



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute Nr. 113

Financial Institutes No. 113

FAGSE Modification Announcement 7

Dieser XONTRO Newsletter beinhaltet Informationen zu folgenden Punkten:

- XONTRO-Migration auf die T7 Plattform  
FAGSE Modification Announcement Nr. 7

Disclaimer:

Bei dem hier versendeten Newsletter handelt es sich um keine Werbung, sondern um ergänzende Informationen zur Produktdokumentation hinsichtlich eines von der Firma BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH, Börsenplatz 4, 60313 Frankfurt am Main betriebenen oder technisch erreichbaren Systems.

Die Newsletter werden daher nur an BrainTrade Systemnutzer bzw. deren Dienstleister per E-Mail übermittelt.

Der Newsletterversand kann jederzeit per Mail an "trade(at)xontro.de" oder telefonisch unter +49-(0)69-589978-110 widerrufen werden.

## 1. FAGSE Modification Announcement

Dieses Modification Announcement Nr. 4 beschreibt die Hinweise und Änderungen im Zusammenhang mit der XONTRO zu T7 Migration der BrainTrade FAGSE-FIX-Schnittstelle.

Im Rahmen des Projektes werden ggfs. weitere Update-Dokumente mit aktualisierten Inhalten zur Verfügung gestellt.

Den aktuellen Dokumentationsstand finden Sie unter: <https://xontro.de/T7-Migration>.

Eine entsprechend angepasste RoE wird an entsprechender Stelle ebenfalls zeitnah veröffentlicht.

### 1.1 Anbindung und T7 Verfügbarkeit

Das neue FAGSE Gateway wird ab Start der T7 Simulation parallel zum aktuellen FAGSE BT-FIX-Gateway in der Simulationsumgebung zur Verfügung stehen.

Weiters ist geplant, das neue FAGSE Gateway in der Produktionsumgebung von Mitte Mai 2025 bis zum Migrationstermin im Juni 2026 parallel zum aktuellen FAGSE BT-FIX-Gateway für Connection-Tests zur Verfügung zu stellen.

#### Neue Ziel IP-Adresse

Es werden neue IP-Adressen, für Primary und Secondary FAGSE Gateway zur Verfügung gestellt. Die bestehenden Leitungsanbindungen zur Deutschen Börse können über ein neu definiertes Member-LAN genutzt werden. Eine zweite IP-Adresse steht zukünftig für den Fall eines Failovers für Reconnection und FIX-Session Logon zur Verfügung.

#### Neuer Ziel Port

Es wird ein eigener Port für jede FIX-Session (SenderCompID) zur Verfügung gestellt. Der Name der jeweiligen SenderCompID im FAGSE BT-FIX-Gateway bleibt unverändert.

#### T7 Verfügbarkeit

|                |                       |                |
|----------------|-----------------------|----------------|
| Börslich:      | Vorhandelsphase:      | ab 07:00 Uhr** |
|                | Handelsphase          | ab 08:00 Uhr   |
|                | Nachhandelsphase      | ab 22:00 Uhr   |
|                | Ende Nachhandelsphase | ab 22:05 Uhr** |
| Außerbörslich: | Start OTC/PÜEV        | ab 08:00 Uhr** |
|                | Ende OTC/PÜEV         | ab 22:30 Uhr** |

**\*\* Nachrichten außerhalb der Verfügbarkeitszeiten werden vom FAGSE-Gateway abgelehnt.**

### TLS-Verschlüsselung

Es wird mit Start der neuen Simulationsumgebung auch die Version TLS 1.3 unterstützt. Aus regulatorischen Gründen ist ab dem 16.03.2026 die Verwendung von TLS 1.3 für alle Teilnehmer verpflichtend.

## **1.2 FAGSE Gateway – Passwort und Passwortänderung**

Die Limitierung des Passwortes auf 8 Stellen wird aufgehoben.

Die Gültigkeit des Passwortes ist nicht mehr auf 30 Tage beschränkt.

Für jede zulässige/definierte FIX-Zentrale kann in der T7 Member Section (Simulation & Produktion) eine FAGSE Session ID und ein FAGSE Session Passwort angefordert werden. Die bereitgestellten Anmeldeinformationen sind in der Logon-Nachricht in den Feldern Username (Tag 553) und Password (Tag 554) mitzuliefern.

Passwortänderungen zu einer FAGSE Session ID können bei Bedarf in der T7 Member Section des Teilnehmers angefordert werden. Es wird ein neu generiertes Passwort für die ausgewählte FAGSE Session ID bereitgestellt. Die letzten 4 Stellen der FAGSE Session ID entsprechen der FIX-Zentrale.

Eine Passwortänderung via FAGSE Gateway ist technisch somit nicht mehr erforderlich und möglich.

- RoE-Kapitel 2.3 Security
- RoE-Kapitel 3.2.1 Verarbeitung Fix-Requests
- RoE-Kapitel 3.4.2 Passwortänderung
- RoE-Kapitel 5.2 Logon / ~~Logon mit gleichzeitiger Passwortänderung~~
- RoE-Kapitel 5.3 ~~Passwortänderung~~ (Absatz gestrichen)
- RoE-Kapitel 13 Tag 448 PartyID <session>, Tag 553, Tag 554

## **1.3 Hinweise und Änderungen – Datenstrukturen und -felder**

### **1.3.1 Request NewOrderSingle**

Die Funktionalität „Orderrouting via Freimakler“ steht in T7 nicht zur Verfügung. Daher wird die optionale Angabe eines „Market Makers“ als Orderempfänger in den Request-Nachrichten NewOrderSingle und OrderCancelReplaceRequest ignoriert.

- Request NewOrderSingle
- Belegung FIX 4.2 (Tag 9318 MktMkerID)
- Belegung FIX 4.4 (Tag 448 PartyID <market maker>) und (Tag 452 PartyRole = 66 (MarketMaker))

Die Funktionalität „Eingabe von Folgetagorders“ steht in T7 nicht mehr zur Verfügung.

Das FAGSE Orderrouting von Folgetagorders zu MAX-ONE ist hiervon nicht betroffen.

XONTRO / Kreditinstitute  
XONTRO / Financial Institutes

FAGSE Modification Announcement 7  
Newsletter 113

---

- Request NewOrderSingle
- Belegung FIX 4.2 & FIX 4.4  
(Tag 5156 Unreleased Date)  
Eingaben in diesem Feld werden für T7 Börsenplätze abgelehnt.

### 1.3.2 Broadcast ExecutionReport - Orderausführung

In diesem Feld wird weiterhin eine je Marktplatz (XDUS, XHAM, XHAN) und Market Maker / Spezialist eindeutige „KVNr“ übermittelt.

- Broadcast ExecutionReport
- Belegung FIX 4.2 (Tag 9318 MktMkerID)
- Belegung FIX 4.4 (Tag 448 PartyID) und (Tag 452 PartyRole = 66 (MarketMaker))

Geänderte Feldbefüllung; das Valutadatum aus T7 bzw. MAX-ONE wird bei jeder Orderausführung geliefert.

- Broadcast ExecutionReport
- Belegung FIX 4.2 (Tag 64 - SettlDate)
- Belegung FIX 4.4 (Tag 64 - SettlDate)

Neues optionales Feld; die jeweiligen Devisenkurse der Schnittstellen (T7 & MAX-ONE) werden – wenn vorhanden – übermittelt.

- Belegung FIX 4.2 (Tag 155 – SettlCurrFxRate)
- Belegung FIX 4.4 (Tag 155 – SettlCurrFxRate)

Bei der Orderfunktionalität werden bei ausgehenden Nachrichten in der PartyID (Tag 448) bei der PartyRole =55 (Session ID) die T7-MemberID (String 5) unterstützt.

Bei eingehenden Nachrichten TradingSessionSubID (Tag 625) ist mit Schlüssel 6 die SAO – Special Auction zulässig.

### 1.3.3 Request TradeCaptureReport

Courtage, Spesen und Provision können nicht mehr gemeinsam für ein OTC/PÜEV-Geschäft eingegeben werden; es ist nur jeweils eine dieser Angaben im Request TradeCaptureReport zulässig.

Request TradeCaptureReport

Belegung FIX 4.2 & FIX 4.4

- (Tag 9473 TransactionCostCode) und  
(Tag 9476 TransactionCostAmt) mit Courtage-Angabe für die Ausprägungen  
– FC (Franco)  
– FR (Franco Rechnung)  
– AC (Abweichende Courtage)  
Die Ausprägung HC (Halbe Courtage) wird nicht mehr unterstützt.

- (Tag 12 Commission (Spesenbetrag)) mit der Angabe von Spesen
- (Tag 9596 ClientFreeField1) mit der Angabe eines Provisionsbetrages und (Tag 9597 ClientFreeField2) mit der Ausprägung = „PD“ Provisionsbetrag.

Im TrdRegTimestamp (Tag 769) übersteuert die Angabe des Timestamps beim Enter OTC die Angabe des Schlusstages im Feld TradeDate und die Angabe der Abschluss-Uhrzeit im Feld TradeTime.

Erlaubt ist hier die Eingabe von "Börsentagen in der Vergangenheit", wobei diese Eingabe max. 90 Tage zurückreichen darf.

In der XONTRO-Geschäftseingabe sind bisher Texteingaben mit einer Länge von 30 Character möglich.

- (Tag 58 Text) Freitext  
Im Request TradeCaptureReport sind zukünftig Texteingaben mit einer Gesamtlänge von 24 Character zulässig (2 x 12 Character für die Übertragung in die T7 Felder FreeText1 und FreeText2).

Trading Capacity – neues optionales Feld

- Tag1815 kann auf beide Seiten (ask/bid) des Trades in der Sides Repeating Group eingegeben werden.

Belegung FIX 4.2 & FIX 4.4

- (Tag 1815 TradingCapacity) neues optionales Eingabefeld  
1 = AOTC (Handel für Kunde)  
5 = DEAL (Handel für eigene Rechnung)  
Bei Nichtbelegung des FIX-Tag wird der Wert „AOTC“ defaultmäßig übergeben.

Kennzeichen Emissionsgeschäft

- (Tag 5681 ExchangeTradeType) Kennzeichen Emissionsgeschäft wird im Request TradeCaptureReport nicht mehr unterstützt. Eingaben in diesem Feld werden abgelehnt.

Die XONTRO Funktionalität „Bonifikation“ steht in T7 nicht mehr zur Verfügung.

- (Tag 6584 SpreadPctPremium) Bonifikationssatz in Prozent wird im Request TradeCaptureReport nicht mehr unterstützt. Eingaben in diesem Feld werden abgelehnt.

Die nachfolgender Felder werden innerhalb von T7 nicht verarbeitet

XONTRO / Kreditinstitute  
XONTRO / Financial Institutes

FAGSE Modification Announcement 7  
Newsletter 113

- (Tag 7567 ReportedPxDiff) Abweichender Preisindikator  
(Tag 7568 ReportedPxReason) Verhandelter Preisindikator  
Die Eingaben in diesen Feldern werden im Rahmen der T7 Verarbeitung ignoriert.

Die gesamte INVESTRO Funktionalität steht in T7 nicht mehr zur Verfügung.

- (Tag 6586 CashOffset) Wiederanlagerabatt Investro  
wird im Request TradeCaptureReport nicht mehr unterstützt.  
Eingaben in diesem Feld werden ignoriert.

#### 1.3.4 Geschäftsinformation "TradeCaptureReportSno"

- (Tag 64 SettlDate)

| Tag | Feldname  | RF | R | Kommentare  |
|-----|-----------|----|---|---|
| 64  | SettlDate | O  | M | LocalMktDate<br>Datum Festvaluta<br>Nur mit Tag 5053 gemeinsam. |

- (Tag 283 LocationID)  
Beim Börsenplatz des Meldewesens werden XBER (Berlin) und XSTU (Stuttgart) werden nicht mehr geliefert.

Der Segment-MIC wird in den Realtime-Schlussnoten wie folgt aufgenommen

- (Tag 578 TradeInputSource)  
OTC Geschäft: Segment-MIC der OTC Eingabe (optional)  
Börsliches Geschäft: Segment-MIC des T7 GSE Börsenplatzes

#### 1.3.5 Broadcast TradeCaptureReportSno

Broadcast TradeCaptureReportSno

Belegung FIX 4.2 & FIX 4.4

- (Tag 448 PartyID) with PartyRole=1 (ExecutingFirm)  
Hier wird bei börslichen Geschäften die KV-Nummer des T7 Spezialisten (für XDUS, XHAM, XHAN) geliefert.
- (Tag 6732 DealerNote)
  - a) Das 3-stellige Feld Verwahrmöglichkeit ('013', '041', '060', '092', '040', etc.) an der 5ten Position der DealerNote wird zukünftig mit der Verwahart ('GS', 'AKV', 'NCT', 'STR', 'WPR') belegt.
  - b) Das 8-stellige Feld Zinstermin an der 6ten Position der DealerNote wird zukünftig aus der Kombination der beiden WM-Feldern GD812 (Zinstermin Tag) + GD813 (Zinstermin Monat) belegt.  
Bei abweichenden Tagen am Monatsende gelten folgende Zusatzregeln für die Feldbelegung:

| GD813 | GD812 | Zinstermin |
|-------|-------|------------|
| FA    | 29    | 28F29A     |
| FA    | 30    | 28F30A     |
| FA    | 31    | 28F31A     |
| JJ    | 31    | 31J31J     |
| MS    | 31    | 31M30S     |
| AO    | 31    | 30A31O     |
| MN    | 31    | 31M30N     |
| JD    | 31    | 30J31D     |
| F29A  | 29    | 28F29A     |

| GD813 | GD812 | Zinstermin  |
|-------|-------|-------------|
| F29A  | 30    | 28F29A      |
| F29A  | 31    | 28F29A      |
| F30A  | 30    | 28F30A      |
| F30A  | 31    | 28F30A      |
| F31A  | 31    | 28F31A      |
| A31O  | 31    | 30A31O      |
| J31D  | 31    | 30J31D      |
| Else  | Else  | GD812+GD813 |

Hinweis: Im T7 Download-Bereich der Deutschen Börse wird für alle migrierten XONTRO-Märkte ein CSV-Stammdaten-File „All-Tradable-Instruments“ mit den Instrument-Daten zur Verfügung gestellt.

c) Das 6-stellige Feld Eingabe-ID an der letzten Position der DealerNote wird nicht mehr belegt. Bisher nur bei speziellen Eingabe/Kontrahent-Kombinationen (Maklereingaben)

d) Das Unterfeld abweichender Kontrahenten Kurs wird fest mit „000000,0000“ belegt, da solche abweichenden Kurse in T7 und von MAX-ONE nicht mehr erfasst und verarbeitet werden können.

- (Tag 64 SettIDate)  
In allen Realtime-Schlussnoten wird zukünftig das Valutadatum mitgeliefert (auch bei Standard T+2).
- Tag 9954 – NextMsgFlag  
Jeder "TradeCaptureReportSno" kann pro Seite (Kauf/Verkauf) nur eine Orderreferenz enthalten mit der Folge, dass jede Nachricht zu einer Schlussnote via Tag 9954 (NextMsgFlag) mit der Ausprägung "N" gekennzeichnet wird.
- Tag 37 – OrderID  
Ordernummer (Ordernummer des Handelssystems – ohne führende Nullen)
  - T7-OrderID: Präfix „DWZ“ + Nummer (z.B. DWZ1765123456000000001)
  - T7-Geschäfte ohne Orderbezug: Präfix „MAN“ + Nummer (z.B. MAN1765123456000000002)
  - MAX-ONE OrderID: Präfix „MAX“ + Nummer (z.B. MAX176868001)
  - Bankinterne Ordernummer (SecondaryClOrdID) *oder*
  - Bankinterne OTC-Nummer (SecondaryTradeReportID)

### 1.3.6 Storno und Durchlieferung

Die Stornierung eines OTC-Geschäftes kann nur am aktuellen Geschäftstag während der Handelsphase vorgenommen werden. An Folgetagen ist die Eingabe eines Gegengeschäftes erforderlich. Eine Übermittlung von Xontro-Durchlieferungen (T+2) über die FIX-Request-Nachricht TradeCaptureReport ist nicht mehr vorgesehen.

Weitere Informationen zu den zukünftigen Eingabemöglichkeiten von Stornierungen werden separat bekanntgegeben.

Für OTC/PÜEV-Eingaben sind noch folgende Belegungen zulässig:

- Request TradeCaptureReport (MsgType „AE“)
- Belegung FIX 4.2 & FIX 4.4
- (Tag 487 TradeReportTransType) mit 0 = „new“ (EnterOTC) oder mit 1 = „cancel“ (Delete-OTC)
- (Tag 880 TrdMatchID) mit „Geschäftsnummer des Ursprungsgeschäftes“ bei Delete-OTC

Im Falle eines OTC-Geschäftsstornos (Delete-OTC) werden - wie bisher auch - in der Realtime-SNO Nachricht die relevanten Datenfelder wie folgt belegt:

- Broadcast TradeCaptureReportSno (MsgType „USN“)
- Belegung FIX 4.2 & FIX 4.4
- (Tag 829 TrdSubType) mit 9612 (Tagesstorno Kauf – Direktgeschäft) oder 9622 (Tagesstorno Verkauf – Direktgeschäft)

### 1.3.7 Request OrderCancelRequest und OrderCancelReplaceRequest

Geänderte Feldbefüllung: Das bislang optionale FIX Tag 100 ExDestination (MIC-Code des Börsenplatzes) ist zukünftig „mandatory“ und somit immer bei Aufruf der nachfolgenden Requests mitzuliefern.

- Request OrderCancelRequest  
Request OrderCancelReplaceRequest
- Belegung FIX 4.2 (Tag 100 ExDestination)
- Belegung FIX 4.4 (Tag 100 ExDestination)

Wird das Textfeld (Tag 58) bei der Änderung nicht mitgeliefert, dann wird der Text gelöscht; dies gilt ebenso bei der SecondaryClOrdID (Tag 526).

Bei TimeInForce (Tag 59) im OrderCancelReplaceRequest wird bei T7 GSE: das Feld bei der Änderung nicht mitgeliefert, es wird Default „0“ Good for Day gesetzt. MAX-ONE hat keinen Default.

### 1.3.8 Ereignismitteilung "News"

Geänderte Feldbefüllung – Tag 148 - Headline

Siehe hierzu RoE-Kapitel 7.3.2

Geänderte Feldbefüllung - NoRoutingIDs Repeating Group <RoutingGrp>, Tag 217 - RoutingID

Siehe hierzu RoE-Kapitel 7.3.5

XONTRO / Kreditinstitute  
XONTRO / Financial Institutes

FAGSE Modification Announcement 7  
Newsletter 113

---

Im Feld Headline (Tag 148) werden nachfolgende Schlüssel unterstützt

- BOSTAOTC Start of Service T7 GSE OTC
- BOSTAORD Start of Service T7 GSE Order
- BOENDOTC End of Service T7 GSE OTC
- BOENDORD End of Service T7 GSE Order
- EHSTA Handelsstart MAX-ONE
- EHEND Handelssende MAX-ONE

Gestrichen wurden

- BOEND Handelssende T7 GSE
- EHEND Handelssende MAX-ONE

## 1.4 Inhaltliche Besonderheiten bzw. Eindeutigkeiten von Schlüsselfeldern

### 1.4.1 Duplicate Key Handling (CIOrdID)

Im Feld (Tag 11 CIOrdID – Identifier des FAGSE-Auftrages) wird ein eindeutiger Schlüssel im Format String[16] erwartet. Es ist zu berücksichtigen, dass aus technischen Gründen (upper/lower case restriction) folgende Beispielnachricht als „duplicate Key“ abgelehnt wird:

- 1. Nachricht: CIOrdID = ABC1234
- 2. Nachricht: CIOrdID = abc1234 -> doppelt bzw. bereits verwendet

### 1.4.2 Duplicate Key Handling (SecondaryCIOrdID)

In XONTRO kann derzeit konfiguriert werden, dass die Eindeutigkeit jeder eingestellten bankinternen Ordernummer (Tag 526 SecondaryCIOrdID) vom System geprüft und im Fehlerfall die Einstellung abgelehnt wird.

Diese Prüfung stellt das T7 System nicht bereit; es liegt daher zukünftig im Verantwortungsbereich des Teilnehmers, bei der Eingabe die Eindeutigkeit seiner bankinternen Ordernummer sicherzustellen.

### 1.4.3 T7 Ordernummernsystematik (OrderID)

Das Feld (Tag 37 OrderID) wird in allen Ordernachrichten auf eine maximale Länge von 20 Stellen (Integer) erweitert.

Für die Marktplätze (XDUS, XHAM, XHAN) wird zukünftig eine börsliche T7 Ordernummer geliefert. Die Vergabe der T7 Ordernummern entspricht dem bestehenden Verfahren, welches auch im T7 Spezialistenmodell der FWB genutzt wird.

#### Aussagen zur T7 OrderID:

*“An exchange order ID is guaranteed to be unique among all orders of the same product. Exchange Order ID is generated by the T7 System; it remains constant over the lifetime of an order.”*

Die Ordernummer kann eine maximal 20-stelligen Nummer enthalten und wird ohne führende Nullen geliefert.

Eine börsenplatzübergreifende Eindeutigkeit ist durch die Nutzung der Datenfelder Börsenplatz / ISIN / Ordernummer gegeben.

XONTRO / Kreditinstitute  
XONTRO / Financial Institutes

FAGSE Modification Announcement 7  
Newsletter 113

Beispiele (schematische Darstellung – Bsp. „T7“ in Mod. Announcement 3 geändert)  
(Hinsichtlich der Präfixvergabe siehe bitte Abschnitt „Broadcast Trade Capture Report SNO“, der Broadcast „Execution Report“ wird - wie heute auch - ohne Präfix geliefert.)

|         |                    |      |  |
|---------|--------------------|------|--|
| XONTRO  | 2412023000123      | XDUS | (bisher)   |
|         | 2412024000123      | XHAM | (bisher)   |
|         | 2412025000123      | XHAN | (bisher)   |
| T7      | 174783972216500000 | XDUS | ISIN 1 (neu)   |
|         | 174783972216500000 | XDUS | ISIN 2 (neu)   |
|         | 174783972216500001 | XHAM | ISIN 1 (neu)   |
|         | 174783972216500001 | XHAM | ISIN 2 (neu)   |
|         | 174783972216500002 | XHAN | ISIN 1 (neu)   |
|         | 174783972216500002 | XHAN | ISIN 2 (neu)   |
| MAX-ONE | 166114664          | XMUN | ( <a href="#">unverändert ohne führende Nullen</a> ) |
| MAX-ONE | 166392143          | XMUN | ( <a href="#">unverändert ohne führende Nullen</a> ) |

#### 1.4.4 Trading Venue Transaction Identification Code - TVTIC

Im Feld (Tag 1903 RegulatoryTradeID) wird der Trading Venue Transaction Identification Code "TVTIC" übermittelt.

- Die XONTRO TVTIC ist nach folgendem Schema aufgebaut:  
Segment MIC (4) + ISIN (12) + Börsentag (8) + Zeit Kursbestätigung (12)
- Der Aufbau der TVTIC von MAX-ONE wurde von der Bayerische Börse AG festgelegt und wird unverändert für die Teilnehmerbanken des MAX-ONE Nachrichtenroutings via FAGSE übernommen.
- Die T7 TVTIC ist nach folgendem Schema aufgebaut:  
Envir\_Flag (1) + SecurityID (20) + TranTime (20) + DealType (1) + MatchStepID (10)

##### Beispiel einer T7 RegulatoryTradeID<sup>1</sup>

'300000000000008917521016969416353791281440000000001'

"3" = on-book XDUS, XHAM, XHAN = immer "3" (Envir\_Flag – 1. Stelle)

"0" = on-book (DealType – 42. Stelle)

Wichtiger Hinweis: Alle TVTIC werden von T7 mit 52 Stellen verarbeitet; die T7 TVTIC selbst ist 52 Stellen lang. Kürzere TVTIC aus MAX-ONE werden zukünftig mit dem Character „0“ (Null) als Suffix aufgefüllt übermittelt. Dies gilt insbesondere für den TradeCaptureReportSNO.

<sup>1</sup> [https://www.cashmarket.deutsche-](https://www.cashmarket.deutsche-boerse.com/resource/blob/4227544/bfff0d13263440b3438f139eed187d0e/data/20251103_ReportingHandbook_RTS24_v4.6.pdf)

[boerse.com/resource/blob/4227544/bfff0d13263440b3438f139eed187d0e/data/20251103\\_ReportingHandbook\\_RTS24\\_v4.6.pdf](https://www.cashmarket.deutsche-boerse.com/resource/blob/4227544/bfff0d13263440b3438f139eed187d0e/data/20251103_ReportingHandbook_RTS24_v4.6.pdf)

#### 1.4.5 T7 Geschäftsnummern

Im Feld (Tag 880 TrdMatchID – Geschäftsnummer) und im Feld (Tag 6555 OrigTrdMatchID – ursprüngliche Geschäftsnummer) wird die Geschäftsnummer aus T7 geliefert.

##### Aussagen zur T7 TradeID:

*“The TradeID field in the T7 Trade Notifications uniquely identifies the order allocation referring to the same match event, instrument and price. The TradeID is unique per product and business day.”*

Die Geschäftsnummer kann eine maximal 10-stellige Nummer\* (Integer) enthalten und wird ohne führende Nullen geliefert.

Eine börsenplatzübergreifende Eindeutigkeit ist durch die Nutzung der Datenfelder Börsenplatz / Börsentag / ISIN / Geschäftsnummer gegeben.

##### Beispiele (schematische Darstellung) der TrdMatchID – Bsp. „T7“ in Mod. Announcement 3 geändert

|        |                  |          |   |
|--------|------------------|----------|---|
| XONTRO | EDH2412050000123 | (bisher) | Börsenplatz(3) + Börsentag(6) + Lfd. Nummer (7) |
|        | EDD2412050000123 | (bisher) | Börsenplatz(3) + Börsentag(6) + Lfd. Nummer (7) |
| T7     | 12345            | (neu)    | Geschäftsnummer (numerisch*)                    |
|        | 7000001          | (neu)    | Geschäftsnummer (numerisch*)                    |

\* Clearstream Banking verarbeitet derzeit maximal 7-stellige Nummern.

#### 1.4.6 Nachbildung der CBF SEME-Referenz

Die Clearstream SEME-Referenz ist zukünftig aus folgenden Datenfeldern abzuleiten:

- SEME Stock Exchange Code: ableiten aus FIX Tag 30 LastMkt (Mapping)
- SEME Date: aus FIX Tag 60 TransactTime
- SEME Trade Number: aus FIX Tag 880 TrdMatchID

| Field Name          | Description  | Lenght | Type         |
|---------------------|--|--------|--------------|
| Leg Type            | A (already matched)<br>D (delivering)<br>R (receiving)   | 1      | Alphanumeric |
| WKN                 | Wertpapierkennnummer   | 6      | Alphanumeric |
| Stock Exchange Code | B = Berlin<br>D = Düsseldorf<br>E = Xetra<br>F = Frankfurt<br>G = Tradegate<br>H = Hamburg<br>I = Hannover<br>M = München<br>S = Stuttgart<br>X = INVESTRO | 1      | Alphanumeric |
| Date                | Input Day (IDAY)*  | 8      | Date         |
| Trade Number        | Trade Number   | 7      | Numeric      |

Quelle SEME-Generator der Clearstream Banking AG.

## **1.5 Allgemeine Hinweise und Änderungen**

### **1.5.1 Geändertes Fehler- und Exception Handling**

Die übermittelten Fehlermeldungen des FAGSE Gateway, des FAGSE Connector (vormals XONTRO) und von MAX-ONE werden unverändert bereitgestellt.

Fehlermeldungen aus T7 werden – unter der TradingSystemID „7“ – im Original bereitgestellt.

- Geänderte Feldbefüllung – Tag 5555 - ReturnCode
- Geänderte Feldbefüllung – Tag 9803 - TradingSystemID

Folgende Systeme bzw. Systemteile werden hierbei unterschieden:

- FAGSE Gateway
- FAGSE Connector
- MAX-ONE
- T7 GSE

### **1.5.2 Geänderte Feldbefüllung UpdateReason**

Das Feld Grund der Orderänderung bzw. Orderlöschung (Tag 5862 - UpdateReason) wird in die nachfolgend aufgeführten Responses aufgenommen.

- RoE-Kapitel 7.2.1.4  
- Response "Execution Report" Nachrichtendaten auf "New Order Single Request"
- RoE-Kapitel 7.2.2.3  
- Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv) auf "Order Cancel Request"
- RoE-Kapitel 7.2.3.3  
- Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv) auf "Order Cancel Replace Request"
- RoE-Kapitel 7.2.6  
- Broadcast "Execution Report" auf Systemgenerierte Orderänderungen und Löschungen
- RoE-Kapitel 10  
- Anhang C: Feldinhalte Tag 5555, Tag 9803

### **1.5.3 Shortcode to Longcode Mapping**

Das Shortcode to Longcode Mapping (Upload- und Report-File) für das Handelssystem T7 ist zukünftig über das bestehende Portal der Deutschen Börse (Common Upload Engine und Common Report Engine) zu prozessieren.

Das Shortcode to Longcode Mapping (Upload- und Report-File) für das Handelssystem MAX-ONE ist zukünftig über das bestehende Portal der Börse München (Secure FTP) zu prozessieren.

#### 1.5.4 Besonderheiten am 24. und 31.12.

Das FAGSE Gateway steht an den bisherigen XONTRO-Abwicklungstagen 24.12., und 31.12. nicht mehr zur Verfügung. Bei Bedarf können OTC-Geschäfte für diese Abwicklungstage am Folgetag unter Rückdatierung des abweichenden Schlusstags eingestellt werden.

#### 1.5.5 Änderungen in den Erweiterungen des 4.2 Sprachgebrauches

Nachfolgende Tags werden gelöscht:

|     |                 |
|-----|-----------------|
| 923 | UserRequestID   |
| 924 | UserRequestType |
| 925 | NewPassword     |
| 926 | UserStatus      |
| 927 | UserStatusText  |

#### 1.5.6 Abweichende Belegungen von Standardtags

Beim MsgTyp (Tag 35) sind die Schlüssel BE und BF nicht mehr zulässig.

#### 1.5.7 Simulationskalender

Der aktuelle Simulationskalender wird auch auf [www.xontro.de/T7-Migration](http://www.xontro.de/T7-Migration) bereitgestellt.

- Sequenz-Nummern in ausgehenden Nachrichten des FAGSE-GWs werden nur an einem „T7 Batch Day“ auf den Initialwert zurückgesetzt.
- Liegen zwischen den definierten T7 Batch Days mehrere Kalendertage, wird an diesen Tagen vom FAGSE GW keine Tagesende-Nachricht verschickt. Das FAGSE GW ist bis zum nächsten „T7 Batch Day“ aktiv.
- Der Schlusstag eines T7 GSE OTC-Geschäftes und das Gültigkeitsdatum einer T7 GSE Ordereinstellung muss mit einem gültigen „Business Day“ des T7 Simulationskalenders belegt werden. Das Settlement Datum eines Geschäftes wird entsprechend ermittelt bzw. geprüft.

XONTRO / Kreditinstitute  
XONTRO / Financial Institutes

FAGSE Modification Announcement 7  
Newsletter 113

Anmerkung: Der T7 „Business Day“ gilt nicht für das Gültigkeitsdatum einer Ordereinstellungen am Handelssystem MAX-ONE der Bayerischen Börse.

| 2026 - Week 4     | Monday       | Tuesday                          | Wednesday     | Thursday      | Friday        | Saturday     | Sunday       |
|-------------------|--------------|----------------------------------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|
| Calendar day      | 19 Jan       | 20 Jan                           | 21 Jan        | 22 Jan        | 23 Jan        | 24 Jan       | 25 Jan       |
| Online time (CET) | 0:00 - 24:00 | 10:00 - 16:00                    | 10:00 - 16:00 | 10:00 - 16:00 | 10:00 - 24:00 | 0:00 - 24:00 | 0:00 - 24:00 |
| Event             | -            | -                                | -             | -             | -             | -            | -            |
| Focus Day         | -            | Matching Engine Processing Delay | -             | -             | -             | -            | -            |
| Batch day         | No           | Yes                              | Yes           | Yes           | No            | No           | No           |
| Business day      | 20 Jan 2026  | 20 Jan 2026                      | 21 Jan 2026   | 22 Jan 2026   | 27 Jan 2026   | 27 Jan 2026  | 27 Jan 2026  |

| 2026 - Week 5     | Monday       | Tuesday  | Wednesday     | Thursday      | Friday        | Saturday     | Sunday       |
|-------------------|--------------|--|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|
| Calendar day      | 26 Jan       | 27 Jan   | 28 Jan        | 29 Jan        | 30 Jan        | 31 Jan       | 01 Feb       |
| Online time (CET) | 0:00 - 24:00 | 10:00 - 16:00  | 10:00 - 16:00 | 10:00 - 16:00 | 10:00 - 24:00 | 0:00 - 24:00 | 0:00 - 24:00 |
| Event             | -            | -  | -             | -             | -             | -            | -            |
| Focus Day         | -            | Matching Engine Failover followed by a Partition Failure | -             | -             | -             | -            | -            |
| Batch day         | No           | Yes  | Yes           | Yes           | No            | No           | No           |
| Business day      | 27 Jan 2026  | 27 Jan 2026  | 28 Jan 2026   | 29 Jan 2026   | 04 Feb 2026   | 04 Feb 2026  | 04 Feb 2026  |

(Beispielwoche aus dem T7 Simulationskalender)

## 2. File-Transfer und Technische Parameter

### 2.1 File-Transfer

File-Historische-Nachrichten (FHN)

Das FHN wird in der bekannten Struktur zunächst weiterhin über den aktuellen Bezugsweg (via HOST Connect:Direct) angeboten.

### 2.2 Technische Parameter

#### 2.2.1 IP Adressen und Port – Simulation

Port: 16558  
Primary-IP: 193.29.94.91  
Secondary-IP: 193.29.94.123

#### 2.2.2 IP Adressen und Port – Produktion

Port: 16058  
Primary-IP: 185.102.253.37  
Secondary-IP: 185.102.253.27

Die jeweiligen SenderCompID ändert sich nicht.

#### **Wichtiger Hinweis:**

Die TargetCompID ist immer statisch (Simulation: „FSRH03I7“ bzw. Produktion: „FSRH03I5“).  
Die TargetCompIDs „FSRH04I7“ und „FSRH04I5“ entfallen.

### 3. T7-GUI

#### Fragen der teilnehmenden Institute:

- **Wie erfolgt der technische Zugriff auf die T7-GUI?**  
Der technische GUI-Zugriff ist beschrieben in der **Deutschen Börse** -Dokumentation „T7 Release 14 - Trader, Admin and Clearer GUI Installation Manual“.  
[https://www.xetra.com/resource/blob/4591770/7d4dc63c960599b1c51e9f8c3f02a02e/data/T7\\_R.14.0\\_Trader\\_Admin\\_Clearer\\_GUI\\_-\\_Installation\\_Manual\\_Version\\_1.pdf](https://www.xetra.com/resource/blob/4591770/7d4dc63c960599b1c51e9f8c3f02a02e/data/T7_R.14.0_Trader_Admin_Clearer_GUI_-_Installation_Manual_Version_1.pdf)
  - T7 GUI Launcher Seite 13
  - T7 GUI Landing Pages Seite 25
- **Welche Funktionalitäten werden via T7-GUI bereitgestellt?**  
In den GUIs sind sämtliche an den Börsenplätzen benötigte Funktionalitäten abrufbar, Details können dem „Trader-, Admin- and Clearer GUI Manual Rel. 14“ entnommen werden.  
[https://www.xetra.com/resource/blob/4591766/6a9c4655c3322d0e475b4fd90c0fc487/data/T7\\_R.14.0\\_Cash\\_Markets\\_Trader\\_Admin\\_and\\_Clearer\\_GUI\\_Manual\\_Version\\_1.pdf](https://www.xetra.com/resource/blob/4591766/6a9c4655c3322d0e475b4fd90c0fc487/data/T7_R.14.0_Cash_Markets_Trader_Admin_and_Clearer_GUI_Manual_Version_1.pdf)  
Nutzbar für die TLN sind das Admin-GUI für den initialen Setup der User (Handel, Backoffice,..) und das Trader GUI für die Nutzung der Funktionalitäten.
- **Kann der OTC-Trade-Upload separat berechtigt werden?**  
Die bestehenden Berechtigungsmöglichkeiten der T7 GUIs sind im „Participant & User Manual“ näher beschrieben.  
[www.xetra.com/resource/blob/4156896/61e2e29f08a63ff88d20ee30c4dc2049/data/T7\\_R.13.1\\_Derivatives\\_Market\\_-\\_Participant\\_and\\_User\\_Maintenance\\_Manual\\_Version\\_1.pdf](http://www.xetra.com/resource/blob/4156896/61e2e29f08a63ff88d20ee30c4dc2049/data/T7_R.13.1_Derivatives_Market_-_Participant_and_User_Maintenance_Manual_Version_1.pdf)  
Kreditinstitute können ihren Nutzern die Berechtigung der neu geschaffenen Funktionalität „OTC-Trade-Upload“ individuell zuordnen.
- **Braucht ein BackOffice Mitarbeiter eine Händlerzulassung für die Eingabe von OTC-Geschäften via T7-GUI?**  
Gemäß den Regularien der jeweiligen Börse ist zur Eingabe von OTC/PÜEV-Geschäften via „OTC-Trade-Upload-Request“ keine dedizierte Händlerzulassung erforderlich.
- **Welche generelle Timeline besteht im Rahmen des Onboardings? (ab Rücksendung Member SetUp-Sheet, ...)**  
Die Deutschen Börse benötigt einen Vorlauf von ca. 4 Wochen für den technischen und funktionalen Setup in Simulation und Produktion.  
Das Onboarding für die Pre-Launch Simulation startet, sobald das Environment technisch zur Verfügung steht und die TLN-Stammdaten vorliegen.
- **Wann werden Schulungen für T7-GUI und SetUp-Prozess angeboten?**  
Nach derzeitigem Stand ist geplant, die Deutsche Börse-Schulungen der Teilnehmer vorrausichtlich in der KW34 oder KW35 2025 durchzuführen. Die genauen Termine werden in den nächsten Wochen festgelegt und an die TLN kommuniziert.

#### 4. Zeitplanung

Derzeit gehen wir von folgendem indikativen Zeitplan aus:

- ab 12/2024 Bereitstellung FAGSE Modification Announcement (kontinuierliche Überarbeitungen und Veröffentlichungen)
- ab 02/2025 Bereitstellung FAGSE Schnittstellendokumentation (RoE) (kontinuierliche Überarbeitungen und Veröffentlichungen)
- 06/2025 TLN-Setup (Rücksendung der Member Setup Sheets)
- 01.09.2025 T7 Simulation Rel. 14
- 10.09.2025 T7 Simulation Rel. 14 – OTC/PÜEV – XFRA (ETI/GUI)
- 10.09.2025 T7 Simulation Rel. 14 – GSE-Märkte – XDUS, XHAM, XHAN (ETI/GUI)
- ab 10.11.2025 T7 Simulation Rel. 14 – FAGSE-Gateway (Beta) - Connection Test
- ab 12/2025 T7 Simulation Rel. 14 – FAGSE-Gateway (Beta) - Funktionale Simulation
- 15.01.2026 T7 Simulation Rel. 14 – MAX-ONE via FAGSE-Gateway
- 15.01.2026 T7 Simulation Rel. 14 – FAGSE-Gateway (Rel. 1.0)
- 22.06.2026 Produktionsstart/Migrationstermin (big bang)

Details sind bitte dem aktuellen Dokument „FAGSE Member-Simulation Information“ auf [www.xontro.de](http://www.xontro.de) zu entnehmen.

## 5. Ansprechpartner

### BrainTrade

Sämtliche Rückfragen richten Sie bitte an Ihre bekannten BrainTrade-Ansprechpartner unter:

E-Mail: [trade\(at\)xontro.de](mailto:trade@xontro.de) bzw.

Telefon: +49 - (0)69 - 58 99 78 - 110

BrainTrade - Helpline - +49-69-589978-110

ist verantwortlich für die Einrichtung und funktionale Betreuung des FAGSE-Gateways

### Provider Deutsche Börse\*

Deutsche Börse - Member Section - +49-69-211-17888

steht den GSE-Teilnehmern für allgemeine Fragen zur Einrichtung und Nutzung der Member-Section zur Verfügung

Deutsche Börse - Customer Technical Support - +49-69-211-10888

ist verantwortlich für den technischen Support der Teilnehmer mit Bezug auf ETI und Web-GUIs bzw. die Einrichtung der Common Report- (CRE) und Common Upload Engine (CUE)

\* Die Helplines des Providers Deutsche Börse können erst nach dem erfolgreichen Absolvieren des technischen Setup-Prozesses (via Rückgabe BrainTrade Member-Setup-Sheet) kontaktiert werden.

## 6. Dokumentation des Deutsche Börse T7-Systems

Die aktuelle T7-Dokumentation der Deutsche Börse AG kann auf ihrer Homepage ([www.xetra.com](http://www.xetra.com)) abgerufen werden. Darüber hinaus werden ausgewählte Links zu relevanten Deutsche Börse T7 Dokumenten zusätzlich auch auf der BrainTrade Homepage im Menü-Punkt „T7 Migration“ aufgeführt; die BrainTrade-Angaben erfolgen ohne Gewähr.