



FAGSE BT-FIX Gateway

6. Modification Announcement zu
XONTRO Release 33

Stand: 01.08.2019

Version 2.3.7

BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH	
XONTRO FAGSE BT-FIX Gateway Modification Announcement zu XONTRO Release 33	RoE Version 2.3.7 01.08.2019 Seite 2

Inhalt

1	Einleitung.....	3
2	Zusammenfassung der fachlichen Änderungen und Erweiterungen	4
3	Technische Änderungen und Erweiterungen.....	5
4	Fachlicher und Technischer Support	8
4.1	BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH	8
4.2	Deutsche Börse AG.....	8

BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH	
XONTRO FAGSE BT-FIX Gateway Modification Announcement zu XONTRO Release 33	RoE Version 2.3.7 01.08.2019 Seite 3

1 Einleitung

Das vorliegende Dokument informiert die Nutzer des XONTRO FAGSE BT-FIX Gateways über die im XONTRO Release 33 geplanten relevanten Neuerungen und Modifikationen.

Dabei werden die technischen und fachlichen Änderungen und Erweiterungen sowie die Modifikationen der Rules of Engagement dargestellt.

In komprimierter Form soll damit dem FIX Teilnehmer die Möglichkeit gegeben werden, die Änderungen zu beurteilen.

Das Dokument ist **das sechste Modification Announcement zur RoE Version 2.3.7.**

Am 05.07.2019 endet die Simulation von XONTRO RoE Version 2.3.6.

Der Einsatz der Anpassungen im Simulationssystem erfolgt am 08.07.2019.

Der Einsatz der Anpassungen im Produktionssystem erfolgt voraussichtlich am **19.08.2019.**

Das Dokument ist in die folgenden Abschnitte gegliedert:

- Zusammenfassung der Änderungen und Erweiterungen
- Fachlicher und Technischer Support

BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH	
XONTRO FAGSE BT-FIX Gateway Modification Announcement zu XONTRO Release 33	RoE Version 2.3.7 01.08.2019 Seite 4

2 Zusammenfassung der fachlichen Änderungen und Erweiterungen

Folgende fachliche Änderungen und Erweiterungen sind in der RoE 2.3.7 zum XONTRO Release 33 enthalten:

- Randbedingungen
- Anpassung der Beschreibung zu TAG 97, 283 und 2376
- Erweiterung um Regulatory TradeID Repeating Group

BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH	
XONTRO FAGSE BT-FIX Gateway Modification Announcement zu XONTRO Release 33	RoE Version 2.3.7 01.08.2019 Seite 5

3 Technische Änderungen und Erweiterungen

Änderungen zum 19.08.2019 (Kapitelnummerierungen gem. RoE Version 2.3.7)

2.1 Protokollversion

Unterstützt werden die FIX Protokoll Versionen V4.2 und V4.4. Die beschriebenen Nachrichtenstrukturen enthalten zum Teil relativ umfangreiche Erweiterungen der Versionen. Zusätzlich notwendige Tags werden ebenso wie die Erweiterungen der Wertebereiche bestehender Tags soweit möglich einer der nächsten Versionen des FIX Protokolls – bis einschließlich V5.0 SP2 - entnommen . Ist dies nicht möglich, werden registrierte, benutzerdefinierte Tags herangezogen. ~~Individuelle Tag Definitionen (Tags >10000) werden nicht verwendet.~~

4.2 FIX Header <standard message header>

Eingehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
97	PossResendFlag	O	O	Boolean Die sendende Applikation zeigt bei auf „Y“ gesetztem Flag an, dass die Nachricht ggf. mit anderer Sequenznummer schon einmal übertragen wurde. Muss von Applikation überprüft werden. Diese Funktionalität wird nicht in vollem Umfang unterstützt: Das BT-FIX-Gateway erlaubt das PossResend nur für NewOrderSingle. Wenn der Request mit derselben ClOrderID bereits einmal empfangen wurde, dann wird der bereits versendete ExecutionReport bzw. Reject nochmals an den Client übertragen, ansonsten wird der Request nicht verarbeitet, sondern mit einem Reject beantwortet.

Ausgehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
97	PossResendFlag	O	O	Boolean Das BT-FIX Gateway zeigt bei auf „Y“ gesetztem Flag an, dass die Nachricht ggf. mit anderer Sequenznummer schon einmal übertragen wurde. Das Feld muss von der empfangenden Applikation überprüft werden

BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH	
XONTRO FAGSE BT-FIX Gateway Modification Announcement zu XONTRO Release 33	RoE Version 2.3.7 01.08.2019 Seite 6

7.2.7.2 Party Konzept <parties>

Eingehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
2376	PartyIDRoleQualifier	O	M	NNOON	<p>Integer</p> <p>Die Angabe dieses Qualifiers ist nur notwendig, wenn „PartyID“ einen Algorithmus (22) darstellt und keinen Shortcode (Default). Die Differenzierung eines Shortcodes als LEI (23) oder nat. Person (24) ist nicht notwendig und wird ignoriert.</p> <p>22 = „Algorithmus“ Kennzeichnet die PartyID als Algorithmus. Nur erlaubt für PartyRoles 12 = "Execution within Firm" 122 = "Investment Decision Maker"</p> <p>23 = „LEI (Legal Entity Identifier)“ Kennzeichnet die PartyID als Shortcode für einen LEI Nur erlaubt für PartyRole 3 = "Client Identification Code"</p> <p>24 = „Nat. Person“ Kennzeichnet die PartyID als Shortcode für eine natürliche Person Nur erlaubt für PartyRoles 3 = "Client Identification Code" 12 = "Execution within Firm" 122 = "Investment Decision Maker"</p>

7.2.7.6 Regulatory TradeID Repeating Group <RegulatoryTradeIDGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
<u>1907</u>	<u>NoRegulatoryTradeID</u>	<u>O</u>	<u>O</u>		<u>NumInGroup</u> <u>Nur der Wert 1 ist zulässig.</u>
<u>1903</u>	<u>RegulatoryTradeID</u>	<u>O</u>	<u>O</u>		<u>String(52)</u> <u>TVTIC (Trading venue transaction identifier)</u> <u>Der TVTIC setzt sich zusammen aus:</u> <u>Segment MIC (4 Stellen) + ISIN (12 Stellen) +</u> <u>Börsentag (8 Stellen) + Zeit Kursbestätigung (12</u> <u>Stellen)</u>
<u>1906</u>	<u>RegulatoryTradeIDType</u>	<u>O</u>	<u>O</u>		<u>Integer</u> <u>Art der Regulatory TradeID</u> <u>5 = TVTIC (Trading venue transaction identifier)</u>

BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH	
XONTRO FAGSE BT-FIX Gateway Modification Announcement zu XONTRO Release 33	RoE Version 2.3.7 01.08.2019 Seite 7

7.5.5.1 Geschäftsinformation "TradeCaptureReportSno"

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
283	LocationID	O	M	String Börsenplatz des Meldewesens Wird als FIX-Data-Type Exchange geliefert. Xontro-Börsen "XQTS" = Quotrix "XBER" = Berlin "XDUS" = Duesseldorf "XETR" = Xetra "XFRA" = Frankfurt "XHAM" = Hamburg "XHAN" = Hannover "XINV" = Investro Abwicklungssystem "XMUN" = Muenchen "XSTU" = Stuttgart <u>Nicht-Xontro-Börsen</u> "BAAD" = Unterschleißheim - Baader Bank "BMTF" = London - Bloomberg Trading Facility "BTFE" = Amsterdam - Bloomberg Trading Facility "CATS" = Stuttgart - cats "EUWA" = Stuttgart - EUWAX AG "HAML" = Hamburg - Hanseatische Wertpapierbörse Hamburg - Lang & Schwarz Exchange "LSSI" = Düsseldorf - Lang & Schwarz - Wertpapierhandel "MAEL" = London - MarketAxess Europe "TGAT" = Berlin - Tradegate Exchange "TOEX" = Amsterdam - Turquoise Europe "TRFU" = London - Tradeweb Europe "TRQX" = London - Turquoise "XEQT" = Berlin - Börse Berlin Equiduct Trading "XMUN" = München - Börse München - gettex "XQTX" = Düsseldorf - Börse Düsseldorf - Quotrix "XSTF" = Stuttgart - Baden-Württembergische Wertpapierbörse - Technical Platform 2 "XSTU" = Stuttgart - Baden-Württembergische Wertpapierbörse

BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH	
XONTRO FAGSE BT-FIX Gateway Modification Announcement zu XONTRO Release 33	RoE Version 2.3.7 01.08.2019 Seite 8

4 Fachlicher und Technischer Support

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

4.1 BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH

Aufgaben: Beratung und Support der Teilnehmer in allen **fachlichen** Fragestellungen.
 Fachliche Betreuung der Simulationen und des Produktionsbetriebes.
 Bereitstellung von Dokumentationen.
 Durchführung von Schulungen.

Telefon: +49 (69) – 58 99 78 – 120

Fax: +49 (69) – 211 – 60 80 52

E-Mail: saki@xontro.de

Internet: www.xontro.de

Erreichbarkeit: 07.30 bis 20.40 Uhr (börsentäglich)

4.2 Deutsche Börse AG

Aufgaben: Beratung und Support der Teilnehmer in allen **technischen** Fragestellungen.
 Technische Betreuung bei Fragen des Netzwerkes, und des Back End Betriebes.

Telefon: +49 (69) – 211 – 1 12 81

Fax: +49 (69) – 211 – 1 10 01

Erreichbarkeit: 06.00 bis 22.00 Uhr (börsentäglich)