2)

**Beschreibung** In seltenen Fällen kann bei spezifischen Fehlerkonstellationen des Back Ends der Versand von Broadcastnachrichten fehlschlagen. Die Reihenfolge der Sequenznummern des betroffenen Streams ist dennoch lückenlos. Eine Front End Applikation kann die Fehlersituation also nicht erkennen. Die Datenbestände von Back End und Front End können im Extremfall auseinanderlaufen.

Der Stream BC\_PRIVATE\_ORDER\_UPDATE\_STREAM\_TYPE ist davon ausgenommen. Hier wird immer eine korrekte Übermittlung sichergestellt.

Mit folgendem Verfahren werden dem Teilnehmer die fehlenden Nachrichten zugestellt:

Die betroffenen Nachrichten werden ermittelt und mit dem Subtype **BCBE\_LOST\_MESSAGE** über den Stream der PRIVATE STATUS NEWS an alle betroffenen MISSen verschickt. Der Datenteil dieses Broadcasts besteht aus der vollständigen fehlenden Nachricht. Im Broadcastheader der fehlenden Nachricht (2. Broadcastheader) ist die Output Sequence Number mit dem Wert versorgt, den die nächste tatsächlich versendete Nachricht erhalten hat.

Damit wird dem Front End die Möglichkeit gegeben, die korrekte Position der Nachricht zu bestimmen. Fehlen zwischen zwei übermittelten Broadcasts mehrere Nachrichten, dann werden sie bei einer Wiederholung der Übertragung in der Reihenfolge übertragen, in der sie ursprünglich erzeugt wurden.

qsamStreamId → BC\_PRIVATE\_STATUS\_STREAM\_TYPE

|      |                           |   |
|------|---------------------------|---|
| Data | bc_qsam_broadcast_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId |
|------|---------------------------|---|

Geliefert wird ein Broadcastheader und die vollständige ursprüngliche Nachricht

|                      |  |
|----------------------|--|
| bc_broadcast_headerT | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>outSeqNo<br>bkrUserNo<br>isinCod<br>subType |
|----------------------|--|

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

|                      |                    |
|----------------------|--------------------|
| bc_broadcast_headerT | tranDat<br>tranTim |
|----------------------|--------------------|

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 242                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

execTranDat  
execTranTim  
errFieldRef  
outSeqNo  
bkrUserNo  
isinCod  
subType

und irgendeine der im System definierten Broadcast-Datenstrukturen

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 243                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

#### 2.1.26.4 XONTRO Request Private Status News Retransmission

**Beschreibung** Stellt eine Applikation über die Kontrolle der Output Sequence Number fest, dass Nachrichten des Streams verloren wurden, kann sie diese Nachrichten mit dem Request **XONTRO Request Private Status News Retransmission** nachfordern.

Voraussetzung hierfür ist die korrekte Verwaltung der Output Sequence Number in der Teilnehmerapplikation.

Die Wiederholung einer Übertragung ist nur für den Notfall vorgesehen. Aufgrund eines Fehlers der Teilnehmerapplikation wurden eventuell Nachrichten verloren.

Die Synchronisierung mit dem Empfang des Broadcast Streams ist ebenfalls Sache der Teilnehmerapplikation.

Der Request fordert Nachrichten (Sequenz-Nummern-Bereiche) vom Back End an und erhält eine Bestätigung per Response.

Die angeforderten Nachrichten werden vom Xontro Back End in der Bestandstransfer-Queue mit dem Wert „T“ im Feld qsamMsgType bereitgestellt. Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmerapplikation, die nachgeforderten Broadcasts gesondert zu verarbeiten.

Es können maximal 100 Sequenz-Nummern (von/bis) mit einem Retransmission Request angefordert werden. Es ist Sache der Anwendung, zu entscheiden, ob ein Folgerequest erforderlich ist.

Sind zu einem Request bzw. zu einer Sequenz-Nummer keine Daten vorhanden, dann erhält die Applikation den Completion Code „28060“ (qsamComplCode) in der Response.

qsamRequestId → BC\_RET\_PRIVATE\_STATUS\_NEWS\_RID

|               |                          |   |
|---------------|--------------------------|---|
| Request Data  | bc_qsam_request_headerT  | qsamId <sup>m</sup><br>qsamMsgType <sup>m</sup><br>qsamRequestId <sup>m</sup><br>qsamExchangeld <sup>m</sup><br>qsamUserId <sup>m</sup> |
|               | bc_request_headerT       | inSeqNo <sup>o</sup>  |
|               | bc_request_retransT      | startStmSeqNo <sup>m</sup><br>stopStmSeqNo <sup>m</sup>   |
| Response Data | bc_qsam_response_headerT | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamRequestId<br>qsamExchangeld<br>qsamUserId<br>qsamComplCode   |

*Diese Struktur wird auf der folgenden Seite fortgesetzt*

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 244                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

|                |  |   |
|----------------|--|---|
|                | bc_response_headerT  | tranDat<br>tranTim<br>execTranDat<br>execTranTim<br>errFieldRef<br>inSeqNo  |
| qsamStreamId → | BC_RET_PRIVATE_STATUS_STREAM_TYPE  |   |
|                | mehrere Nachrichten bestehend aus: jeweils ein Broadcast Header und gegebenenfalls die aufgeführte Struktur (Format 1) oder jeweils einem Broadcastheader und einer vollständigen Broadcastnachricht (Lost Message). |   |
| Data           | bc_qsam_broadcast_headerT  | qsamId<br>qsamMsgType<br>qsamExchangeld<br>qsamDat<br>qsamBkrNo<br>qsamStreamId   |
| Format 1       | bc_broadcast_headerT   | tranDat*<br>tranTim*<br>execTranDat*<br>execTranTim*<br>errFieldRef*<br>outSeqNo*<br>bkrUserNo*<br>isinCod*<br>subType* |
|                | (bc_brd_pw_expiration_datT oder bc_brd_exchange_quote_volume_infoT oder bc_brd_bypass_quote_volume_infoT)  |   |
| Format 2       | bc_broadcast_headerT<br><br>bc_broadcast_headerT   |   |
|                | und irgendeine der im System definierten Broadcast-Datenstrukturen   |   |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 245                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

## 2.2 Programmierhinweise

### 2.2.1 Behandlung von Inquire-Streams

Alle Inquire-Streams liefern Datenblöcke, die mehrere Nachrichten enthalten können.

Diese Blöcke sollten wie folgt ausgewertet werden:

Die erste Struktur eines Blocks enthält grundsätzlich Headerinformationen, die bei einem Folgezugriff als Aufsetzpunkt verwendet werden können.

Dann folgen n Einzelnachrichten, die jeweils aus einem Subtype und der eigentlichen Datenstruktur bestehen. Der Subtype ist entweder mit einem für den jeweiligen Inquire-Stream spezifischen Defaultwert oder mit einem End-Code belegt.

Findet man einen End-Code, dann folgen keine weiteren Daten für diesen Stream.

Ist dies nicht der Fall, dann kann die auf den Subtype folgende Nachrichtenstruktur extrahiert und verarbeitet werden, und danach mit der Prüfung des nächsten Subtypes die Verarbeitung fortgesetzt werden.

Die Ausprägungen des Subtypes können der Beschreibung der einzelnen Inquire-Streams entnommen werden.

Aufbau eines Standardblocks:

|        | Nachricht 1 |       | Nachricht 2 |       |  | Nachricht n |       |
|--------|-------------|-------|-------------|-------|--|-------------|-------|
| Header | X           | Daten | X           | Daten |  | X           | Daten |

Aufbau des letzten Blocks:

|        | Nachricht 1 |       |  | Nachricht n |
|--------|-------------|-------|--|-------------|
| Header | X           | Daten |  | End-Code    |

Dabei steht „X“ für den Subtype.

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 246                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

## 2.2.2 Synchronisation von Quotes

Wird über den Stream **XONTRO Subscribe Order Update** einer der Subtypes **BCBE\_ENTER\_PRICE, BCFE\_ENTER\_PRICE, BCFE\_ENTER\_BLOCK\_PRICE, BCBE\_ENTER\_QUOTE, BCBE\_DEACTIVATE\_QUOTE**<sup>22</sup> empfangen, dann ist zu beachten, dass das Back End auf dem Front End generierte Quotes in der betroffenen ISIN solange nicht mehr entgegennimmt, bis das Front End den Empfang dieser Nachrichten in dem Felde **confirmTim** quittiert hat. Aus Sicht der Anwendungsprogrammierung kann dies durch entsprechende Einträge im Request **XONTRO Enter Quote oder XONTRO Enter Mass Quote** erreicht werden<sup>23</sup>.

Es ist Sache einer Quote Machine geeignet zu reagieren: Zunächst sollte die Generierung auf die geänderte Situation des Back End angepasst werden, dann sollte gegebenenfalls ein neuer Quote abgesetzt werden.

<sup>22</sup> es sei denn das Back End liefert den Werte BC\_DO\_NOT\_CONFIRM im Feld confirmTim

<sup>23</sup> siehe Beschreibung des Requests XONTRO Enter Quote

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 247                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 2.2.3 Blockierung von Applikation mit hohem Fehlerrate

Versendet eine Applikation fehlerhafte Requests mit hoher Frequenz, kann dieses zu ernsthaften Performanceproblemen und vorübergehenden Blockaden der gesamten Teilnehmerinstallation führen.

Um zu verhindern, dass sich das Fehlverhalten eines Einzelnen auf alle Nutzer negativ auswirkt, wird XONTRO in Zukunft alle Applikationen überwachen und bei Überschreitung einer bestimmten Fehlerquote geeignete Maßnahmen ergreifen:

Die Überwachung geschieht auf Ebene der QSAM-Id. Die Überschreitung einer definierten Fehleranzahl innerhalb eines definierten Zeitintervalls kann zu einem vorübergehenden Stopp des Teilnehmer-Channels führen.

Ein Teilnehmer sollte beim ersten Auftreten einer Sperre sofort mit geeigneten Maßnahmen reagieren, da auch für ihn selbst kein sinnvolles Weiterarbeiten mehr möglich ist.

Es können sowohl Datenmodifikationen (z.B. eine Passwortänderung) als auch Änderungen der betroffenen Applikation erforderlich sein.

Die in Simulation bzw. Produktion konkret verwendeten Werte für Sperrzeiten etc. werden den Teilnehmern im Rahmen der Release Notes mitgeteilt.

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 248                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

## 2.2.4 Programmierhinweise für MAX-ONE

Kann ein in MAX-ONE zustande gekommenes Geschäft in einer Nachricht verschickt werden, dann existieren keine wesentlichen Besonderheiten der Programmierung. Grundsätzlich bestehen dann keine Unterschiede zu einem Request XONTRO Enter Single Trade.

Die Behandlung von Geschäften, die in mehreren Teilnachrichten versendet werden, wird an folgendem Beispiel erläutert; dabei bezeichnen der Begriff Basisrequest den Request **XONTRO Enter Exchange Trade** und der Begriff Referenzrequest den Request **XONTRO Enter Exchange Trade Reference**.



Dann sollte z. B folgende Programmiersequenz eingehalten werden<sup>24</sup>:

Ermitteln der Anzahl der Teilnachrichten und der Input Sequence Numbers  
Versenden des ersten Referenzrequests  
Abwarten der Response; bei Fehler Abbruch der Verarbeitung

Versenden der restlichen Referenzrequests  
Abwarten aller Responses; Abbruch der Verarbeitung, falls Fehler aufgetreten sind

Versenden des Basisrequests  
Prüfen der Response

Auf die erste Response sollte gewartet werden, da bei einer negativen Quittung keine weiteren Teilnachrichten eingestellt werden können.

Der Basisrequest kann erst dann sinnvoll abgesetzt werden, wenn die Responses aller Reference Requests bekannt sind. Tritt nämlich bei einer Response ein Fehler auf, dann ist die gesamte Nachrichtenkette ungültig. Wird in dieser Situation trotzdem der Basisrequest abgesetzt, dann wird er mit einem Fehlercode 29370 abgewiesen.

Auf die folgende Sondersituation sollte der Anwendungsprogrammierer dabei unbedingt achten:

- Der erste Referenzrequest wurde vom Back End akzeptiert.
- Genau einer der folgenden Referenzrequests ist fehlerhaft
- Der Fehler im Request lässt keine Zuordnung zum ersten Referenzrequest zu (z. B. falsche Request-Id, Formatfehler in inSeqNoRef, etc.)

In diesem Fall kann das Back End zwar die einzelne Teilnachricht verwerfen, aber keine korrekte Zuordnung zur gesamten Kette der Nachrichten vornehmen. Trifft jetzt ein gültiger Basisrequest ein, dann wird das Geschäft – weil formal korrekt – verarbeitet. Es ist aber logisch falsch.

<sup>24</sup> das Abhören der Broadcasts ist nicht berücksichtigt

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 249                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

Aus diesem Grund muss die Applikation bei Auftreten der ersten negativen Response für eine Teilnachricht die Nachrichtenübertragung für dieses Geschäft abbrechen.

Natürlich kann auch voll synchron gearbeitet werden. Erforderlich ist dies jedoch nicht.

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 250                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 3 Anhang

#### 3.1 Datenformate und Initialwerte

| Name                 | Beschreibung   | Initialwerte   |
|----------------------|--|--|
| [n]                  | Länge des Feldes   |  |
| [n,m]                | Länge des Feldes (n), Anzahl Nachkommastellen (m)  |  |
| char[n]              | alle Zeichen (printable)   | Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Spaces über die gesamte Feldlänge.                              |
| charboss[n]          | zugelassener Zeichenvorrat:<br>1.) Spaces<br>2.) A – Z, a - z<br>3.) 0 - 9<br>4.) Sonderzeichen: / - ? : ( ) . , ' + | Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Spaces über die gesamte Feldlänge.                              |
| num[n,m]<br>num[n]   | Ziffern 0 - 9, ohne Vorzeichen   | Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.                              |
| Snum[n,m]<br>Snum[n] | Ziffern 0 - 9, 1. Stelle Vorzeichen  | Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge und „+“ in der ersten Stelle. |
| amountboss           | Snum[16,2], Betrag mit Länge 15 und Genauigkeit 2 mit Vorzeichen   | Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge und „+“ in der ersten Stelle. |
| dateboss             | num[8], Datum CCYYMMDD   | Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.                              |
| limitboss            | num[10,4], Betrag mit Länge 10 und Genauigkeit 4 ohne Vorzeichen   | Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.                              |
| priceboss            | num[10,4], Betrag mit Länge 10 und Genauigkeit 4 ohne Vorzeichen   | Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.                              |
| timeboss             | num[8], Zeit HHMMSSCC  | Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.                              |
| volumeboss           | num[13,3], Betrag mit Länge 13 und Genauigkeit 3 ohne Vorzeichen   | Die Initialisierung des Feldes erfolgt durch Vergabe von Nullen über die gesamte Feldlänge.                              |

Bei einem numerischen Feld der Länge 10 sagt die Angabe num[10,4] aus, dass es sich um ein Feld mit 4 Nachkommastellen handelt. Ein Dezimalpunkt bzw. ein Dezimalkomma ist nicht explizit in den Daten vorhanden.

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 251                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 3.2 Felddescription

| Feldname            | Definition              | Bemerkung   |
|---------------------|-------------------------|---|
| acctTypCodXontro    | char[2]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen Eigengeschäft<br><u>Feldinhalt:</u><br>Bei Requests und Broadcasts, welche Orders betreffen:<br>'blank' = kein Eigengeschäft<br><br>Bei Requests und Broadcasts, welche Aufgaben oder Geschäfte betreffen:<br>'blank' = kein Eigengeschäft<br>'EE' = Eigengeschäft<br><br>Im Request <b>XONTRO Exchange Trade Reference</b> sind auch die Ausprägungen<br>'A' = Kundengeschäft und<br>'P' = Eigengeschäft<br>zulässig. |
| acctTypCodXontroAsk | char[2]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen Eigengeschäft Verkauf<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [acctTypCodXontro]   |
| acctTypCodXontroBid | char[2]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen Eigengeschäft Kauf<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [acctTypCodXontro]  |
| acrIntDay           | Snum[4]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Angabe der Zinstage, für welche die Stückzinsberechnung erfolgt  |
| acrIntDayCod        | char[2]                 | <u>Wichtiger Hinweis:</u><br>Dieses Feld wird in XONTRO nicht mehr unterstützt. Bei nicht initialer Belegung wird die Nachricht abgelehnt.  |
| algoFlag            | char[1]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen „Algorithmic Order“<br><u>Feldinhalt:</u><br>'blank' = keine Algo-Order<br>J = Algo-Order  |
| allotCapQty         | num [13,3]              | <u>Erläuterung:</u><br>Nominalobergrenze (für zukünftige Verwendung reserviert)   |
| allotType           | char [2]                | <u>Erläuterung:</u><br>Auslosungsvariante (für zukünftige Verwendung reserviert)  |
| auctRondLotInc      | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Inkrement der Einheitsnotierung<br><u>Feldinhalt:</u><br>1 = Vielfaches von [instRondLotMinQty]<br>2 = Mindestbetrag und danach Vielfaches von [auctRondLotQty]  |
| auctRondLotMinQty   | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Mindestbetrag bei der Einheitsnotierung;<br>handelbare Nominalen dürfen nicht kleiner als der Mindestbetrag sein;<br>Beträge darüber hinaus folgen den Regeln von [auctRondLotInc] und [auctRondLotQty]  |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 252                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname          | Definition              | Bemerkung  |
|-------------------|-------------------------|--|
| auctRondLotQty    | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Kleinste handelbare Einheit bei der Einheitsnotierung;<br>bei [auctRondLotInc] = 1 sind Vielfache vom Mindestbetrag [auctRondLotMinQty] handelbar<br>bei [auctRondLotInc] = 2 gibt dieses Feld an, in welchen Schritten über dem Mindestbetrag [auctRondLotMinQty] gehandelt werden kann. |
| bcNewPwd          | char[8]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Neues SECU-Passwort bei Passwortänderung  |
| bcOldPwd          | char[8]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Altes SECU-Passwort bei Passwortänderung  |
| bcPwd             | char[8]                 | <u>Erläuterung:</u><br>SECU-Passwort   |
| bKeyInq           | num[9]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Schlüssel zum Aufsetzen in einem Bestand<br><u>Prüfung:</u><br>Der Wert 0 ist nicht zulässig  |
| bKeyOrdr          | num[9]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Schlüssel zum Aufsetzen in einem Orderbestand<br><b>Feldinhalt:</b><br>Zahl<br><u>Prüfung:</u><br>Der Wert 0 ist nicht zulässig   |
| bkrDiaryNo        | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Laufende Nummer des Maklertagebuches  |
| bkrNo             | num[4]                  | <u>Erläuterung:</u><br>KV-Nummer eines Teilnehmers am Systemanschluss Makler.<br><b>Feldinhalt:</b><br>4-stellige Makler KV-Nummer<br><u>Prüfung:</u><br>Der Orderempfänger muss Börsenteilnehmer (Makler) am jeweiligen BPL sein.   |
| bkrQuoteVolRemain | num[9]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Verbleibendes Quote-Kontingent in der KV-Nummer des Maklers am aktuellen Börsentag.   |
| bkrSubNo          | num[2]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Makler-Sub-Nummer<br>Die Makler-Sub-Nummer ist die Nummer des Mitarbeiters eines Maklers.<br>Sie wird aus den letzten beiden Stellen der Anwenderidentifikation [userNo] gebildet.  |
| bkrUserNo         | num[4]                  | <u>Erläuterung:</u><br>KV-Nummer des Systemteilnehmers/Maklers, der Sender bzw. Empfänger der Nachrichtendatensätze ist.<br><u>Prüfung:</u><br>Der Systemteilnehmer muss Börsenteilnehmer (Makler) am jeweiligen Börsenplatz sein.   |
| bonusDifAmtAsk    | Snum[10,2]              | <u>Erläuterung:</u><br>Boni-Differenz auf der Verkaufseite   |
| bonusDifAmtBid    | Snum[10,2]              | <u>Erläuterung:</u><br>Boni-Differenz auf der Kaufseite  |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 253                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname      | Definition | Bemerkung   |
|---------------|------------|---|
| bonusRat      | Snum[6,3]  | <u>Erläuterung:</u><br>Bonifikationssatz (mit Vorzeichen!)<br>In diesem Feld wird bei Neuemissionen die prozentuale Ermäßigung (bzw. Erhöhung) des Kurswertes hinterlegt.   |
| bonusRatAsk   | Snum[6,3]  | <u>Erläuterung:</u><br>Bonifikationssatz (mit Vorzeichen!) auf der Verkaufseite   |
| bonusRatBid   | Snum[6,3]  | <u>Erläuterung:</u><br>Bonifikationssatz (mit Vorzeichen!) auf der Kaufseite  |
| btradeCod     | char[1]    | <u>Erläuterung:</u><br>Aufgabenstatus<br>In diesem Feld wird dem Teilnehmer übermittelt, ob es sich um eine endgültige oder eine Zwangsaufgabe handelt.<br><b>Feldinhalt:</b><br>E = endgültige Aufgabe<br>V = vorläufige Aufgabe<br>Z = Zwangsaufgabe  |
| btradeCodAsk  | char[1]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen einer endgültigen Aufgabe auf der Verkaufseite<br><b>Feldinhalt:</b><br>'blank'<br>oder<br>0 = Keine Aufgabe<br>1 = Aufgabe<br>3 = Aufgabenschließung<br>4 = Aufgabenweitergabe  |
| btradeCodBid  | char[1]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen einer endgültigen Aufgabe auf der Kaufseite<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [btradeCodAsk]   |
| btradeEnfCod  | char[1]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen Zwangsaufgabe oder Zwangsschließung<br><b>Feldinhalt:</b><br>A = Zwangsaufgabe<br>S = Zwangsschließung *<br>'blank' = default<br>*nur in CCP-Gattungen am Börsenplatz Frankfurt  |
| btradeNo      | num[13]    | <u>Erläuterung:</u><br>Aufgaben-Nummer<br>Die Aufgaben-Nummer wird automatisch durch XONTRO vergeben. Sie ist zusammen mit dem Börsenplatz [tranExchangeld] eindeutig und kann als Identifizierungskennzeichen verwendet werden. Eine vorläufige Aufgabe besitzt eine (XONTRO-interne) Aufgaben-Nummer, bei einer endgültigen Aufgabe ist das Feld mit einer Geschäftsnummer belegt |
| btradeNoAsk   | num[13]    | <u>Erläuterung:</u><br>Aufgaben-Nummer der Verkaufseite   |
| btradeNoBid   | num[13]    | <u>Erläuterung:</u><br>Aufgaben-Nummer der Kaufseite  |
| btradeTextAsk | char[3]    | <u>Erläuterung:</u><br>Information über Schließung einer vorläufigen Aufgabe auf der Verkaufseite. Feld wird nur bei vorläufigen Aufgaben gefüllt.<br><b>Feldinhalt:</b><br>TSL = Manuelle Aufgabenschließung<br>ISL = Interne Aufgabenschließung   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 254                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname           | Definition              | Bemerkung  |
|--------------------|-------------------------|--|
| btradeTextBid      | char[3]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Information über Schließung einer vorläufigen Aufgabe auf der Kaufseite. Feld wird nur bei vorläufigen Aufgaben gefüllt.<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [btradeTextAsk]  |
| busDat             | dateboss<br>num[8]      | <u>Erläuterung:</u><br>Börsentag   |
| buyCod             | char[1]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Geschäftsart der Order/des Geschäfts/der Aufgabe<br><b>Feldinhalt:</b><br>K = Kauf<br>V = Verkauf   |
| bypassQuoteVolAct  | num[9]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Quote Bypass: Aktuell verbrauchtes Kontingent der KV-Nummer   |
| bypassQuoteVolMax  | num[9]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Quote Bypass: Maximales Kontingent der KV-Nummer  |
| changeQty          | Snum[14,3]              | <u>Erläuterung:</u><br>Nominaländerung einer Aufgabenposition (mit Vorzeichen!)  |
| chargesAsk         | Snum[12,2]              | <u>Erläuterung:</u><br>Spesen auf der Verkaufseite (inkl. Vorzeichen)<br><b>Feldinhalt:</b><br>Spesen in EUR   |
| chargesBid         | Snum[12,2]              | <u>Erläuterung:</u><br>Spesen auf der Kaufseite (inkl. Vorzeichen)<br><b>Feldinhalt:</b><br>Spesen in EUR  |
| checkExePrcAsk     | limitboss<br>num[10,4]  | <u>Erläuterung:</u><br>Bestes Limit auf der Verkaufseite (nach „bestens“)  |
| checkExePrcBid     | limitboss<br>num[10,4]  | <u>Erläuterung:</u><br>Bestes Limit auf der Kaufseite (nach „billigst“)  |
| checkExeQtyAsk     | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Kumulierte ausführbare Nominale auf der Verkaufseite  |
| checkExeQtyBid     | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Kumulierte ausführbare Nominale auf der Kaufseite   |
| clearingCurrTypCod | char[3]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Abrechnungswährung (ISO-Bezeichner)   |
| clientCod          | char[20]                | <u>Erläuterung:</u><br>Client Identification Code (MiFID II)   |
| clientInd          | char[1]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Indikator für den Inhalt des Feldes „clientCod“<br><b>Feldinhalt:</b><br>'blank' = keine Angabe<br>1 = Shortcode<br>4 = User-Shortcode (User-Identifikation in Xontro)<br>L = LEI (Legal Entity Identifier)<br>A = AGGR<br>P = PNAL |
| comAmtAsk          | Snum[12,2]              | <u>Erläuterung:</u><br>Provisionsbetrag auf der Verkaufseite (inkl. Vorzeichen)<br><b>Feldinhalt:</b><br>Enthält die Provision in EUR, die die orderaufgebende Bank von der Wegen-Bank erhält.   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 255                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname               | Definition         | Bemerkung  |
|------------------------|--------------------|--|
| comAmtBid              | Snum[12,2]         | <u>Erläuterung:</u><br>Provisionsbetrag auf der Kaufseite (inkl. Vorzeichen)<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [ comAmtAsk]  |
| comCodAsk              | char[2]            | <u>Erläuterung:</u><br>Provisionskennzeichen auf der Verkaufseite<br><u>Feldinhalt:</u><br>'blank' = keine Provision<br>PD = Provisionsbetrag in EUR<br>PM = Provisionsatz in Promille   |
| comCodBid              | char[2]            | <u>Erläuterung:</u><br>Provisionskennzeichen auf der Kaufseite<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [comCodAsk]   |
| commissionAgentFlag    | char[1]            | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen, ob ein Freimakler als Kommissionär handelt.<br><u>Feldinhalt:</u><br>'blank', 'N' = nein<br>'J' = ja   |
| commissionAgentFlagAsk | char[1]            | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen Verkaufseite, ob ein Freimakler als Kommissionär handelt.<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [commissionAgentFlag]   |
| commissionAgentFlagBid | char[1]            | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen Kaufseite, ob ein Freimakler als Kommissionär handelt.<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [commissionAgentFlag]  |
| comRateAsk             | Snum[6,3]          | <u>Erläuterung:</u><br>Provisionsatz auf der Verkaufseite (inkl. Vorzeichen)<br><u>Feldinhalt:</u><br>Enthält den Provisionsatz in Promille.   |
| comRateBid             | Snum[6,3]          | <u>Erläuterung:</u><br>Provisionsatz auf der Kaufseite (inkl. Vorzeichen)<br><u>Feldinhalt:</u><br>Enthält den Provisionsatz in Promille.  |
| confirmTim             | timeboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Zeitstempel, der im Request XONTRO Enter Quote mitzugeben ist.<br>Liefert eine Broadcastnachricht den Wert BC_DO_NOT_CONFIRM, dann ist keine Quittierung erforderlich.<br>Stellt ein Request XONTRO Enter Quote den Wert BC_DO_NOT_CHECK_CONFIRM_TIM ein, dann prüft das BE nicht, ob in dieser ISIN ein Ereignis vorliegt, das eine Quittung verlangt. |
| confirmTimBypass       | timeboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Vom Backend vergebener Zeitstempel, der im Request XONTRO Enter Quote via Bypass im Feld confirmTim mitzugeben ist.   |
| confirmTimCurrent      | timeboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Zeitstempel des letzten akzeptierten FE Quotes für eine ISIN  |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 256                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname              | Definition              | Bemerkung  |
|-----------------------|-------------------------|--|
| contAuctInd           | char[1]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen fortlaufende Notierung<br>Das Kennzeichen gibt an, ob ein Wertpapier zur fortlaufenden Notierung zugelassen ist.<br><u>Feldinhalt:</u><br>J = variable Notierung<br>N = keine variable Notierung  |
| contAuctRondLotInc    | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Inkrement der fortlaufenden Notierung<br><u>Feldinhalt:</u><br>1 = Vielfaches von [contAuctRondLotMinQty]<br>2 = Mindestbetrag und danach Vielfaches von [contAuctRondLotQty]   |
| contAuctRondLotQty    | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Kleinste übertragbare Einheit bei variablen Notierung;<br>bei [contAuctRondLotInc] = 1 sind Vielfache vom Mindestbetrag [contAuctRondLotMinQty] handelbar;<br>bei [contAuctRondLotInc] = 2 gibt dieses Feld an, in welchen Schritten über dem Mindestbetrag [contAuctRondLotMinQty] gehandelt werden kann.                      |
| contAuctRondLotMinQty | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Mindestbetrag bei der fortlaufenden Notierung;<br>handelbare Nominalen dürfen nicht kleiner als der Mindestbetrag sein;<br>Beträge darüber hinaus folgen den Regeln von [contAuctRondLotInc] und [contAuctRondLotQty]   |
| counter               | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Neutraler Zähler zur beliebigen Verwendung  |
| ctpyExchangeld        | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Börsenplatz des Kontrahenten<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [exchangeld]   |
| ctpyLei               | char[20]                | <u>Erläuterung:</u><br>LEI (Legal Entity Identifier) des Börsenteilnehmers, der als Kontrahent bei Aufgaben/halben Geschäften/Geschäften benannt wird.   |
| ctpyLeiAsk            | char[20]                | <u>Erläuterung:</u><br>LEI des Kontrahenten auf der Verkaufseite   |
| ctpyLeiBid            | char[20]                | <u>Erläuterung:</u><br>LEI des Kontrahenten auf der Kaufseite  |
| ctpyNo                | num[4]                  | <u>Erläuterung:</u><br>KV-Nummer des Börsenteilnehmers, der als Aufgeber der Order benannt wird, bzw. Kontrahent bei Aufgaben/halben Geschäften/Geschäften, bzw. Eingeber bei Request XONTRO Enter MiFID Posttrade Report<br><u>Prüfung:</u><br>Die KV-Nummer muss als Börsenteilnehmer (Bank oder Makler) am jeweiligen Börsenplatz eingetragen sein. |
| ctpyNoAsk             | num[4]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Kontrahent auf der Verkaufseite   |
| ctpyNoBid             | num[4]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Kontrahent auf der Kaufseite  |
| ctpySubNo             | num[2]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Makler-Sub-Nummer des Kontrahenten  |
| ctpyTradMtchPrc       | priceboss<br>num[10,4]  | <u>Erläuterung:</u><br>Von einem Kopfkurs abweichender Kurs des jeweiligen Kontrahenten  |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 257                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname           | Definition | Bemerkung   |
|--------------------|------------|---|
| currExcRat         | num[10,5]  | <u>Erläuterung:</u><br>Devisenkurs  |
| currExcRatAsk      | num[10,5]  | <u>Erläuterung:</u><br>Devisenkurs auf der Verkaufseite   |
| currExcRatBid      | num[10,5]  | <u>Erläuterung:</u><br>Devisenkurs auf der Kaufseite  |
| currTypCod         | char[3]    | <u>Erläuterung:</u><br>Währung der Notierung  |
| currTypCodDep      | char[3]    | <u>Erläuterung:</u><br>Depotwährung eines Wertpapiers/Instruments   |
| custodyTypCod      | num[3]     | <u>Erläuterung:</u><br>Verwahrart entsprechend WM Feld GD400  |
| customerId         | char[8]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kundenkennung, der Inhalt hängt vom Wert des Feldes [customerIdClass] ab<br><u>Prüfung (1. Angabe: Inhalt von [customerIdClass], 2. Angabe: Prüfung)</u><br>B numerisch 8 Stellen<br>D numerisch 8 Stellen<br>F alphanumerisch 8 Stellen<br>K numerisch 4 Stellen<br>M alpha 5 Stellen<br>R alphanumerisch 8 Stellen<br>S alphanumerisch 8 Stellen<br>U alphanumerisch 8 Stellen<br>V alphanumerisch 8 Stellen |
| customerIdAsk      | char[8]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kundenkennung Verkaufseite, der Inhalt hängt vom Wert des Feldes [customerIdClass] ab<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [customerId]   |
| customerIdBid      | char[8]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kundenkennung Kaufseite, der Inhalt hängt vom Wert des Feldes [customerIdClass] ab<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [customerId]  |
| customerIdClass    | char[1]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen, nach welcher Schlüsselssystematik ein Kunde identifiziert wird<br><b>Feldinhalt:</b><br>B Bankleitzahl<br>D DWZ-interne Nummer<br>F Fonds<br>K Kassenvereinsnummer<br>M Member-Id<br>R Depot-Ident Nr.<br>S Depot-Ident Nr.<br>U Kunden-Ident Nr.<br>V Kunden-Ident Nr.   |
| customerIdClassAsk | char[1]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen, nach welcher Schlüsselssystematik ein Kunde identifiziert wird (Verkaufseite)<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [customerIdClass]   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 258                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname           | Definition         | Bemerkung   |
|--------------------|--------------------|---|
| customerIdClassBid | char[1]            | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen, nach welcher Schlüsselssystematik ein Kunde identifiziert wird (Kaufseite)<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [customerIdClass]  |
| cutoffTim          | timeboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Uhrzeit des Annahmeschlusses; siehe WM Feld XD153  |
| deactCod           | char[1]            | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen Kursaussetzung<br><b>Feldinhalt:</b><br>J = die Gattung (ISIN) ist kursausgesetzt<br>'blank' = keine Kursaussetzung  |
| deactComment       | char[2]            | <u>Erläuterung:</u><br>Zusatz bei Kursaussetzung für Rentenpapiere<br><b>Feldinhalt:</b><br>_Z = gestrichen Ziehung<br>PO = Public Offering (Zeichnungssperre)<br>'blank' = kein Kurszusatz                 |
| deactFromDat       | dateboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Datum Beginn einer Kursaussetzung  |
| deactText          | char[35]           | <u>Erläuterung:</u><br>Freitextfeld bei Kursaussetzung/Rücknahme  |
| deactToDat         | dateboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Datum Ende einer Kursaussetzung bzw. Rücknahmedatum einer Kursaussetzung   |
| deaFlag            | char[1]            | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen für die Übermittlung als „Direct Electronic Access“ (MiFID II)<br><b>Feldinhalt:</b><br>'blank' = kein DEA<br>J = DEA  |
| eccpCod            | char[1]            | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen ECCP-Geschäft<br><b>Feldinhalt:</b><br>J = ECCP-Geschäft<br>'blank' = kein ECCP-Geschäft   |
| endSubscrptDat     | Dateboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Datum des Zeichnungsendes; siehe WM Feld XD384   |
| enterTim           | Timeboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Eingabezeit<br><b>Feldinhalt:</b><br>Manuell vorgegebene Zeit bei Kurseingabe manuell bzw. Kursänderung manuell  |
| emiCod             | num[7]             | <u>Erläuterung:</u><br>Emittentennummer   |
| errCod             | num[9]             | <u>Erläuterung:</u><br>Fehlercode. Das Feld wird verwendet, wenn mehrere Fehler in einer Nachricht an eine Applikation zurückgemeldet werden müssen<br><b>Feldinhalt:</b><br>Entspricht dem Completion Code |
| errFieldRef        | num[3]             | <u>Format 1:</u><br>Referenznummer des Feldes, bei dessen Überprüfung der erste Fehler festgestellt wurde.  |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 259                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname             | Definition         | Bemerkung   |
|----------------------|--------------------|---|
|                      |                    | <p><b>Feldinhalt:</b><br/>Die Feldinhalte werden in 3.4. erläutert.</p> <p><b>Format 2:</b><br/>Zusätzliche Information für die Subtypes BCBE_START_QUOTE und BCBE_STOP_QUOTE.</p> <p><b>Feldinhalt:</b><br/>BC_ON_REQUEST (auf Anforderung)<br/>BC_VOLUME_OVERFLOW (Makler-Kontingent überschritten)<br/>BC_EXCHANGE_VOLUME_OVERFLOW (Börsen-Kontingent überschritten)</p> |
| exchangeId           | num[3]             | <p><b>Erläuterung:</b><br/>Börsenplatz</p> <p><b>Feldinhalt:</b><br/>100 = Berlin<br/>120 = Düsseldorf<br/>130 = Frankfurt<br/>140 = Hamburg<br/>150 = Hannover<br/>160 = München<br/>170 = Stuttgart</p>   |
| exchangeIdAsk        | num[3]             | <p><b>Erläuterung:</b><br/>Börsenplatz der Verkaufseite</p> <p><b>Feldinhalt:</b><br/>siehe Feld [exchangeId]</p>   |
| exchangeIdBid        | num[3]             | <p><b>Erläuterung:</b><br/>Börsenplatz der Kaufseite</p> <p><b>Feldinhalt:</b><br/>siehe Feld [exchangeId]</p>  |
| exchangeOrdNum       | char[13]           | <p><b>Erläuterung:</b><br/>Von einem externen Börsenhandelssystem vergebene Ordnernummer</p> <p><b>Feldinhalt:</b><br/>Ordnernummer des MAX-ONE Systems</p>   |
| exchangeQuoteVolRate | num[3]             | <p><b>Erläuterung:</b><br/>Prozentsatz der verbrauchten Quotes vom maximalen Börsen-Kontingent</p> <p><b>Feldinhalt:</b><br/>Enthält den aktuellen Kontingent-Verbrauch in Prozent</p>  |
| exchangeQuoteVolMax  | num[9]             | <p><b>Erläuterung:</b><br/>Maximales Börsen-Kontingent für die Quote-Verarbeitung</p>   |
| execConfType         | num[3]             | <p><b>Erläuterung:</b><br/>Art der Auszeichnung</p> <p><b>Feldinhalt:</b><br/>BC_FV_EXEC_CONF_DISP = dispositive Auszeichnung<br/>BC_FV_EXEC_CONF_FINAL = endgültige Auszeichnung</p>   |
| execTranDat          | dateboss<br>num[8] | <p><b>Erläuterung:</b><br/>Datum der Durchführung einer Aktion auf dem Back End.</p>  |
| execTranTim          | timeboss<br>num[8] | <p><b>Erläuterung:</b><br/>Zeitpunkt der Durchführung einer Aktion auf dem Back End.</p>  |
| executionCod         | char[20]           | <p><b>Erläuterung:</b><br/>Execution Within Firm (MiFID II)</p>   |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 260                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname       | Definition | Bemerkung  |
|----------------|------------|--|
| executionInd   | char[1]    | <u>Erläuterung:</u><br>Indikator für den Inhalt des Feldes "executionCod"<br><u>Feldinhalt:</u><br>1 = Shortcode<br>2 = Algo<br>3 = NORE<br>4 = User-Shortcode (User-Identifikation in Xontro)   |
| fee            | Snum[10,2] | <u>Erläuterung:</u><br>Courtage (mit Vorzeichen!)  |
| feeAsk         | Snum[10,2] | <u>Erläuterung:</u><br>Courtage der Verkaufseite (mit Vorzeichen!)   |
| feeBid         | Snum[10,2] | <u>Erläuterung:</u><br>Courtage der Kaufseite (mit Vorzeichen!)  |
| feeFlag        | char[2]    | <u>Erläuterung:</u><br>Courtagekennzeichen<br><u>Feldinhalt:</u><br>FC = Franco Courtage<br>AC = Abweichende Courtage<br>HC = Halbe Courtage<br>FR = Franco alles<br>PC = Prozentcourtage  |
| feeFlagAsk     | char[2]    | <u>Erläuterung:</u><br>Courtagekennzeichen Verkaufseite<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [feeFlag]  |
| feeFlagBid     | char[2]    | <u>Erläuterung:</u><br>Courtagekennzeichen Kaufseite<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [feeFlag]   |
| fwdOrdrCod     | char[1]    | <u>Erläuterung:</u><br>Bei Einstellung einer Order über das FE wird das Feld ignoriert und die Order immer automatisch an den Skontroführer weitergeleitet. Beim Request XONTRO Enter Order SKM ist nur die Ausprägung 'blank' erlaubt.  |
| fwdOrdrNo      | num[13]    | <u>Erläuterung:</u><br>Referenznummer der Ursprungsorder. Im Rahmen der automatischen und manuellen Orderweiterleitung wird auf Basis der Ursprungsorder ein eigenständiger Orderdatensatz durch das System generiert. Dieser Datensatz für die weitergeleitete Order enthält als Referenz in diesem Feld die DWZ-Ordernummer [ordrNo] der Ursprungsorder. |
| fwdPricingDays | num[3]     | <u>Erläuterung:</u><br>Anzahl der Tage Forward Pricing entsprechend WM Feld XD151  |
| fwdPricingInd  | char[1]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen Forward Pricing entsprechend WM Feld XD149.<br><u>Feldinhalt:</u><br>J = Forward Pricing, wenn Feld instSubSecCod mit entsprechendem WM-Schlüssel gefüllt<br>N = kein Forward Pricing   |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 261                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname             | Definition | Bemerkung  |
|----------------------|------------|--|
| humNo                | num[4]     | <u>Erläuterung:</u><br>Nummer des Kettenglieds in einer HUM-Verkettung<br><u>Feldinhalt:</u><br>Beginnend auf der Kaufseite sind die Kettenglieder der Hum-Kette aufsteigend nummeriert. Somit erhält das Kettenglied mit dem Bankkontrahenten auf der Kaufseite den Wert 1. Das Kettenglied mit dem Bankkontrahenten auf der Verkaufseite erhält den Wert n (n = Anzahl der Kettenglieder).   |
| inSeqNo              | num[9]     | <u>Erläuterung:</u><br>Input-Sequence-Number. Dient der eindeutigen Kennzeichnung eines Requests.<br><u>Prüfung:</u><br>Die Input-Sequence-Number wird vom BE auf ihre Eindeutigkeit hin überprüft. Die Nummer muss pro KV-Nummer und Stream für einen technischen Verarbeitungsabschnitt (Zeitpunkt des Abschlusses der Tagesendeverarbeitung bis zum gleichen Zeitpunkt des nächsten Tags) eindeutig sein<br>Es wird nicht überprüft, ob die [inSeqNo] in lückenloser Folge eingegeben wurden.   |
| inSeqNoCurrent       | num[9]     | <u>Erläuterung:</u><br>Input-Sequence-Number des letzten verarbeiteten Quote Requests einer ISIN   |
| inSeqNoRef           | num[9]     | <u>Erläuterung:</u><br>A. Referenzierung der Input-Sequence-Number des zugehörigen ersten Requests einer Nachrichtenkette. Dient dem Zusammensetzen der Geschäftsnachrichten von MAX-ONE. Referenzierung der FE Requests bei Aufgaben<br><u>Prüfung:</u><br>Bei Folge-Requests muss ein erster Request mit der angegebenen inSeqNo vorhanden sein. Der Wert 0 ist nicht zulässig.<br>Bei einem ersten Request ist nur der Wert 0 zulässig.<br>B. Referenzierung des FE Requests bei Aufgabenbroadcasts.<br><u>Prüfung:</u><br>Der Wert 0 ist nicht zulässig. |
| instAlphaCod         | char[6]    | <u>Erläuterung:</u><br>Alpha-Wertpapierkennnummer  |
| instCcplnd           | char[1]    | <u>Erläuterung:</u><br>ECCP Indikator<br>Der Indikator zeigt an, ob ein Wertpapier/Instrument gegen den ECCP gehandelt werden kann.<br><u>Feldinhalt:</u><br>J = ECCP fähig<br>N = nicht ECCP fähig  |
| instGrpCodXontro     | num[3]     | <u>Erläuterung:</u><br>Wertpapiergruppe (gemäß Wertpapiermitteilungen) eines Wertpapiers/Instruments<br><u>Feldinhalt:</u><br>(WSS Tabelle TAB-G06, WM Feld GD190)   |
| instGrpCodXontroBums | num[3]     | <u>Erläuterung:</u><br>Wertpapiergruppe (gemäß Börsenumsatzstatistik) eines Wertpapiers/Instruments<br><u>Feldinhalt:</u><br>(WSS Tabelle WSS-T94)   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind gelb hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 262                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

| Feldname              | Definition              | Bemerkung   |
|-----------------------|-------------------------|---|
| instHistCod           | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen historische Notierung<br><u>Feldinhalt:</u><br>1 = Nein<br>2 = Ja  |
| instLastRedemptDat    | dateboss                | <u>Erläuterung:</u><br>Datum des letzten Tilgungstermines (WM-Feld GD910)   |
| instMnem              | char[5]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Börsenkürzel eines Wertpapiers/Instruments   |
| instRondLotInc        | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Inkrement Gattungsbezogen<br><u>Feldinhalt:</u><br>1 = Vielfache von [instRondLotMinQty]<br>2 = Mindestbetrag und danach in Vielfachen von [instRondLotQty]  |
| instRondLotQty        | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Kleinste übertragbare Einheit gattungsbezogen;<br>bei [instRondLotInc] = 1 sind Vielfache vom Mindestbetrag [instRondLotMinQty] handelbar;<br>bei [instRondLotInc] = 2 gibt dieses Feld an, in welchen Schritten über dem Mindestbetrag [instRondLotMinQty] gehandelt werden kann. |
| instRondLotMinQty     | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Mindestbetrag gattungsbezogen;<br>Geschäftsnominalen dürfen nicht kleiner als der Mindestbetrag sein;<br>Beträge darüber hinaus folgen den Regeln von [instRondLotInc] und [instRondLotQty]  |
| instSecCod            | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Name des Marktsegmentes eines Wertpapiers/Instruments<br><u>Feldinhalt:</u><br>(WSS Tabelle TAB-F38)   |
| instShtNam            | char[25]                | <u>Erläuterung:</u><br>Name eines Wertpapiers/Instruments   |
| instStpTradDat        | num[8]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Letzter Handelstag   |
| instStrtTradDat       | num[8]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Tag der Erstnotierung  |
| instSubSecCod         | char[3]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Submarktsegment<br><u>Feldinhalt:</u><br>(WSS Tabelle TAB-X03, WM Feld XD080)  |
| instTypCodXontro      | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Wertpapierart (gemäß Wertpapiermitteilungen) eines Wertpapiers/Instruments<br><u>Feldinhalt:</u><br>(WSS Tabelle TAB-G51, WM Feld GD195)   |
| instXontroOrdDat      | num[8]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Datum der Zulassung eines Wertpapiers/Instruments für den Handel in Xontro Order   |
| instXontroStrtTradDat | num[8]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Datum der Notierungsaufnahme eines Wertpapiers/Instruments in Xontro Order   |
| investmentCod         | char[20]                | <u>Erläuterung:</u><br>Investment Decision Within Firm (MiFID II)   |
| investmentInd         | char[1]                 | <u>Erläuterung:</u>   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 263                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname          | Definition         | Bemerkung   |
|-------------------|--------------------|---|
|                   |                    | Indikator für den Inhalt des Feldes „investmentCod“<br><b>Feldinhalt:</b><br>'blank' = keine Angabe<br>1 = Shortcode<br>2 = Algo<br>4 = User-Shortcode (User-Identifikation in Xontro)  |
| isinCod           | char[12]           | <b>Erläuterung:</b><br>ISIN (Internationale Wertpapierkennnummer) der Gattung<br><b>Prüfung:</b><br>Die Gattung muss zum Handel in einem Marktsegment des jeweiligen Börsenplatzes zugelassen sein.   |
| isinCodNew        | char[12]           | <b>Erläuterung:</b><br>Neue ISIN (Internationale Wertpapierkennnummer). Bestehende Orders für die Gattung der ISIN "isinCod" sind auf diese ISIN zu übertragen<br><b>Prüfung:</b><br>Die Gattung muss zum Handel in einem Marktsegment des jeweiligen Börsenplatzes zugelassen sein |
| isinCodSrs        | char[12]           | <b>Erläuterung:</b><br>ISIN der Serien-Gattung  |
| iwOrdCod          | char[2]            | <b>Erläuterung:</b><br>Kennzeichen interessewahrendes Geschäft<br><b>Feldinhalt:</b><br>IW = interessewahrendes Geschäft  |
| iwOrdCodAsk       | char[2]            | <b>Erläuterung:</b><br>Kennzeichen interessewahrendes Geschäft Verkaufseite<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [iwOrdCod]  |
| iwOrdCodBid       | char[2]            | <b>Erläuterung:</b><br>Kennzeichen interessewahrendes Geschäft Kaufseite<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [iwOrdCod]   |
| killFlag          | char[1]            | <b>Erläuterung:</b><br>Kennzeichnung einer Orderlöschung durch „Kill“-Funktionalität. Eine so gekennzeichnete Löschung wird bei Auswertungen für RTS 9 (MiFID II) nicht gezählt.<br><b>Feldinhalt:</b><br>'blank' = normale Löschung<br>J = Löschung durch „Kill“-Funktionalität    |
| liquidityProvFlag | char[1]            | <b>Erläuterung:</b><br>Kennzeichnung einer Order mit der Liquidität bereitgestellt wird (MiFID II)<br><b>Feldinhalt:</b><br>'blank' = keine Bereitstellung von Liquidität<br>J = Bereitstellung von Liquidität  |
| lockFlag          | char[1]            | <b>Erläuterung:</b><br>Kennzeichen Eingang während Sperre<br><b>Feldinhalt:</b><br>'blank' = Default<br>J = Status „während Sperre“   |
| lockTim           | timeboss<br>num[8] | <b>Erläuterung:</b><br>Zeitstempel Sperre (Zeitpunkt des Setzens der Orderbuchsperre)   |



|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 265                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname | Definition | Bemerkung  |
|----------|------------|--|
|          |            | HA Hinweis Abschlag Limitabschlag<br>EABC ex verschiedene Rechte Orderlöschung<br>EXSP Teilung (Split) Orderlöschung<br>WKNA Wertpapierkennnummeränderung WKN-Änderung<br>ENOT Einstellen der Notierung Orderlöschung<br><br><u>Nebenrechte aus Stammdatenveränderungen (Broadcast)</u><br>LHBR Ende des Bezugsrechtshandels limitierter Orders Orderlöschung<br>SBSL Änderung Kennzeichen SB-/SL-Order Orderlöschung<br>MSEG Für XONTRO ungültiges Marktsegment Orderlöschung<br>MBKS Änderung Kennzeichen Einheitsnotierung, kleinste handelbare Einheit, Mindestbetrag, Inkrement Mindestbetrag Einheitskurs oder Inkrement auf Gattungsebene Orderlöschung bzw. Orderänderung<br>MBVA Änderung Kennzeichen variabler Handel, kleinste handelbare Einheit, Mindestbetrag oder Inkrement Mindestbetrag variabler Handel Orderlöschung bzw. Orderänderung<br>KSVA Wechsel von Einheitsnotierung in variablen Handel ohne Einheitsnotierung Orderlöschung bzw. Orderänderung<br>KSKH Wechsel von Einheitsnotierung in kein Handel Orderlöschung<br>VAKS Wechsel von variablen Handel ohne Einheitsnotierung in Einheitsnotierung Orderlöschung bzw. Orderänderung<br>VAKH Wechsel von variablen Handel ohne Einheitsnotierung in kein Handel Orderlöschung<br>VKKS Wechsel von variablen Handel mit Einheitsnotierung in Einheitsnotierung Orderlöschung bzw. Orderänderung<br>VKVA Wechsel von variablen Handel mit Einheitsnotierung in variablen Handel ohne Einheitsnotierung Orderlöschung bzw. Orderänderung<br>VKKH Wechsel von variablen Handel mit Einheitsnotierung in kein Handel Orderlöschung<br><br><u>Nebenrechte aus Maklereingaben (Request)</u><br>EXBR ex Bezugsrecht Orderlöschung<br>EXBA ex Berichtigungsaktien Orderlöschung<br>EXAG ex Ausschüttung –Genussscheine- Orderlöschung<br>EXAR ex Ausschüttung bei Rentenwerten keine Aktion<br>EXDI ex Dividende –Inlandsaktien– Orderlöschung<br>EXDA ex Dividende –Auslandsaktien– Orderlöschung<br>EXZS ex Zinsen –Anleihen– Orderlöschung<br>EXAZ ex Ausgleichszahlung –Aktien– Orderlöschung<br>EXBO ex Bonusrecht –Aktien– Orderlöschung<br>H Hinweis keine Aktion<br>HL Hinweis Löschung Orderlöschung<br>HA Hinweis Abschlag Limitabschlag |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 266                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname          | Definition         | Bemerkung  |
|-------------------|--------------------|--|
|                   |                    | EABC ex verschiedene Rechte<br>EXSP Teilung (Split)<br>WKNA Wertpapierkennnummeränderung<br>Orderlöschung<br>Orderlöschung<br>WKN-Änderung   |
| nrDat             | dateboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Stichtag des Nebenrechts  |
| occurrence        | num[3]             | <u>Erläuterung:</u><br>Nummer der Wiederholgruppe<br><u>Feldinhalt:</u><br>0 (keine Wiederholgruppe), 1,2,...  |
| onBehalfCtpyNoAsk | num[4]             | <u>Erläuterung:</u><br>Kontrahent des Wegen-Geschäftes auf der Verkaufseite<br><u>Feldinhalt:</u><br>KV-Nummer der Wegen-Bank. Xontro Trade erzeugt ein Bankdirektgeschäft zwischen der orderaufgebenden Bank [ctpyNoAsk] und der Wegen-Bank [onBehalfCtpyNoAsk]   |
| onBehalfCtpyNoBid | num[4]             | <u>Erläuterung:</u><br>Kontrahent des Wegen-Geschäftes auf der Kaufseite<br><u>Feldinhalt:</u><br>KV-Nummer der Wegen-Bank. Xontro Trade erzeugt ein Bankdirektgeschäft zwischen der orderaufgebenden Bank [ctpyNoBid] und der Wegen-Bank [onBehalfCtpyNoBid]  |
| optOutFlag        | char[1]            | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen für die Prüfung auf den maximal zulässigen Kurswert des jeweiligen Börsenplatzes<br><u>Feldinhalt:</u><br>'blank' = Kurswertprüfung (default)<br>N = keine Kurswertprüfung  |
| ordrBegDatCod     | char[1]            | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen Beginn der Ordergültigkeit<br><br>Folgetagorders wegen Annahmeschluss sind frühestens am nächsten Börsentag gültig, können aber auch erst zu einem noch späteren Börsentag gültig werden.<br>Alle anderen Folgetagorders sind immer ab dem nächsten Börsentag gültig.<br>EG-Orders sind ab Aktivierung durch den QLP gültig.<br>Zeichnungsaufträge (Orders während Zeichnungsfrist) sind sofort gültig.<br><u>Feldinhalt:</u><br>'blank' = Order ist sofort gültig<br>K = Folgetagorder (automatisch erzeugt)<br>B = Folgetagorder (manuell durch KI eingegeben)<br>E = EG-Order (Ereignis-Gesteuerte-Order)<br>Z = Order während Zeichnungsfrist<br><br>Die folgenden Feldinhalte sind ausschließlich bei Gattungen mit Marktsegment „Fondssegment Hannover“ (DE6) relevant:<br>H = Keine Folgetagorder, aber maschinelle Anpassung der Gültigkeit-Bis<br>X = Folgetagorder (manuell durch KI eingegeben) und maschinelle Anpassung der Gültigkeit-Bis<br>Y = Folgetagorder (automatisch erzeugt) und maschinelle Anpassung der Gültigkeit-Bis<br>O = Folgetagorder wegen Annahmeschluss |
| ordrBkExeQty      | Snum[16,3]         | <u>Erläuterung:</u>  |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 267                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname      | Definition              | Bemerkung   |
|---------------|-------------------------|---|
|               |                         | Umsatz der Kursfeststellung: Es wird der berechnete oder die durch den Makler noch vorgenommene Korrektur des berechneten Werts übermittelt.  |
| ordrEntNo     | num[4]                  | <u>Erläuterung:</u><br>KV-Nummer des Ordereingebers<br><u>Prüfung:</u><br>Der Ordereingebener muss Börsenteilnehmer (Bank oder Makler) am jeweiligen Börsenplatz sein.  |
| ordrExePrc    | limitboss<br>num[10,4]  | <u>Erläuterung:</u><br>Limit der Order<br><b>Feldinhalt:</b><br>Bei der Übergabe des initialisierten Feldes, werden Kauforders mit Limit <i>billigst</i> und Verkauforders mit Limit <i>bestens</i> eingestellt.<br><u>Prüfung:</u><br>Billigst/bestens ist bei SB/SL-Orders nicht möglich.<br>Hinsichtlich der Limitsprünge siehe XONTRO-Handbuch, Anhang C, Tick-Sizes  |
| ordrExePrcAsk | limitboss<br>num[10,4]  | <u>Erläuterung:</u><br>Preis eines Quote (Taxe/Spanne); Verkaufseite  |
| ordrExePrcBid | limitboss<br>num[10,4]  | <u>Erläuterung:</u><br>Preis eines Quote (Taxe/Spanne); Kaufseite   |
| ordrExePrcMod | Snum[11,4]              | <u>Erläuterung:</u><br>Limitabschlag, Limitaufschlag, Kursabschlag oder Kursaufschlag   |
| ordrExpDat    | dateboss<br>num[8]      | <u>Erläuterung:</u><br>Datum der Gültigkeit (bis) einer Order. Bis zu diesem Datum kann die Order maximal gehandelt werden.<br><b>Feldinhalt:</b><br>Das Datum muss größer oder gleich dem aktuellen Börsentag sein. Das System akzeptiert auch Orders, die über den 31.12. hinaus gültig sind. Sollten solche Orders an diesem Stichtage noch ausführbar sein, so erfolgt entsprechend den Geschäftsbedingungen der jeweiligen Börsen die automatische Löschung. |
| ordrNo        | num[13]                 | <u>Erläuterung:</u><br>DWZ-Ordernummer. Die DWZ-Ordernummer wird automatisch durch XONTRO bei der Ordereinstellung vergeben. Die DWZ-Ordernummer ist eindeutig und kann als Identifizierungskennzeichen verwendet werden.   |
| ordrQty       | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>A. Bei orderrelevanten Requests, Broadcasts und Beständen<br>Nominale, Stückzahl der Order<br>B. Bei aufgabenrelevanten Broadcasts und Beständen<br>Ursprüngliche Nominale der Aufgabe   |
| ordrQtyAsk    | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Nominale oder Stückzahl eines Quote (Taxe/Spanne); Verkaufseite  |
| ordrQtyBid    | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Nominale oder Stückzahl eines Quote (Taxe/Spanne); Kaufseite   |
| ordrResCod    | char[3]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Limitzusatz der Order<br><b>Feldinhalt:</b><br>SL = stop loss<br>SB = stop buy<br>EG = EG-Order (Ereignis-Gesteuerte-Order)<br><u>Prüfung:</u><br>Die Eingabe ist nur möglich bei entsprechend zugelassenen Gattungen.   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 268                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname      | Definition             | Bemerkung  |
|---------------|------------------------|--|
|               |                        | Weiterhin wird bei der Eingabe die Angabe der Geschäftsart (V bei SL und K bei SB) und die Vergabe eines Limits [ordrExePrc] überprüft.  |
| ordrResCodInd | char[1]                | <p><u>Erläuterung:</u><br/>Limitzusatzindikator<br/>Indikator für die Eingebbarkeit von SL/SB-Orders eines Wertpapiers/Instruments in Xontro Order</p> <p><u>Feldinhalt:</u><br/>J = SL/SB Order sind zugelassen<br/>N = SL/SB Order sind nicht zugelassen</p>   |
| ordrStatCod   | char[1]                | <p><u>Erläuterung:</u><br/>Kennzeichen für die Statusänderung einer EG-Order (Ereignis-Gesteuerte-Order).</p> <p><u>Feldinhalt bei Request:</u><br/>XONTRO Delete Order SKM<br/>[0-9; A-T] = EG-Order abgelehnt; Regelprüfung nicht erfolgreich</p> <p>XONTRO Modify Order SKM<br/>X = Zurücksetzen einer aktivierten EG-Order<br/>Y = EG-Order akzeptiert; Regelprüfung erfolgreich<br/>Z = Aktivierung der EG-Order</p> <p><u>Feldinhalt bei Broadcast:</u><br/>BCBE_DELETE_ORDER<br/>BCBE_DELETE_ORDER_SKM<br/>[0-9; A-T] = EG-Order abgelehnt; Regelprüfung nicht erfolgreich</p> <p>BCBE_MODIFY_ORDER<br/>BCBE_MODIFY_ORDER_SKM<br/>Y = EG-Order akzeptiert; Regelprüfung erfolgreich<br/>Z = Aktivierung der EG-Order</p> <p><u>Feldausprägungen:</u><br/>0 = Nicht definierter EG-Order Regelfehler<br/>1 = Instruktion der EG-Order kann nicht interpretiert werden<br/>2 = Ungültiger Trailing Abstand<br/>3 = EG-Ordertyp ungültig<br/>4 = Ungültiges Stop-Limit<br/>5 = Wert nach dem Komma entspricht nicht der Regel<br/>6 = Anzahl der Stellen nach dem Komma ist zu hoch<br/>7 = Anzahl der Stellen vor dem Komma ist zu hoch<br/>8 = Limit ungültig<br/>9 = Feld muss numerisch sein<br/>A = Feld muss gültigen Schlüsselwert enthalten<br/>Y = EG-Order akzeptiert; Regelprüfung erfolgreich<br/>Z = Aktivierung der EG-Order</p> |
| ordrStopLim   | limitboss<br>num[10,4] | <p><u>Wichtiger Hinweis:</u><br/>Dieses Feld wird derzeit noch nicht von XONTRO unterstützt. Eine Prüfung der Feldinhalte erfolgt derzeit noch nicht.</p> <p><u>Erläuterung:</u><br/>Stop-Limit der Order</p> <p><u>Prüfung:</u><br/>Die Eingabe ist nur zulässig bei entsprechend definierten Gattungen. Die Eingabe ist nur in Verbindung mit der Eingabe eines Limitzusatzes [ordrResCod] zulässig.</p> <p>Weiterhin wird bei der Eingabe die Angabe der Geschäftsart (V bei SL und K bei SB) und die Vergabe eines Limits [ordrExePrc] überprüft.</p>  |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 269                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname          | Definition              | Bemerkung  |
|-------------------|-------------------------|--|
| ordrVolAsk        | num[10]                 | <u>Wichtiger Hinweis:</u><br>Dieses Feld wird derzeit noch nicht von XONTRO unterstützt<br><u>Erläuterung:</u><br>Volumen (Kurswert) eines Quote (Taxe/Spanne); Verkaufseite.<br>Die Angabe des Volumens erfolgt in Euro.  |
| ordrVolBid        | num[10]                 | <u>Wichtiger Hinweis:</u><br>Dieses Feld wird derzeit noch nicht von XONTRO unterstützt<br><u>Erläuterung:</u><br>Volumen (Kurswert) eines Quote (Taxe/Spanne); Kaufseite<br>Die Angabe des Volumens erfolgt in Euro.  |
| origOrdrQty       | volumeboss<br>num[13,3] | <u>Erläuterung:</u><br>Ursprüngliche Nominale, Stückzahl der Order   |
| otcPostTradInd    | char[3]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen „OTC-post-trade Indicator“ (MiFID II)<br><u>Feldinhalt:</u><br>'blank' = keine Angabe<br>001 = ACTX (Kompensation)<br>002 = CANC (Storno)<br>101 = ACTX CANC (Kompensation und Storno)  |
| otcPostTradIndAsk | char[3]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen „OTC post-trade Indicator“ (MiFID II) auf der Verkaufseite  |
| otcPostTradIndBid | char[3]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen „OTC post-trade Indicator“ (MiFID II) auf der Kaufseite   |
| outSeqNo          | num[9]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Die Output-Sequence-Number wird eindeutig und lückenlos aufsteigend vergeben. Die Nummer ist vom Zeitpunkt des Abschluss der Tagesendeverarbeitung bis zum gleichen Zeitpunkt des nächsten Tags pro KV-Nummer und Stream eindeutig.   |
| pendFlag          | char[1]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen Orderänderung/Löschung vorläufig<br><u>Feldinhalt:</u><br>'blank' = Status endgültig (Default)<br>J = Status vorläufig  |
| possLockFlag      | char[1]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen, ob das Orderbuch gesperrt werden soll, wenn die im Request gelieferten Prüffelder nicht mit der Orderlage am Back End übereinstimmen<br><u>Feldinhalt:</u><br>'blank' = Orderbuch wird nicht gesperrt (Default)<br>J = Orderbuch wird gesperrt   |
| postProcFlag      | char[1]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen automatische Nachbearbeitung bei Kurseingabe Front End<br><u>Feldinhalt bei Request:</u><br>A = automatische Nachbearbeitung durch das Xontro Back End<br>E = explizite Nachbearbeitung durch den Makler am Front End; der Request Xontro Finish Pricing ist zum Abschluss der Nachbearbeitung zwingend erforderlich<br><u>Feldinhalt bei Broadcast:</u><br>A = die Nachbearbeitung wird für diesen Kurs automatisch durch das Xontro Back End abgeschlossen<br>E = für diesen Kurs ist eine explizite Nachbearbeitung erforderlich |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 270                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname        | Definition              | Bemerkung  |
|-----------------|-------------------------|--|
| processingCod   | char[1]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen, ob beim Request XONTRO Reactivate Pricing Block zusätzlich zur Rücknahme der Kursaussetzung auch ein umsatzloser Kurs oder sowohl ein umsatzloser Kurs als auch eine erneute Kursaussetzung mitgeschickt wurde.<br><u>Feldinhalt:</u><br>'blank' = Rücknahme der Kursaussetzung (Default)<br>1 = Rücknahme, umsatzloser Kurs sowie erneute Kursaussetzung<br>2 = Rücknahme der Kursaussetzung und umsatzloser Kurs |
| pwExpirationDat | dateboss<br>num[8]      | <u>Erläuterung:</u><br>Letzter Gültigkeitstag des Passworts der [userNo]   |
| qsamId          | num[4]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Server Identifikation (z.B. 0200 und 0201)<br>Die Nummer wird von BrainTrade für jeden QSAM-Teilnehmer vergeben.  |
| qsamMsgType     | char[1]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Typ einer Nachricht<br><u>Feldinhalt:</u><br>Q = Request<br>R = Response<br>B = Broadcast<br>I = Bestandstransfer (Initialbestand)<br>T = Retransmission  |
| qsamRequestId   | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Request Identifikation<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Header-File („bclayouts_qsam.h“)  |
| qsamExchangeld  | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Börsenplatz der Nachricht<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [exchangeld]  |
| qsamUserId      | num[10]<br>[nnnnxxxxxx] | <u>Erläuterung:</u><br>Identifizierungskennzeichen (Login-User)<br><u>Feldinhalt:</u><br>nnnn = KV-Nummer des Eingebers<br>xxxxxx = Individuelle Mitarbeiterkennung des Eingebers  |
| qsamComplCode   | num[5]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Completion Code (Fehlercode)<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Header-File („XONTROmsg_qsam.dat“)  |
| qsamDat         | dateboss<br>num[8]      | <u>Erläuterung:</u><br>Aktueller Börsentag   |
| qsamBkrNo       | num[4]                  | <u>Erläuterung:</u><br>KV-Nummer des Systemteilnehmers/Maklers, der Empfänger des Nachrichtendatensatzes ist.  |
| qsamStreamId    | num[2]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Stream Identifikation<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Header-File („bclayouts_qsam.h“)   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 271                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname         | Definition                | Bemerkung  |
|------------------|---------------------------|--|
| quoteReturnCod   | char[1]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Returncode für eine ISIN die über den Request XONTRO Enter Mass Quote übermittelt wurde.<br><u>Feldinhalt:</u><br>Y = Quote wurde erfolgreich verarbeitet<br>F = ConfirmTim nicht korrekt<br>V = Kontingentüberschreitung<br>L = Keine Berechtigung oder noch kein Login erfolgt<br>S = Sequenz-Nummer nicht aufsteigend<br>X = Syntax-Fehler |
| quoteSeqNo       | num[9]                    | <u>Erläuterung:</u><br>Numerisch aufsteigende Sequenz-Nummer (pro ISIN) für den Request XONTRO Enter Mass Quote  |
| quoteStatus      | char[1]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Status eines Quote (Taxe/Spanne).<br>In diesem Feld wird übermittelt, ob der Quote durch den Teilnehmer über die System- bzw. Dialogschnittstelle gelöscht werden kann.<br><u>Feldinhalt:</u><br>L = löschar<br>N = nicht löschar   |
| quoteTimeStamp   | num[12]<br>[HHMMSSCCnnnn] | <u>Erläuterung:</u><br>Zeitstempel der Einstellung bzw. Löschung einer Quote   |
| quoteType        | char[1]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Typ eines Quote (Taxe/Spanne).<br>In diesem Feld wird übermittelt, ob es sich bei einem Quote um eine Taxe oder eine Spanne handelt.<br><u>Feldinhalt:</u><br>T = Taxe<br>S = Spanne  |
| redQty           | volumeboss<br>num[13,3]   | <u>Erläuterung:</u><br>Reduktionsvolumen (Stückzahl/Nominale) einer Aufgabenpositionen bei der Schließung  |
| refTim           | timeboss<br>num[8]        | <u>Erläuterung:</u><br>Referenzzeit  |
| regulatoryID     | num [10]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Wird nicht mehr verwendet<br>Dieses Feld enthält bei Broadcasts immer den Initalwert.   |
| repExchangeld    | num[3]                    | <u>Erläuterung:</u><br>Börsenplatz Meldewesen<br><u>Feldinhalt:</u><br>Zurzeit nur:<br>124 (Quotrix)<br>Ist der Defaultwert eingetragen (000), wird die [exchangeld] als Börsenplatz Meldewesen verwendet  |
| repExchangeldAsk | num[3]                    | <u>Erläuterung:</u><br>Börsenplatz Meldewesen Verkauf<br><u>Feldinhalt:</u><br>Zurzeit nur: 124 (Quotrix)<br>Ist der Defaultwert eingetragen (000), wird die [exchangeld] als Börsenplatz Meldewesen verwendet   |



|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 273                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname | Definition | Bemerkung |
|----------|------------|-----------|
|----------|------------|-----------|

|  |  |   |  |
|--|--|---|--|
|  |  | BCBE_DELETE_ORDER<br>BCBE_DELETE_ORDER_N<br>BCBE_ENTER_ORDER  | Orderlöschung (BE)<br>Orderlöschung wegen Nebenrecht<br>Ordereinstellung Skontroführer (BE)  |
|  |  | BCBE_ENTER_ORDER_FM<br>BCBE_ENTER_PRICE<br>BCBE_ENTER_PRICE_MAN<br>BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_MAN<br>BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_TAB   | Ordereinstellung Freimakler (BE)<br>Kursfeststellung (BE)<br>Kurseingabe manuell<br>Kursänderung manuell<br>Kursfeststellung   |
|  |  | BCBE_ENTER_PRICE_TAB<br>BCBE_ENTER_QUOTE<br>BCBE_ADD_POSITION   | Kursfeststellung<br>Eingabe eines Quote (BE)<br>Eingabe eines halben Geschäftes (BE)   |
|  |  | BCBE_MODIFY_EXECUTION<br>BCBE_FINISH_PRICING<br>BCBE_LOCK_ORDERS<br>BCBE_MODIFY_ORDER<br>BCBE_MODIFY_ORDER_N<br>BCBE_MODIFY_SBSL<br>BCBE_PEND_DELETE_ORDER<br>BCBE_PEND_ENTER_ORDER | Teilausführung einer Order (BE)<br>Ende Nachbearbeitung (Back End)<br>Sperrern (BE)<br>Orderänderung (BE)<br>Orderänderung wegen Nebenrecht<br>Umsetzung einer Stop-Order<br>vorläufige Orderlöschung (BE)<br>Ordereinstellung während Sperre (BE) |
|  |  | BCBE_PEND_MODIFY_ORDER<br>BCBE_REJ_ENTER_ORDER  | vorläufige Orderänderung (BE)<br>Ablehnung Ordereinstellung während Sperre (BE)  |
|  |  | BCBE_UNLOCK_ORDERS<br>BCFE_DEACTIVATE_QUOTE<br>BCFE_DELETE_ORDER  | Entsperrern (BE)<br>Deaktivierung/Löschung eines Quote (FE)<br>erfolgreiche Orderlöschung nach Sperre  |
|  |  | BCFE_DELETE_ORDER_DIR<br>BCFE_DELETE_ORDER_SKM<br>BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE<br>BCFE_ENTER_ORDER  | direkte Orderlöschung(FE)<br>Orderlöschung Skontroführer (FE)<br>umsatzlose Kurseingabe (FE)<br>erfolgreiche Ordereinstellung nach Sperre  |
|  |  | BCFE_ENTER_ORDER_DIR<br>BCFE_ENTER_ORDER_SKM  | direkte Ordereinstellung (FE)<br>Ordereinstellung Skontroführer (FE)   |
|  |  | BCFE_ENTER_PRICE<br>BCFE_ENTER_QUOTE<br>BCFE_ADD_POSITION   | Kursfeststellung (FE)<br>Eingabe eines Quote (FE)<br>Eingabe eines halben Geschäftes (FE)  |
|  |  | BCFE_MODIFY_EXECUTION<br>BCFE_FINISH_PRICING<br>BCFE_LOCK_ORDERS<br>BCFE_MODIFY_ORDER   | Teilausführung einer Order (FE)<br>Ende Nachbearbeitung (FE)<br>Sperrern (FE)<br>erfolgreiche Orderänderung nach Sperre  |
|  |  | BCFE_MODIFY_ORDER_DIR<br>BCFE_MODIFY_ORDER_SKM<br>BCFE_REJ_DELETE_ORDER<br>BCFE_REJ_ENTER_ORDER<br>BCFE_REJ_MODIFY_ORDER  | direkte Orderänderung (FE)<br>Orderänderung Skontroführer (FE)<br>abgelehnte Orderlöschung (FE)<br>abgelehnte Ordereinstellung (FE)<br>abgelehnte Orderänderung (FE)   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 274                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname | Definition | Bemerkung |
|----------|------------|-----------|
|----------|------------|-----------|

|  |  |   |
|--|--|---|
|  |  | BCFE_UNLOCK_ORDERS      Entsperrn (FE)  |
|  |  | <u>D) XONTRO Subscribe Quote Updates (MISS2MISS)</u>  |
|  |  | BCFE_ENTER_QUOTE      Eingabe eines Quote (FE)  |
|  |  | BCFE_DEACTIVATE_QUOTE      Deaktivierung/Löschung eines Quote (FE)                                    |
|  |  | <u>E) XONTRO Subscribe Execution Confirmation Updates</u>   |
|  |  | BCBE_EXECUTION_SKM      Orderauszeichnung durch den Skontrofürher, Nachricht für den Skontrofürher    |
|  |  | BCBE_END_EXECUTION      Abschluss Ausführungen, Nachricht für den Skontrofürher                       |
|  |  | BCBE_EXECUTION_SKM_TO_FM      Orderauszeichnung durch den Skontrofürher, Nachricht für den Freimakler |
|  |  | <u>F) XONTRO Inquire Broker Trades</u>  |
|  |  | BCBE_BTRADE      Übertragung einer Aufgabe  |
|  |  | BCBE_BTRADE_2      Übertragung einer Aufgabe  |
|  |  | BCBE_BTRADES_END      Ende Übertragung Aufgaben   |
|  |  | <u>G) XONTRO Subscribe Broker Trade Updates</u>   |
|  |  | BCBE_ENTER_TEMP_BTRADE      Erzeugung einer neuen temporären Aufgabe (Seitenüberhang)                 |
|  |  | BCBE_MODIFY_TEMP_BTRADE      Änderung einer temporären Aufgabe  |
|  |  | BCBE_DELETE_TEMP_BTRADE      Löschung einer temporären Aufgabe  |
|  |  | BCBE_ENTER_BTRADE      Erzeugung einer Aufgabe (BE)   |
|  |  | BCBE_ENTER_BTRADE_2      Erzeugung einer Aufgabe (BE)   |
|  |  | BCFE_ENTER_BTRADE      Erzeugung einer Aufgabe (FE)   |
|  |  | BCFE_ENTER_BTRADE_2      Erzeugung einer Aufgabe (FE)   |
|  |  | BCBE_DELETE_BTRADE      Löschung einer Aufgabe (BE)   |
|  |  | BCBE_CANCEL_BTRADE      Stornierung einer Aufgabe (BE)  |
|  |  | BCFE_DELETE_BTRADE      Löschung einer Aufgabe (FE)   |
|  |  | BCFE_CANCEL_BTRADE      Stornierung einer Aufgabe (FE)  |
|  |  | BCBE_MATCH_BTRADE      Schließung von Aufgaben (BE)   |
|  |  | BCFE_MATCH_BTRADE      Schließung von Aufgaben (FE)   |
|  |  | BCBE_MODIFY_BTRADE      Änderung einer Aufgabe (BE)   |
|  |  | BCBE_MODIFY_HUM      Änderung einer HUM-Position (BE)   |
|  |  | BCFE_MODIFY_HUM      Änderung einer HUM-Position (FE)   |
|  |  | <u>H) XONTRO Subscribe Trade Updates</u>  |
|  |  | BCBE_TRADE      Erzeugung eines Eigengeschäfts  |
|  |  | BCBE_BROKER_DIARY      Erzeugung eines Geschäftsvorfalles im Maklertagebuch                           |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 275                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname | Definition | Bemerkung |
|----------|------------|-----------|
|----------|------------|-----------|

|  |  |  |
|--|--|--|
|  |  | <u>I) XONTRO Inquire Broker Diary</u><br>BCBE_DIARY Übertragung eines MTB-Eintrags<br>BCBE_DIARY_END Ende Übertragung eines MTB-Eintrags   |
|  |  | <u>J) XONTRO Inquire Special Rights</u><br>BCBE_BT Übertragung einer Bestandsnachricht<br>BCBE_BT_END Ende der Übertragung des Bestandes   |
|  |  | <u>K) XONTRO Subscribe System Status News</u><br>BCBE_BUS_END Ende Buchungsschnitt<br>BCBE_BUS_START Start Buchungsschnitt<br>BCBE_DEACTIVATE_ANY_PRICING Unterbrechung der Kursfeststellung<br>BCBE_DEACTIVATE_PRICING Wiederaufnahme nach Kursaussetzung<br>BCBE_ENDOFDAY_START Start Tagesendeverarbeitung<br>BCBE_ENTER_SP_RIGHT Eingabe eines Nebenrechts<br>BCBE_REACTIVATE_ANY_PRICING Wiederaufnahme nach Unterbrechung der Kursfeststellung<br>BCBE_REACTIVATE_PRICING Wiederaufnahme nach Kursaussetzung<br>BCBE_START_TRADE Wiederaufnahme Börsenversammlung<br>BCBE_STOP_TRADE Unterbrechung Börsenversammlung<br>BCFE_DEACTIVATE_PRICING Kursaussetzung (FE)<br>BCFE_DEACTIVATE_PRICING_BLOCK Kursaussetzung (FE) geblockt<br>BCFE_ENTER_SP_RIGHT Eingabe eines Nebenrechts am Front End<br>BCFE_REACTIVATE_PRICING Wiederaufnahme n. Kursaussetzung (FE)<br>BCFE_REACTIVATE_PRICING_BLOCK Wiederaufnahme n. Kursaussetzung (FE) geblockt |
|  |  | <u>L) XONTRO Subscribe Private Status News</u><br>BCBE_START_QUOTE Starten Quote Machine<br>BCBE_STOP_QUOTE Stoppen Quote Machine<br>BCBE_EXCHANGE_QUOTE_VOLUME_INFO Status-Information über den Quote-Verbrauch vom Börsen-Kontingent<br>BCBE_BYPASS_QUOTE_VOLUME_INFO Status-Information über den Quote-Verbrauch vom Bypass-Kontingent  |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 276                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

| Feldname       | Definition   | Bemerkung   |
|----------------|--------------|---|
|                |              | BCBE_NOTIFY_PW_EXPIRATION_DATE<br>Übermittlung der Restgültigkeit eines Passworts<br>BCBE_LOST_MESSAGE<br>nicht zugestellte Nachricht<br>BCFE_RESET_PRICE<br>Annullierung Preis<br>BCFE_RESET_ORDER_SKM<br>Von einer Annullierung betroffene Order des Skontroführers<br>BCFE_RESET_ORDER_SKM_END<br>Von einer Annullierung betroffene Order des Skontroführers<br>BCFE_RESET_ORDER_FM<br>Von einer Annullierung betroffene Order des Freimaklers<br>BCFE_RESET_ORDER_FM_END<br>Von einer Annullierung betroffene Order des Freimaklers<br><br><u>M) XONTRO Inquire Skontro Data</u><br>BCBE_SKONTRO_DATA<br>Übertragung einer Bestandsnachricht (ISIN und Daten)<br>BCBE_SKONTRO_END<br>Ende der Übertragung des Bestands<br><br><u>N) XONTRO Inquire Skontro ISIN</u><br>BCBE_SKONTRO_ISIN<br>Übertragung einer Bestandsnachricht (nur ISIN)<br>BCBE_SKONTRO_END<br>Ende der Übertragung des Bestands |
| text           | charboss[25] | <u>Erläuterung:</u><br>Freies Texteingabefeld für Kreditinstitute. Dieser Text wird auf den Geschäftsunterlagen des Orderaufgebers, falls der Aufgeber ein Kreditinstitut ist, vermerkt (z.B. Schlussnote, SNO-Datensatz etc.).   |
| textTrad       | charboss[35] | <u>Erläuterung:</u><br>Freitextfeld bei der Aufgaben- bzw. Geschäftseingabe   |
| textTradAsk    | charboss[35] | <u>Erläuterung:</u><br>Freitextfeld bei der Aufgaben- bzw. Geschäftseingabe (Verkaufseite)<br><b>Feldinhalt:</b><br>Bei Geschäften, die in XONTRO Order entstanden sind, wird dieses Feld mit '/BOSS' gefüllt.  |
| textTradBid    | charboss[35] | <u>Erläuterung:</u><br>Freitextfeld bei der Aufgaben- bzw. Geschäftseingabe (Kaufseite)<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [textTradAsk]   |
| ticket         | num[9]       | <u>Erläuterung:</u><br>Schlüssel der Reservierung zur Kursfeststellung. Vom BE vergeben, vom FE bei der dezentralen Kursfeststellung zu benutzen.<br>Stellt ein Request XONTRO Cancel Pricing oder XONTRO Finish Pricing den Wert BC_DO_NOT_CHECK_TICKET ein, dann führt das BE den Request ohne Prüfung durch, wenn eine gültige Reservierung vorliegt.  |
| tickSizeXontro | char[1]      | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichnung der Ticksizes-Regel für Xontro-Börsen<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe WM Feld XD546   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind gelb hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 277                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname            | Definition             | Bemerkung  |
|---------------------|------------------------|--|
| tradCapacityCod     | char[1]                | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen „Trading Capacity“ (MiFID II)<br><u>Feldinhalt:</u><br>A, 'blank' = AOTC (default)<br>D = DEAL<br>M = MTCH  |
| tradContTimFraction | num[4]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Mikrosekunden zur Abschlusszeit einer Aufgabe/eines Geschäfts<br>(Ergänzung zu tradContTim)   |
| tradBegDat          | dateboss<br>num[8]     | <u>Erläuterung:</u><br>Schlusstag einer Aufgabe/eines Geschäfts<br>Bei Aufgaben aus Kursfeststellung wird in diesem Feld das Datum der Kursfeststellung hinterlegt.<br>Bei manuell eingegebenen Aufgaben/Geschäften wird in diesem Feld der Schlusstag hinterlegt.<br>Der Schlusstag ist immer ein Börsentag. Es muss nicht der aktuelle Börsentag sein. Dieses Datum ist Basis für alle Berechnungen (Zinstage etc.).   |
| tradClCod           | char[1]                | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen des Geschäftsvorfalles<br><u>Feldinhalt:</u><br>'blank' = Geschäft<br>D = Storno<br>E = Aufgabenlöschung<br>F = Storno Info, passives Storno<br>H = Storno-Info, passives Storno in TSL Gruppe<br>L = Zwangsaufgabe (Düsseldorfer Modell)<br>M = Zwangsaufgabe (Frankfurter Modell)<br>O = Gegeneingabe fehlt (Düsseldorfer Modell)<br>P = Gegeneingabe fehlt (Frankfurter Modell)<br>Q = ohne Eingabe<br>R = Storno Zwangsaufgabe<br>U = HUM ohne Bank<br>V = Unzulässige Weitergabe<br>X = HUM-Gegeneingabe ohne Bank<br>Y = HUM-Gegeneingabe ohne Bank |
| tradClearingPrc     | priceboss<br>num[10,4] | <u>Erläuterung:</u><br>Abrechnungskurs   |
| tradCod             | char[2]                | <u>Erläuterung:</u><br>Geschäftsart bei Eigengeschäften des Maklers.<br><u>Feldinhalt:</u><br>K = Eigengeschäft Kauf<br>KS = Eigengeschäft Kauf Storno<br>V = Eigengeschäft Verkauf<br>VS = Eigengeschäft Verkauf Storno   |
| tradContDat         | dateboss<br>num[8]     | <u>Erläuterung:</u><br>Abweichendes Abschlussdatum<br><u>Feldinhalt bei Request:</u><br>Das Feld darf nur mit einem Nicht-Börsentag belegt werden.<br><u>Feldinhalt bei Broadcast und Inquire:</u><br>Datum der Aufgaben-/Geschäftsentstehung (Abschlussdatum bzw. abweichendes Abschlussdatum). Der Inhalt kann von tradBegDat (Schlusstag) abweichen. Das Datum ist Basis für das Meldewesen.  |
| tradContTim         | timeboss<br>num[8]     | <u>Erläuterung:</u><br>Abschlusszeit zum Abschlussdatum einer Aufgabe/eines Geschäfts  |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 278                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname         | Definition               | Bemerkung  |
|------------------|--------------------------|--|
| tradDifAmtAsk    | amountboss<br>Snum[16,2] | <u>Erläuterung:</u><br>Kursdifferenz auf der Verkaufseite  |
| tradDifAmtBid    | amountboss<br>Snum[16,2] | <u>Erläuterung:</u><br>Kursdifferenz auf der Kaufseite   |
| tradEnterDat     | dateboss<br>num[8]       | <u>Erläuterung:</u><br>Datum der Geschäftseingabe  |
| tradMtchCod      | char[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Kurszusatz<br><b>Feldinhalt:</b><br>BZ = bezahlt<br>BG = bezahlt Geld<br>BB = bezahlt Brief<br>EG = etwas bezahlt Geld<br>EB = etwas bezahlt Brief<br>RG = rationiert Geld<br>RB = rationiert Brief<br>* = kleine Beträge konnten nicht gehandelt werden<br>G = Geld<br>B = Brief<br>P = bezahlt Primärmarkt<br>BGP = bezahlt Geld Primärmarkt<br>BBP = bezahlt Brief Primärmarkt<br>RGP = rationiert Geld Primärmarkt<br>RBP = rationiert Brief Primärmarkt<br>BP = Brief Primärmarkt<br>Der Kurszusatz * ist bei allen o.g. Kurszusätzen möglich.<br>Die Ausgabe erfolgt im Anschluss an den Kurszusatz.<br>C = Compensation<br>_ = gestrichen<br>_G = gestrichen Geld<br>_B = gestrichen Brief<br>_T = gestrichen Taxe<br>_GT = gestrichen Taxe Geld<br>_BT = gestrichen Taxe Brief<br>U = bezahlt; es sind Eigenhandelsgeschäfte des Maklers<br>enthalten<br>M = bezahlt; es sind Gattstellungen des Maklers enthalten<br>TRG = bezahlt; triggert Stoporders und führt anschließend eine<br>umgesetzteMarketorder zu diesem Kurs aus<br>Der Kurszusatz TRG ist nur beim Request XONTRO Enter Price Plus<br>erlaubt. |
| tradMtchPrc      | priceboss<br>num[10,4]   | <u>Erläuterung:</u><br>Kurs, zu dem die Order oder eine Teilnominale der Order ausgeführt<br>wurde, oder Preis eines Geschäfts/einer Order.  |
| tradMtchPrcNoAsk | num[5]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Nummer der Kursfeststellung auf der Verkaufseite  |
| tradMtchPrcNoBid | num[5]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Nummer der Kursfeststellung auf der Kaufseite   |
| tradMtchPrcAsk   | priceboss<br>num[10,4]   | <u>Erläuterung:</u><br>Preis/Kurs der Verkaufseite eines Geschäftes  |
| tradMtchPrcBid   | priceboss<br>num[10,4]   | <u>Erläuterung:</u><br>Preis/Kurs der Kaufseite eines Geschäftes   |
| tradMtchPrcDat   | dateboss<br>num[8]       | <u>Erläuterung:</u><br>Datum der Kursfeststellung, ein Wert. Der Wert 0 ist zulässig.  |
| tradMtchPrcNo    | num[5]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Nummer der Kursfeststellung (für eine ISIN und einen Börsenplatz).  |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 279                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname               | Definition                | Bemerkung   |
|------------------------|---------------------------|---|
| tradMtchPrcNoAsk       | num[5]                    | <u>Erläuterung:</u><br>Nummer der Kursfeststellung auf der Verkaufseite   |
| tradMtchPrcNoBid       | num[5]                    | <u>Erläuterung:</u><br>Nummer der Kursfeststellung auf der Kaufseite  |
| tradMtchPrcTim         | timeboss<br>num[8]        | <u>Erläuterung:</u><br>Zeitpunkt der Kursfeststellung   |
| tradMtchPrcTimFraction | num[4]                    | <u>Erläuterung:</u><br>Mikrosekunden zum Zeitpunkt der Kursfeststellung<br>(Ergänzung zu tradMtchPrcTim)  |
| tradMtchPrcType        | char[1]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Art der Kursfeststellung (wird zurzeit noch nicht gefüllt)<br><u>Feldinhalt:</u><br>E = eigene Kursfeststellung<br>Z = zugespielte Kursfeststellung  |
| tradMtchQty            | volumeboss<br>num[13,3]   | <u>Erläuterung:</u><br>Die Im Rahmen der Kursfeststellung ausgezeichnete Nominale<br>(Stück oder Nennwert) der Order oder die Nominale einer<br>Aufgabe/eines Geschäfts.  |
| tradNo                 | num[13]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Geschäfts-Nummer<br><u>Feldinhalt:</u><br>Die Geschäfts-Nummer wird automatisch durch XONTRO vergeben.<br>Die Geschäfts-Nummer ist zusammen mit dem Börsenplatz des<br>Geschäftes [tranExchangeld] eindeutig und kann als<br>Identifizierungskennzeichen verwendet werden. |
| tradNoAsk              | num[13]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Ursprüngliche Geschäfts-Nummer auf der Verkaufseite<br><u>Feldinhalt:</u><br>Ursprüngliche Geschäfts-Nummer einer endgültigen Aufgabe. Bei der<br>Schließung der Aufgabe wird eine neue Geschäftsnummer vergeben.  |
| tradNoBid              | num[13]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Ursprüngliche Geschäfts-Nummer auf der Kaufseite<br><u>Feldinhalt:</u><br>Ursprüngliche Geschäfts-Nummer einer endgültigen Aufgabe. Bei der<br>Schließung der Aufgabe wird eine neue Geschäftsnummer vergeben.   |
| tradNoOld              | num[13]                   | <u>Erläuterung:</u><br>Geschäfts-Nummer des stornierten Geschäftes<br><u>Feldinhalt:</u><br>Die Geschäfts-Nummer des bei einer Eingabe in der Transaktion<br>„Storno-Neugeschäft“ (BCEM SN) stornierten Geschäftes. Das<br>Neugeschäft erhält eine neue Geschäfts-Nummer.                         |
| tradTim                | timeboss<br>num[8]        | <u>Erläuterung:</u><br>Eingabezeit eines Geschäftes   |
| tradTimeStamp          | num[12]<br>[HHMMSSCCnnnn] | <u>Erläuterung:</u><br>Zeitstempel der Erzeugung eines Eigengeschäfts.  |
| tranContDatAsk         | dateboss<br>num[8]        | <u>Erläuterung:</u><br>Datum der Geschäftsentstehung auf der Verkaufseite (Abschlussdatum<br>bzw. abweichendes Abschlussdatum). Das Feld kann einen Nicht-<br>Börsentag enthalten. Der Inhalt kann von [tradBegDat] (Schlusstag)<br>abweichen. Das Datum ist Basis für das Meldewesen.            |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 280                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname               | Definition         | Bemerkung   |
|------------------------|--------------------|---|
| tranContDatBid         | dateboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Datum der Geschäftsentstehung auf der Kaufseite (Abschlussdatum bzw. abweichendes Abschlussdatum). Das Feld kann einen Nicht-Börsentag enthalten. Der Inhalt kann von [tradBegDat] (Schlusstag) abweichen. Das Datum ist Basis für das Meldewesen. |
| tranContTimAsk         | timeboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Abschlussuhrzeit auf der Verkaufseite  |
| tranContTimBid         | timeboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Abschlussuhrzeit auf der Kaufseite   |
| tranContTimFractionAsk | num[4]             | <u>Erläuterung:</u><br>Mikrosekunden zur Abschlusszeit auf der Verkaufseite<br>(Ergänzung zu tranContTimAsk)  |
| tranContTimFractionBid | num[4]             | <u>Erläuterung:</u><br>Mikrosekunden zur Abschlusszeit auf der Kaufseite<br>(Ergänzung zu tranContTimBid)   |
| tranDat                | dateboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Datum des Versands der Nachricht an die FE Applikation.  |
| tranExchangeld         | num[3]             | <u>Erläuterung:</u><br>Börsenplatz des Geschäftes<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [exchangeld]  |
| tranFee                | Snum[10,2]         | <u>Erläuterung:</u><br>Transaktionsentgelt (mit Vorzeichen!)  |
| tranFeeAsk             | Snum[10,2]         | <u>Erläuterung:</u><br>Transaktionsentgelt der Verkaufseite (mit Vorzeichen!)   |
| tranFeeBid             | Snum[10,2]         | <u>Erläuterung:</u><br>Transaktionsentgelt der Kaufseite (mit Vorzeichen!)  |
| tranFeeFlag            | char[2]            | <u>Erläuterung:</u><br>Transaktionsentgelt-Kennzeichen<br><b>Feldinhalt:</b><br>AT = abweichendes Transaktionsentgelt<br>HT = halbes Transaktionsentgelt<br>KT = kein Transaktionsentgelt   |
| tranFeeFlagAsk         | char[2]            | <u>Erläuterung:</u><br>Transaktionsentgelt-Kennzeichen Verkaufseite<br><b>Feldinhalt:</b><br>AT = abweichendes Transaktionsentgelt<br>HT = halbes Transaktionsentgelt<br>KT = kein Transaktionsentgelt  |
| tranFeeFlagBid         | char[2]            | <u>Erläuterung:</u><br>Transaktionsentgelt-Kennzeichen Kaufseite<br><b>Feldinhalt:</b><br>AT = abweichendes Transaktionsentgelt<br>HT = halbes Transaktionsentgelt<br>KT = kein Transaktionsentgelt   |
| tranTim                | timeboss<br>num[8] | <u>Erläuterung:</u><br>Zeitpunkt des Versands der Nachricht an die FE Applikation.  |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 281                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname        | Definition | Bemerkung  |
|-----------------|------------|--|
| trdResTypCod    | char[2]    | <p><u>Erläuterung:</u></p> <p>A. Handelshinweis</p> <p><b>Feldinhalt:</b><br/> EK = erster Kurs (in Stuttgart nur bei Ausführungen)<br/> KS = Kassakurs<br/> SK = Schlusskurs (nur bei Ausführungen)<br/> VA = variabler Handel<br/> 'blank' = variabler Handel</p> <p><u>Prüfung:</u><br/> Wird das Feld bei der Ordereingabe initialisiert übergeben, überprüft das Back End ggfs., ob die Nominale ein Vielfaches des jeweiligen Mindestschlusses der Gattung ist. Ist dies der Fall, erfolgt die Einstellung der Order in den variablen Handel. Ist dies nicht der Fall, so erfolgt die Einstellung der gesamten Order zur nächsten Kassakursfeststellung.<br/> Bei der Übermittlung einer Ausführung sagt das Feld aus, zu welchem Kurs die Order ausgeführt wurde.</p> <p>B. Kursart</p> <p><b>Feldinhalt:</b><br/> EK = erster Kurs<br/> KS = Kassakurs<br/> VA = variabler Kurs<br/> SK = Schlusskurs<br/> EM = erster Kurs      maschinell<br/> KM = Kassakurs      maschinell<br/> VM = variabler Kurs   maschinell<br/> SM = Schlusskurs     maschinell</p> <p><u>Prüfung:</u><br/> Mit den Feldinhalten „EM“, „KM“, „VM“ und „SM“ werden maschinelle dezentrale Kursfeststellungen gekennzeichnet. Die Ausprägungen sind gültig für die Requests<br/> XONTRO Start Pricing<br/> XONTRO Enter Price<br/> XONTRO Enter Block Price<br/> sowie für die Broadcasts<br/> BCFE_LOCK_ORDERS<br/> BCFE_ENTER_PRICE<br/> BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE</p> <p>In ausschließlich einheitsnotierten Gattungen sind nur „KS“ und „KM“ gültig.<br/> In ausschließlich fortlaufend notierten Gattungen sind nur „EK“, „EM“, „VA“, „VM“, „SK“ und „SM“ gültig.</p> |
| trdTypXontro    | char[2]    | <p><u>Erläuterung:</u><br/> Kennzeichen börsliches Geschäft</p> <p><b>Feldinhalt:</b><br/> 'blank' = außerbörslich (Default)<br/> BS = börslich</p>  |
| trdTypXontroAsk | char[2]    | <p><u>Erläuterung:</u><br/> Kennzeichen börsliches Geschäft auf der Verkaufseite</p> <p><b>Feldinhalt:</b></p>   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind gelb hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 282                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

| Feldname        | Definition              | Bemerkung   |
|-----------------|-------------------------|---|
|                 |                         | siehe Feld [trdTypXontro]   |
| trdTypXontroBid | char[2]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen börsliches Geschäft auf der Kaufseite<br><u>Feldinhalt:</u><br>siehe Feld [trdTypXontro]   |
| tvTic           | char[52]                | <u>Erläuterung:</u><br>Trading Venue Transaction Identification Code (MiFID II)<br>Der Schlüsselwert wird für jede Kursfeststellung eindeutig vergeben  |
| tvTicAsk        | char[52]                | <u>Erläuterung:</u><br>Trading Venue Transaction Identification Code (MiFID II) auf der Verkaufseite  |
| tvTicBid        | char[52]                | <u>Erläuterung:</u><br>Trading Venue Transaction Identification Code (MiFID II) auf der Kaufseite   |
| userNo          | num[10]<br>[nnnnxxxxxx] | <u>Erläuterung:</u><br>Identifizierungskennzeichen des Eingebers<br><u>Feldinhalt:</u><br>nnnn = KV-Nummer des Eingebers<br>xxxxxx = Individuelle Mitarbeiterkennung des Eingebers  |
| untOfTrad       | num[3]                  | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen der Notierungsart (Quantity Notation)<br><u>Feldinhalt:</u><br>0 = keine Angabe<br>1 = Stück-Notiz<br>2 = Prozent-Notiz<br>3 = Promille-Notiz<br>4 = Notierung in Punkten<br>9 = Sonstiges   |
| userOrdNum      | charboss[16]            | <u>Erläuterung:</u><br>Bankinterne Ordernummer eines Kreditinstitutes<br><u>Feldinhalt:</u><br>Es kann eine bis zu 16-stellige bankinterne Ordernummer vergeben werden.<br><u>Prüfung:</u><br>Die Eindeutigkeitsprüfung der bankinternen Ordernummer erfolgt auf Basis der von den Kreditinstituten vorgenommenen Einstellungen der Verarbeitungssteuerung (BCIN BV).<br>Es sind keine Umlaute und Sonderzeichen zulässig (Beispiel: Ä, Ö, Ü, \$, &, etc.). |
| valueDat        | dateboss<br>num[8]      | <u>Erläuterung:</u><br>Valutadatum  |
| valueDatCod     | char[2]                 | <u>Erläuterung:</u><br>Valutakennzeichen<br><u>Feldinhalt:</u><br>FZ = Zug um Zug Regulierung<br>FI = internationale Valuta (kann nicht bei Requests verwendet werden)<br>FE = Emissionsvaluta bei Handel per Erscheinen (kann nicht bei Requests verwendet werden)   |
| venueMic        | char[4]                 | <u>Erläuterung:</u><br>MIC (Market Identifier Code) des Handelsplatzes bzw. des Handelsssegmentes eines Handelsplatzes im Sinne der <b>MiFID II</b> Regulation.   |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 283                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

| Feldname        | Definition | Bemerkung   |
|-----------------|------------|---|
| venueSegMic     | char[4]    | <u>Erläuterung:</u><br>MIC (Market Identifier Code) des Handelssegmentes eines Handelsplatzes im Sinne der CSDR Regulation.   |
| xontroOdrCodAsk | char[2]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen des Ursprungs des Geschäfts auf der Verkaufseite<br><b>Feldinhalt:</b><br>C = Order aus XONTRO Order<br>CW = Orderweiterleitung aus XONTRO Order |
| xontroOdrCodBid | char[2]    | <u>Erläuterung:</u><br>Kennzeichen des Ursprungs des Geschäfts auf der Kaufseite<br><b>Feldinhalt:</b><br>siehe Feld [xontroOdrCodAsk]  |

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 284                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

### 3.3 Übersicht Feldbezeichner

Folgende Feldbezeichner sind bei Fehlermeldungen in errFieldRef eingetragen

|                     |                                      |
|---------------------|--------------------------------------|
| undefiniert         | BC_ERR_FIELD_UNDEFINED               |
| acctTypCodXontro    | BC_ERR_FIELD_ACCT_TYP_COD_XONTRO     |
| acctTypCodXontroAsk | BC_ERR_FIELD_ACCT_TYP_COD_XONTRO_ASK |
| acctTypCodXontroBid | BC_ERR_FIELD_ACCT_TYP_COD_XONTRO_BID |
| acrIntDay           | BC_ERR_FIELD_ACR_INT_DAY             |
| acrIntDayCod        | BC_ERR_FIELD_ACR_INT_DAY_COD         |
| allotCapQty         | BC_ERR_FIELD_ALLOT_CAP_QTY           |
| allotType           | BC_ERR_FIELD_ALLOT_TYPE              |
| bcPwd               | BC_ERR_FIELD_BC_PWD                  |
| bkrNo               | BC_ERR_FIELD_BKR_NO                  |
| bkrUserNo           | BC_ERR_FIELD_BKR_USER_NO             |
| bonusRat            | BC_ERR_FIELD_BONUS_RAT               |
| btradeNo            | BC_ERR_FIELD_BTRADE_NO               |
| btradeNoAsk         | BC_ERR_FIELD_BTRADE_NO_ASK           |
| btradeNoBid         | BC_ERR_FIELD_BTRADE_NO_BID           |
| buyCod              | BC_ERR_FIELD_BUY_COD                 |
| changeQty           | BC_ERR_FIELD_CHANGE_QTY              |
| chargesAsk          | BC_ERR_FIELD_CHARGES_ASK             |
| chargesBid          | BC_ERR_FIELD_CHARGES_BID             |
| clearingCurrTypCod  | BC_ERR_FIELD_CLEARING_CURR_TYP_COD   |
| clientInd           | BC_ERR_FIELD_CLIENT_IND              |
| clientCod           | BC_ERR_FIELD_CLIENT_COD              |
| comAmtAsk           | BC_ERR_FIELD_COM_AMT_ASK             |
| comAmtBid           | BC_ERR_FIELD_COM_AMT_BID             |
| comCodAsk           | BC_ERR_FIELD_COM_COD_ASK             |
| comCodBid           | BC_ERR_FIELD_COM_COD_BID             |
| commissionAgentFlag | BC_ERR_FIELD_COMMISSION_AGENT_FLAG   |
| comRateAsk          | BC_ERR_FIELD_COM_RATE_ASK            |
| comRateBid          | BC_ERR_FIELD_COM_RATE_BID            |
| confirmTim          | BC_ERR_FIELD_CONFIRM_TIM             |
| ctpyExchangeld      | BC_ERR_FIELD_CTPY_EXCHANGE_ID        |
| ctpyNo              | BC_ERR_FIELD_CTPY_NO                 |
| ctpyNoAsk           | BC_ERR_FIELD_CTPY_NO_ASK             |
| ctpyNoBid           | BC_ERR_FIELD_CTPY_NO_BID             |
| ctpySubNo           | BC_ERR_FIELD_CTPY_SUB_NO             |
| currExcRat          | BC_ERR_FIELD_CURR_EXC_RAT            |
| currTypCod          | BC_ERR_FIELD_CURR_TYP_COD            |
| customerld          | BC_ERR_FIELD_CUSTOMER_ID             |
| customerldClass     | BC_ERR_FIELD_CUSTOMER_ID_CLASS       |
| deactComment        | BC_ERR_FIELD_DEACT_COMMENT           |
| deactFromDat        | BC_ERR_FIELD_DEACT_FROM_DAT          |
| deactText           | BC_ERR_FIELD_DEACT_TEXT              |
| deactToDat          | BC_ERR_FIELD_DEACT_TO_DAT            |
| deaFlag             | BC_ERR_FIELD_DEA_FLAG                |
| exchangeld          | BC_ERR_FIELD_EXCHANGE_ID             |
| exchangeOrdNum      | BC_ERR_FIELD_EXCHANGE_ORD_NUM        |
| executionInd        | BC_ERR_FIELD_EXECUTION_IND           |
| executionCod        | BC_ERR_FIELD_EXECUTION_COD           |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 285                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

|                   |                                    |
|-------------------|------------------------------------|
| fee               | BC_ERR_FIELD_FEE                   |
| feeAsk            | BC_ERR_FIELD_FEE_ASK               |
| feeBid            | BC_ERR_FIELD_FEE_BID               |
| feeFlag           | BC_ERR_FIELD_FEE_FLAG              |
| feeFlagAsk        | BC_ERR_FIELD_FEE_FLAG_ASK          |
| feeFlagBid        | BC_ERR_FIELD_FEE_FLAG_BID          |
| fwdOrdrCod        | BC_ERR_FIELD_FWD_ORDR_COD          |
| inSeqNo           | BC_ERR_FIELD_IN_SEQ_NO             |
| inSeqNoRef        | BC_ERR_FIELD_IN_SEQ_NO_REF         |
| investmentInd     | BC_ERR_FIELD_INVESTMENT_IND        |
| investmentCod     | BC_ERR_FIELD_INVESTMENT_COD        |
| isinCod           | BC_ERR_FIELD_ISIN_COD              |
| isinCodNew        | BC_ERR_FIELD_ISIN_COD_NEW          |
| isinCodSrs        | BC_ERR_FIELD_ISIN_COD_SRS          |
| iwOrdCod          | BC_ERR_FIELD_IW_ORD_COD            |
| iwOrdCodAsk       | BC_ERR_FIELD_IW_ORD_COD_ASK        |
| iwOrdCodBid       | BC_ERR_FIELD_IW_ORD_COD_BID        |
| killFlag          | BC_ERR_FIELD_KILL_FLAG             |
| liquidityProvFlag | BC_ERR_FIELD_LIQUIDITY_PROV_FLAG   |
| matchFlag         | BC_ERR_FIELD_MATCH_FLAG            |
| matchFlagAsk      | BC_ERR_FIELD_MATCH_FLAG_ASK        |
| matchFlagBid      | BC_ERR_FIELD_MATCH_FLAG_BID        |
| netTypCodXontro   | BC_ERR_FIELD_NET_TYP_COD_XONTRO    |
| nrCod             | BC_ERR_FIELD_NR_COD                |
| nrDat             | BC_ERR_FIELD_NR_DAT                |
| onBehalfCtpyNoAsk | BC_ERR_FIELD_ON_BEHALF_CTPY_NO_ASK |
| onBehalfCtpyNoBid | BC_ERR_FIELD_ON_BEHALF_CTPY_NO_BID |
| optOutFlag        | BC_ERR_FIELD_OPT_OUT_FLAG          |
| ordrBegDatCod     | BC_ERR_FIELD_ORDR_BEG_DAT_COD      |
| ordrBkExeQty      | BC_ERR_FIELD_ORDR_BK_EXE_QTY       |
| ordrEntNo         | BC_ERR_FIELD_ORDR_ENT_NO           |
| ordrExePrc        | BC_ERR_FIELD_ORDR_EXE_PRC          |
| ordrExePrcAsk     | BC_ERR_FIELD_ORDR_EXE_PRC_ASK      |
| ordrExePrcBid     | BC_ERR_FIELD_ORDR_EXE_PRC_BID      |
| ordrExePrcMod     | BC_ERR_FIELD_ORDR_EXE_PRC_MOD      |
| ordrExpDat        | BC_ERR_FIELD_ORDR_EXP_DAT          |
| ordrNo            | BC_ERR_FIELD_ORDR_NO               |
| ordrQty           | BC_ERR_FIELD_ORDR_QTY              |
| ordrQtyAsk        | BC_ERR_FIELD_ORDR_QTY_ASK          |
| ordrQtyBid        | BC_ERR_FIELD_ORDR_QTY_BID          |
| ordrResCod        | BC_ERR_FIELD_ORDR_RES_COD          |
| ordrStopLim       | BC_ERR_FIELD_ORDR_STOP_LIM         |
| origOrdrQty       | BC_ERR_FIELD_ORIG_ORDR_QTY         |
| otcPostTradInd    | BC_ERR_FIELD_OTC_POST_TRAD_IND     |
| postProcFlag      | BC_ERR_FIELD_POST_PROC_FLAG        |
| processingCod     | BC_ERR_FIELD_PROCESSING_COD        |
| quoteTimeStamp    | BC_ERR_FIELD_QUOTE_TIME_STAMP      |
| redQty            | BC_ERR_FIELD_RED_QTY               |
| refTim            | BC_ERR_FIELD_REF_TIM               |
| repExchangeld     | BC_ERR_FIELD_REP_EXCHANGE_ID       |
| repExchangeldAsk  | BC_ERR_FIELD_REP_EXCHANGE_ID_ASK   |
| repExchangeldBid  | BC_ERR_FIELD_REP_EXCHANGE_ID_BID   |
| settlementFlag    | BC_ERR_FIELD_SETTLEMENT_FLAG       |

Hinweis: Änderungen zu Release 02 sind **gelb** hinterlegt (S. 191, S. 195, S. 205, S. 213, S. 283).

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH     | Seite 286                   |
| XONTRO Values API – Planing Version               | Version 02.01<br>05.11.2020 |
| XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 |                             |

|                     |                                     |
|---------------------|-------------------------------------|
| shortSellCod        | BC_ERR_FIELD_SHORT_SELL_COD         |
| text                | BC_ERR_FIELD_TEXT                   |
| textTrad            | BC_ERR_FIELD_TEXT_TRAD              |
| textTradAsk         | BC_ERR_FIELD_TEXT_TRAD_ASK          |
| textTradBid         | BC_ERR_FIELD_TEXT_TRAD_BID          |
| ticket              | BC_ERR_FIELD_TICKET                 |
| tradBegDat          | BC_ERR_FIELD_TRAD_BEG_DAT           |
| tradCapacityCod     | BC_ERR_FIELD_TRAD_CAPACITY_COD      |
| tradContDat         | BC_ERR_FIELD_TRAD_CONT_DAT          |
| tradContTim         | BC_ERR_FIELD_TRAD_CONT_TIM          |
| tradContTimFraction | BC_ERR_FIELD_TRAD_CONT_TIM_FRACTION |
| tradMtchCod         | BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_COD          |
| tradMtchPrc         | BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_PRC          |
| tradMtchPrcAsk      | BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_PRC_ASK      |
| tradMtchPrcBid      | BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_PRC_BID      |
| tradMtchPrcNo       | BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_PRC_NO       |
| tradMtchQty         | BC_ERR_FIELD_TRAD_MTCH_QTY          |
| tradNo              | BC_ERR_FIELD_TRAD_NO                |
| tranExchangeld      | BC_ERR_FIELD_TRAN_EXCHANGE_ID       |
| tranFee             | BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE               |
| tranFeeAsk          | BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE_ASK           |
| tranFeeBid          | BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE_BID           |
| tranFeeFlag         | BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE_FLAG          |
| tranFeeFlagAsk      | BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE_FLAG_ASK      |
| tranFeeFlagBid      | BC_ERR_FIELD_TRAN_FEE_FLAG_BID      |
| trdResTypCod        | BC_ERR_FIELD_TRD_RES_TYP_COD        |
| trdTypXontro        | BC_ERR_FIELD_TRD_TYP_XONTRO         |
| tvTic               | BC_ERR_FIELD_TV_TIC                 |
| untOfTrad           | BC_ERR_FIELD_UNT_OF_TRAD            |
| userOrdNum          | BC_ERR_FIELD_USER_ORD_NUM           |
| valueDat            | BC_ERR_FIELD_VALUE_DAT              |
| valueDatCod         | BC_ERR_FIELD_VALUE_DAT_COD          |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 287                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 3.4 Completion Codes

Die Fehlermeldungen entnehmen Sie bitte der aktuellsten Datei XONTROmsg\_qsam.dat. Diese finden Sie im Download-Bereich unter [www.xontro.de](http://www.xontro.de).

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH  | Seite 288                   |
| XONTRO Values API – Planing Version<br><br>XONTRO Systemanschluss Makler - QSAM - Release 02 | Version 02.01<br>05.11.2020 |

### 3.5 Xontro Values API Header und Completion Codes

Dieser Abschnitt beschreibt alle Dateien, die für die Programmierung der Xontro VALUES API Schnittstelle benötigt werden. Diese Dateien enthalten die Fehlertexte, Konstanten, Aufzählungen und Strukturdefinitionen.

In der nachfolgenden Tabelle sind die Dateien zusammengestellt. Sie werden als Headerfelder über die Website [www.xontro.de](http://www.xontro.de) bereitgestellt.

| Datei              | Beschreibung  |
|--------------------|---|
| bclayouts_qsam.h   | Die Datei beinhaltet die Konstantendefinitionen in „C“ Syntax für alle Xontro Request IDs, Subtypes, errFieldRef Werte, Streamtypes, symbolisch adressierbare Completion Codes, und die in der vorliegenden Dokumentation beschriebenen, symbolisch adressierbaren Feldwerte. Sie enthält weiterhin alle Xontro-spezifischen Datenstrukturen.         |
| XONTROmsg_qsam.dat | Die Datei beinhaltet alle Xontro spezifischen Completion Codes im Feld qsamComplCode und die zugeordneten Fehlertexte. Diese Datei kann auch zur Entschlüsselung des Feld errCod in der Xontro Enter Block Price Response verwendet werden. Das Format jeder Zeile ist:<br><br>NNNNN, Fehlertext<br><br>NNNNN steht für den Wert des Completion Codes |