FAGSE BT-FIX Gateway

Rules of Engagement

Dokument:	v300_RoE BT-FIX Gateway.docx
Version:	3.0.0
Letzte Änderung:	24.02.2025
Produktiv ab:	
Test ab:	

Verwandte Dokumente

~~XONTRO~~

~~[1] Kreditinstitute - Technische Anbindung, Release 5.2~~
~~[2] Systemanschluss Makler XONTRO VALUES API, Release 30~~

FIX

~~[3]~~[1] FIX protocol limited: FIX Documentation Version 4.4 with Errata 20030618, Volumes 1-7 vom 18.6.2003
~~[4]~~[2] FIX protocol limited: FIX Documentation Version 4.2 with Errata 20010501 vom 1.5.2001
~~[5]~~[3] FIX protocol limited: Exchanges / ECN Working Group Recommended Best Practices Phase 1 January 25, 2007

Webseiten

www.xontro.de

www.deutsche-boerse.com

www.fixprotocol.org

Inhaltsverzeichnis

1 Einleitung 6
1.1 Abkürzungen und Definitionen 7

2 Randbedingungen 8
2.1 Protokollversionen 8
2.2 Clients und OMS 8
2.3 Security 9
2.4 Zielsysteme 9
2.5 Instrumente 10
2.6 Konkurrenzen mit anderen Interfaces der Zielsysteme 10
2.7 Umsetzung der MiFID II Anforderungen 11
2.7.1 Versorgung der MiFID II Datenfelder 11
2.7.2 Shortcode-Verfahren 11
2.8 Order-Funktionalität 12
2.8.1 Orderidentifikation 12
2.8.2 Empfehlungen 12
2.8.3 Besonderheiten bei der Behandlung bestimmter Requests 13
2.9 Trade-Funktionalität 14
2.9.1 Unterstützte Nachrichten 14
2.9.2 Tradeidentifikation 14
2.10 Reject Verhalten 15
2.11 Verhalten bei ResendRequest 15
2.12 Inbetriebnahme 15

3 Leistungsmerkmale 16
3.1 Eingehende und Ausgehende Nachrichten 16
3.2 Szenarien und Nachrichten des Sessionlevels 17
3.2.1 Verarbeitung FIX-Requests 17
3.2.2 Systemgenerierte Nachrichten 17
3.3 Szenarien und Nachrichten des Applikationslevels 18
3.3.1 Verarbeitung FIX-Requests 18
3.3.2 Externe Eingaben / systemgenerierte Nachrichten 18
3.4 Unterschiede zwischen FIX 4.2 und FIX 4.4 20
3.4.1 Orderrouting 20
3.4.2 Passwortänderung 21
3.4.3 Trade-Nachrichten 21

4 FIX-Nachrichten, Detailbeschreibung zu Header/Trailer 22
4.1 Erläuterungen FIX Header/Trailer 22
4.2 FIX Header <standard message header> 23
4.3 FIX Trailer <standard message trailer> 24

5 FIX-Nachrichten des Sessionlevels 25
5.1 Erläuterungen FIX Datenteil 25
5.2 Logon / Logon mit gleichzeitiger Passwortänderung 26
5.3 Passwortänderung 28
5.4 Logout 29
5.5 System Shutdown 30

6 FIX-Nachrichten vom Typ Reject und Business Message Reject 31

7 FIX-Nachrichten des Applicationlevels 32
7.1 Erläuterungen FIX Datenteil 32
7.2 Orderfunktionalität 33
7.2.1 Ordereinstellung 33
7.2.1.1 Abläufe – Orders 33
7.2.1.2 Request "NewOrderSingle" 34
7.2.1.3 Response "Execution Report" - Identifikationskriterien 42
7.2.1.4 Response "Execution Report" - Nachrichtendaten 43
7.2.2 Orderlöschung 48
7.2.2.1 Abläufe – Orders 48
7.2.2.2 Request "Order Cancel Request" 52
7.2.2.3 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv) 55
7.2.2.4 Response "Order Cancel Reject" (endgültig negativ) 58
7.2.3 Orderänderung 59
7.2.3.1 Abläufe – Orders 59
7.2.3.2 Request "Order Cancel Replace Request" 61
7.2.3.3 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv) 64
7.2.3.4 Response "Order Cancel Reject" (endgültig negativ) 67
7.2.4 Orderausführung 68
7.2.4.1 Abläufe – Orders 68
7.2.4.2 Nachricht zur Orderausführung "Execution Report" 70
7.2.5 Auslösung einer Aktion über ein anderes Interface 74
7.2.5.1 Einstellungen, Änderungen und Löschungen von Orders bzw. Aufträgen 74
7.2.5.2 Umsetzung einer Stop Order 76
7.2.5.3 Aktivierung einer EG-Order 77
7.2.6 Systemgenerierte Orderänderungen und Löschungen 77
7.2.7 Componenten Blocks und Repeating Groups 80
7.2.7.1 Instrument Component Block <instrument> 80
7.2.7.2 Party Konzept <parties> 81
7.2.7.3 Trading Sessions Repeating Group <trading sessions> 83
7.2.7.4 Order Attribute Repeating Group <OrderAttributes> 85
7.2.7.5 Value Checks Repeating Group <ValueChecksGrp> 85
7.2.7.6 Regulatory TradeID Repeating Group <RegulatoryTradeIDGrp> 86
7.2.8 Besonderheiten der Tag Behandlung 86
7.3 Ereignisse 89
7.3.1 Abläufe 89
7.3.2 Ereignismitteilung "News" 89
7.3.3 NoLinesOfText Repeating Group <LinesOfTextGrp> 89
7.3.4 NoRelatedSym Repeating Group <InstrmtGrp> 90
7.3.5 NoRoutingIDs Repeating Group <RoutingGrp> 90
7.4 Tradefunktionalität 91
7.4.1 Unterstützte Vorfälle 91
7.4.2 Abläufe 92
7.4.3 OTC-Geschäfte - Requests 92
7.4.3.1 Request "TradeCaptureReport" - Identifikationskriterien 92
7.4.3.2 Request "TradeCaptureReport" - Nachrichtendaten 93
7.4.3.3 Instrument Component Block <instrument>Instrument Component Block <instrument> 95
7.4.3.4 NoTrdRegTimestamps Repeating Group <TrdRegTimestamps> 96
7.4.3.5 NoTransactionCosts Repeating Group <courtage> 96
7.4.3.6 NoSides Repeating Group <TrdCaptRptSideGrp> 97
7.4.3.7 Party Konzept <parties> 101

7.4.4 OTC-Geschäfte - Responses ... 102
7.4.4.1 Response "TradeCaptureReportAck" - Identifikationskriterien ... 102
7.4.4.2 Response "TradeCaptureReportAck" - Nachrichtendaten ... 103
7.4.4.3 Instrument Component Block <instrument> ... 104
7.4.5 Schlussnoten-Realtime ... 105
7.4.5.1 Geschäftsinformation "TradeCaptureReportSno" ... 106
7.4.5.2 Instrument Component Block <instrument> ... 109
7.4.5.3 NoSecAltID Repeating Group <SecAltIDGrp> ... 110
7.4.5.4 NoTrdRegTimestamps Repeating Group <TrdRegTimestamps> ... 110
7.4.5.5 NoMiscFees Repeating Group <gebühren> ... 110
7.4.5.6 NoTransactionCosts Repeating Group <courtage> ... 111
7.4.5.7 NoSides Repeating Group <SnoRealtimeSideGrp> ... 111
7.4.5.8 Party Konzept <parties> ... 114
7.4.5.9 NoPartySubIDs Repeating Group <PtysSubGrp> ... 115
7.4.5.10 Regulatory TradeID Repeating Group <RegulatoryTradeIDGrp> ... 116

8 Anhang A: Aktuelle Beispiele werden zu einem späteren Zeitpunkt veröffentlicht 117

9 Anhang B: Einschränkungen von Formaten und Strukturen ... 119

10 Anhang C: Benutzerdefinierte Tags ... 121

11 Anhang D: Erweiterungen des 4.2 Sprachumfangs ... 129

12 Anhang E: Erweiterungen des 4.4 Sprachumfangs ... 131

13 Anhang F: Abweichende Belegungen von Standardtags ... 132

14 Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart) ... 139

1 Einleitung

Dieses Dokument beschreibt die Implementation des FIX Protokolls der Versionen 4.2 und 4.4 im BT-FIX Gateway für

- das Orderrouting zu den Handelssystemen T7 GSE (German Stock Exchanges)~~XONTRO~~ und~~,~~ MAX-ONE~~, Xetra und Xetra Ffm-2~~,
- ~~die Auftragsverarbeitung in den Fonds-Abwicklungssystemen INVESTRO und Vestima,~~
- die Tradeverarbeitung in dem Handelssystem ~~XONTRO~~T7 GSE.

~~Im vorliegenden Dokument, ist der Begriff Order(s) im Zusammenhang mit Investro / Vestima immer als Auftrag oder Aufträge zu verstehen.~~
~~Gleiches gilt für die Verwendung des Begriffs 'Handelssystem'. Dies ist im gleichen Zusammenhang immer als Abwicklungssystem zu verstehen.~~

Das Dokument erläutert Voraussetzungen, Randbedingungen und den Message Flow. Das Dokument richtet sich an Kunden, welche dieses Interface für Orderrouting/~~Auftragsverarbeitung/~~Tradeverarbeitung an die genannten Handelssysteme nutzen wollen.

Die folgende Darstellung erläutert den Zusammenhang zwischen den beteiligten Systemen

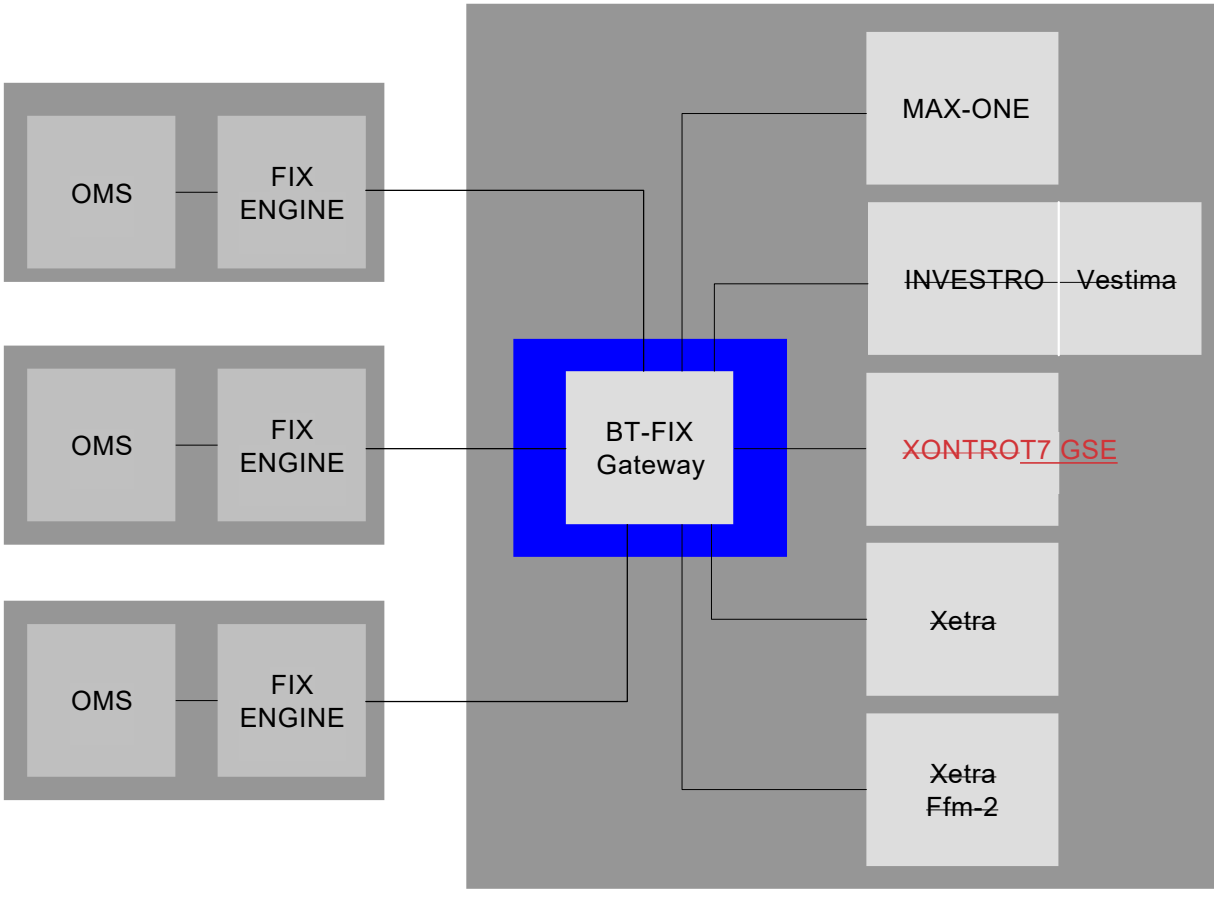

Abbildung 1-1: Systemüberblick

1.1 Abkürzungen und Definitionen

Item	Beschreibung
FAGSE	Als Produktname verwendetes Akronym für die Anwendung, die sich aus dem BT-FIX Gateway und dem BT-FIX Connector zusammensetzt. (FIX Access for German Stock Exchanges)
FIX	Das FIX-Protokoll ist ein offener Standard zum Austausch von Informationen, welcher von Banken, Brokern, Börsen und sonstigen Dienstleistern geschaffen wurde. FIX steht dabei für **F**inancial **I**nformation e**X**change. Durch die Verwendung eines gemeinsamen Standards wird der Austausch von Informationen zwischen den Anwendungen der verschiedenen Hersteller erheblich vereinfacht.
MAX-ONE	Das elektronische Handelssystem der Börse München.
RoE	Abkürzung für Rules of Engagement. Eine vertragliche Vereinbarung zwischen Institutionen, in denen die spezifischen Regeln für die FIX Kommunikation zwischen den FIX Anwendungen beider Partner festgelegt sind. In ihnen werden u.a. folgende Dinge geregelt: Netzwerk-Anbindung, Identifizierung der Kommunikationspartner, Nachrichtenverschlüsselung, Behandlung doppelter Nachrichten, unterstützte Nachrichtentypen.
TCP/IP	Transmission Control Protocol / Internet Protocol (TCP/IP). FIX setzt als Kommunikations-Protokoll die Verwendung von TCP/IP voraus.
~~OHA~~	~~Order handling agent Vestima: Order-Empfänger in Vestima.~~
OMS	Order Management System (Kunde).
T7 GSE	Handelssystem T7 German Stock Exchanges (ersetzt den Begriff XONTRO)

2 Randbedingungen

2.1 Protokollversionen

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[1]. Ist dies nicht möglich, werden registrierte, benutzerdefinierte Tags herangezogen.

FIXML wird nicht unterstützt.

Als technische Anbindung wird die der FIX Versionen 4.x verwendet, es sind also nur Standard TCP/IP Anbindungen möglich.

2.2 Clients und OMS

Als Client (oder FIX Client) wird die FIX Engine eines Anschlussinhabers (Kunden) bezeichnet. Clients werden über CompIDs identifiziert, welche mit der BrainTrade GmbH zu vereinbaren sind.

Der Kunde kann die Rechnerkonstellation seiner FIX Engine aus Gründen der Ausfallsicherheit redundant auslegen. Dabei sind sowohl Clusterlösungen als auch stand-alone Lösungen möglich.

Der Kunde muss eine der folgenden Konfigurationsvarianten unterstützen. In allen Varianten wird auf Kundenseite nur eine SenderCompID verwendet.

1. Die FIX Engine wird redundant auf mehreren Rechnern eines Clusters betrieben. Die Implementation der FIX Engine unterstützt den Cluster Failover. Sessions werden automatisch fortgeführt.
2. Die FIX Engine wird redundant auf mehreren Rechnern betrieben. Der Failover erfolgt manuell. Die für einen Failover erforderlichen Informationen (Sequenznummern, gesendete Nachrichten, etc.) werden in einem gemeinsam genutzten SAN-Speicher gehalten. Nach einem Failover kann die neue Instanz der FIX Engine die Session fortsetzen.
3. Die FIX Engine wird redundant auf mehreren Rechnern betrieben. Ein gemeinsamer SAN-Speicher ist nicht vorgesehen. Der Failover erfolgt manuell. Nach dem Start der Session ist der Logon mit einer Message Sequence Number zu versenden, welche sicher über der letzten versendeten liegt (administrative Vorgabe der Message Sequence Number). Die FIX Engine des Kunden muss darauf eingestellt sein, den folgenden Resend Request des FAGSE BT-FIX Gateway mit einer Reset Nachricht mit Gapfill so zu beantworten, dass die Lücke geschlossen wird. Danach kann die Session fortgesetzt werden.
4. Eine zweite IP-Adresse steht für den Fall eines Failovers für Reconnection und FIX-Session Logon zur Verfügung. Es kann nur eine Verbindung/IP-Adresse zu einem Zeitpunkt verwendet werden.

Das BT-FIX Gateway wird ebenfalls über eine CompID identifiziert, welche von der BrainTrade GmbH vergeben wird.

[1] Nachrichtenformate der Version 4.2 werden um Definitionen der Versionen 4.4 und 5.0, Nachrichtenformate der Version 4.4 um Definitionen der Version 5.0 erweitert, siehe hierzu: Anhang D: Erweiterungen des 4.2 Sprachumfangs und Anhang E: Erweiterungen des 4.4 Sprachumfangs.

Die Anbindung erfolgt über eine oder zwei Standleitungen, das Protokoll ist TCP/IP[2].

FIX Sessions werden immer von der FIX Engine des Kunden aufgebaut.

Ein Client muss zunächst entweder FIX 4.2 oder FIX 4.4 nutzen und zusätzlich die definierten Restriktionen (des vorliegenden Dokuments) einhalten.

Das OMS kann sowohl von einem bestimmten Kunden als auch von einem Provider für mehrere Kunden betrieben werden. Für einen einzelnen Kunden sind die vom Systemanschluss Kreditinstitute bekannten Zentral/Filialkonstruktionen möglich.

Für den Anschlussinhaber und alle Teilnehmer, die einen konkreten Anschluss nutzen wollen, sind zulässige KV-Nummern erforderlich, welche zusätzlich für das FIX Interface berechtigt werden müssen, siehe Kapitel 2.3 Security.

2.3 Security

Das BT-FIX Gateway unterstützt ~~keine~~ TLS-Verschlüsselung 1.3 auf FIX-Level.

Auf Netzwerkebene kann die Verbindung vom Router des Kunden bis zum Router des Betreibers des BT-FIX Gateway in Absprache zwischen dem Betreiber des BT-FIX Gateway und dem Kunden über IPSec abgesichert werden.

Die FIX Engines auf beiden Seiten der Verbindung werden über die Tags SenderCompID bzw. TargetCompID identifiziert.

Jeder FIX Anschlussinhaber muss sicherstellen, dass nur Requests mit der vereinbarten SenderCompID abgesetzt werden.

Requests mit einer falschen SenderCompID werden abgelehnt.

Nach einem erfolgreichen Logon werden Requests mit falscher SenderCompID als Attacke gewertet. In diesem Fall wird die Session ausgeloggt.

Ein Anschlussinhaber muss über eine zulässige KV-Nummer (FIX-Zentrale) verfügen, welche für den FIX Anschluss freigegeben sein muss. Sollen über den Anschluss weitere konfigurierte KV-Nummern möglich sein, dann müssen auch diese gültig und für den FIX Anschluss freigegeben sein.

Das BT-FIX Gateway unterstützt die gängigen Retransmit Mechanismen (Duplicate und Resend).

2.4 Zielsysteme

Unterstützt werden die Handelssysteme

- ~~XONTRO~~T7 GSE
- MAX-ONE

~~XETRA (XETR)**~~

- ~~Xetra Ffm-2 (XFRA)**~~

[2] Es ist zunächst keine Unterstützung von Version 5.0 und damit auch keine Unterstützung von FIXT vorgesehen.

~~** Das XONTRO FIX Orderrouting zu den XETRA Plattformen endet nach Aussagen der Deutsche Börse AG in 2017. Daher werden innerhalb dieser Strukturen keine MiFID II Anpassungen mehr vorgenommen.~~

~~Unterstützt werden die Abwicklungssysteme~~

- ~~INVESTRO / Vestima~~

2.5 Instrumente

Es bestehen keinerlei Einschränkungen hinsichtlich der Instrumente eines Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systems.
Zur Instrumentidentifikation wird ausschließlich die ISIN verwendet. Alle anderen Möglichkeiten der Identifikation sind ausgeschlossen.

Das mandatory Tag 55 (Symbol) wird vom BT-FIX-Gateway beim Request ignoriert. Bei ausgehenden Nachrichten enthält das Tag 55 "[N/A]" (undefiniert).
Die einzige Ausnahme sind die Nachrichten zu den Schlussnoten-Realtime (UserMessage TradeCaptureReportSno). Bei diesen enthält das Tag 55 ein Börsenkürzel (sofern vorhanden) oder den Wert "[N/A]".

2.6 Konkurrenzen mit anderen Interfaces der Zielsysteme

Der FIX-Zugang ~~und der (~~Systemanschluss Kreditinstitute ~~(~~SAKI) biete~~tn~~ grundsätzlich die gleiche Funktionalität an. Diese Funktionalität ist in die folgenden Bereiche unterteilt:

- Orderrouting
- OTC- ~~und MiFID-~~Eingaben
- Bezug von Schlussnoten-Realtime

~~Die gleichzeitige Verwendung beider Anschlussarten ist generell möglich, jedoch mit folgender Einschränkung: in jedem der genannten Bereiche kann für eine KV-Nummer entweder nur der FIX-Zugang oder nur der SAKI-Zugang benutzt werden. Dies gilt für die Zentralen (bzw. Anschlussinhaber) und für die Filialen.~~

Beispiel einer möglichen Konfiguration für die KV-Nummer 1766:
- Orderrouting über den ~~SAKI~~FIX-Anschluss der Zentrale 7066
- OTC- ~~und MiFID-~~Eingaben über den FIX-Anschluss der Zentrale 3766
- Bezug von Schlussnoten-Realtime über den FIX-Anschluss der Zentrale 3766

~~Andere~~ Die Interfaces (z.Bsp: ~~Dialogeingabe~~ T7 GUI, ~~XONTRO~~T7 GSE~~, VALUES~~) können uneingeschränkt genutzt werden. Dabei erhält das FIX Interface auch Nachrichten, welche über andere zulässige Wege ausgelöst wurden. ~~Für die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 kann die Möglichkeit der Bearbeitung von Orders über mehrere Interfaces (FIX und das VALUES Interface) durch die Verwendung unterschiedlicher Subgroups weitgehend eingeschränkt werden.~~

~~Der Empfang von Broadcastnachrichten über das VALUES Interface kann für ein Member generell nicht eingeschränkt werden.~~

2.7 Umsetzung der MiFID II Anforderungen

Beginnend mit Version 2.3.2 dieses Dokumentes wurden die Anforderungen des MiFID II Regelwerkes implementiert. In diesem Zusammenhang möchten wir auf die im folgenden genannten Bereiche besonders hinweisen.

2.7.1 Versorgung der MiFID II Datenfelder

Eingabefelder, die in direktem Zusammenhang mit der Umsetzung der MiFID II Regulatorik stehen, sind bei ihrer ersten Erwähnung im Dokument gesondert gekennzeichnet.

Hier ein Beispiel für eine solche Kennzeichnung: „(ESMA RTS24 Feld 3)“

Sollten bei der Verwendung solcher Tags Unklarheiten bestehen, so verweisen wir auf die entsprechenden Dokumentationen der zuständigen Regulierungsbehörde.

2.7.2 Shortcode-Verfahren

Shortcode-Daten dienen der Kapselung im Rahmen der MiFID II an die Handelsplätze zu übermittelnden Identifikationen von Parteien.

Das Shortcode-Verfahren ist innerhalb von ~~XONTRO~~T7 GSE nur für die Teilnehmer des FIX-Orderroutings relevant.

Als maßgeblich für die Übergabe der gesichert zu übertragenden Shortcode-Files werden sämtliche Inhalte (gem. MiFID II Vorgaben) der Datenfelder <client identification code>, <investment decision maker> und <Execution within firm> angesehen. Hierbei handelt es sich im Wesentlichen um personenbezogene Legitimationsdaten.

Das Shortcode to Longcode Mapping (Upload- und Report-File) für das Handelssystem T7 ist über das bestehende Portal der DBAG (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.

~~Der Shortcode ist ein numerisches Datenfeld.~~

~~Im Regelfall gehen wir von einer täglich einmaligen Datenübertragung aller verwendeten Shortcodes pro Teilnehmer (bzw. pro technischer Zentrale) per Komma separiertem CSV-File(s) mit einer Überschriftszeile aus.~~

~~Die übermittelten Files werden periodisch per Batch-Verarbeitung in die XONTRO Geschäfts-vorfalldokumentation übernommen, separat gespeichert und erst auf Anforderung an die CAs übermittelt. Im Rahmen dieses Prozesses erhalten die übermittelnden Institute qualifizierte Antwortfiles.~~

~~Teilnehmer des Handelssystems Max-ONE via XONTRO SAKI-FIX versenden ihre Max-ONE Shortcode-Informationen ebenfalls über die XONTRO-Infrastruktur. Dabei können XONTRO und Max-ONE Shortcode-Informationen in einem gemeinsamen File übertragen werden.~~

~~Weitere Details zum Shortcode Verfahren können dem XONTRO MiFID Newsletter 03 entnommen werden, dessen Bereitstellung für Ende Juni 2017 geplant ist.~~

2.8 Order~~- bzw. Auftrags~~-Funktionalität

2.8.1 Orderidentifikation

Das BT-FIX Gateway unterstützt zunächst uneingeschränkt den bekannten FIX Chaining Mechanismus mit Hilfe der ClOrdID bzw. der OrigClOrdID, die Eindeutigkeit der ClOrdID während der Lebensdauer einer Order wird vom BT-FIX Gateway geprüft. Ist eine ClOrdID bereits vorhanden, dann wird der Request abgelehnt.

Zur Löschung oder Änderung von Orders bietet das BT-FIX Gateway zusätzlich die folgende Möglichkeit: Ein Cancel oder Cancel/Replace Request kann auch mit Hilfe der Ordernummer des Handelssystems (OrderID) unter explizitem Ausschluss des Chaining Mechanismus (OrigClOrdID wird auf "[N/A]" gesetzt) durchgeführt werden.

Sind die entsprechenden Identifikationsbegriffe bekannt, dann können beide Verfahren der Orderbearbeitung benutzt werden, ohne Rücksicht darauf, über welches Interface eine Order eingestellt oder zuletzt bearbeitet wurde. Im Rahmen des FIX Chainings werden jedoch nur die über das FIX Interface übermittelten Aufträge verwaltet.

Es sei aber darauf hingewiesen, dass eine Identifikation über die OrderID nur bei bestätigten Orders möglich ist (im Gegensatz zum Chaining Mechanismus).

Weitere Identifikationsverfahren werden nicht unterstützt. Eine Identifikation über eine "bankinterne" Ordernummer mit Hilfe des Tags 526 (SecondaryClOrdID) ist nicht möglich.

Es ist nicht beabsichtigt, die Identifikationsverfahren über die Interfaces hinweg zu harmonisieren.

2.8.2 Empfehlungen

Kunden, welche alle angebotenen Interfaces in den zulässigen Kombinationen uneingeschränkt nutzen wollen, wird dringend empfohlen, für ihre Orders eine eigene, eindeutige Schlüsselsystematik vorzusehen. Eine Verwendung der Ordernummern der Handelssysteme ist **auf keinen Fall** sinnvoll. Die Zuordnung des eigenen Schlüssels einer Order zum aktuellen Schlüssel im Zielsystem muss von einem OMS geleistet werden. Bei der Verwendung des FIX Interfaces ist besonders auf eine korrekte Behandlung der folgenden Situationen zu achten:

- Änderungen einer Order – hier kann die Ordernummer des Handelssystems wechseln. Die korrespondierende FIX Nachricht an das OMS **enthält nur die neue Ordernummer** des Handelssystems ~~(Xetra, Xetra Ffm-2)~~.
- Über das FIX Interface ausgelöste Änderungen oder Löschungen einer Order, welche über ein anderes Interface eingestellt wurde. In diesem Fall muss die korrekte, aktuelle Ordernummer des Handelssystems geliefert werden, falls der FIX Request direkt auf die Einstellung folgt.
- Änderungen oder Löschungen einer Order über ein anderes Interface als das FIX Interface. Die korrespondierenden Nachrichten an das OMS liefern keine OrigClOrdID, und in ClOrdID den Wert des letzten erfolgreichen, über das FIX Interface übermittelten Requests. Ein OMS muss also in der Lage sein, eine Order **an Hand der letzten gültigen ClOrdID oder der OrderID** zu identifizieren.

Ein beliebiger Wechsel des Interfaces zur Bearbeitung einer Order führt zu einer Beeinträchtigung des Chaining Mechanismus und dazu, dass ein OMS ständig dynamisch das Identifikationsverfahren für eine Order wechseln muss.

Es wird deshalb empfohlen, ein Verfahren als das führende festzulegen und den Verfahrenswechsel auf Notfälle zu beschränken.

~~2.8.3 INVESTRO / Vestima~~

~~Die Auftragsverarbeitung an INVESTRO und Vestima wird über die bestehenden Nachrichtenflows und Abläufe für das Orderrouting an die unterstützten Handelssysteme abgebildet.~~

~~Bezüglich der Eindeutigkeit der ClOrdID eines Auftrages (vgl. Kap. 2.8.1 Orderidentifikation) gilt für INVESTRO/Vestima die Besonderheit, dass eine ClOrdID auch nach erfolgter Ausführung oder Löschung des Auftrags noch bis zu weiteren 10 Handelstagen eindeutig bleiben muss. Dies liegt an der Möglichkeit der Stornierung einer Ausführung durch Vestima.~~

~~Die Besonderheiten von Vestima werden über vorhandene Nachrichten abgebildet:~~

- ~~Informationen über den Status eines Auftrags~~

  ~~Die formal richtige Nachricht wird dem FIX-Teilnehmer als ExecutionReport mit Pending-Reason 5 (verification pending) - als vorläufige Bestätigung - gemeldet. In der Nachricht wird eine genauere Information über den Auftragsstatus über die Tags 5048 (OrdSubStatus) und 5476 (PrivateReference) geliefert.~~

  ~~Wenn der Auftragsempfänger in Vestima den Auftrag bestätigt, dann erhält der FIX-Teilnehmer die Auftragsstatus-Änderung "endgültig" als ExecutionReport.~~

  ~~Details siehe im Kapitel „7.3.2 Auftragsrouting an INVESTRO mit Vestima-Gattungen“.~~

- ~~Auftragsausführung (MT515)~~

  ~~Aus einer MT515-Nachricht (Confirmation) von Vestima wird ein ExecutionReport mit Tag 150 (ExecType) = F (Trade) und Tag 39 (OrdStatus) = 2 (filled) generiert.~~

  ~~Abwicklungsdaten, die von Vestima im MT515 geliefert werden, werden in diesen ExecutionReports nicht weitergegeben. Diese Daten können, je nach Teilnehmerkonfiguration, durch die Schlussnoten Nachrichten (TradeCaptureReportSno) bezogen werden.~~

- ~~Stornierung einer Auftragsausführung (MT515 CANCEL)~~

  ~~Aus dieser Nachricht wird ein ExecutionReport mit Tag 150 (ExecType) = D (Restated), Tag 39 (OrdStatus) = 2 (filled), Tag 5048 (OrdSubStatus) = H (disabled) und Tag 11 (ClOrdID) = [N/A] generiert.~~

- ~~Auftragsausführung nach MT515 CANCEL~~

  ~~Aus dieser Nachricht wird ein ExecutionReport mit Tag 150 (ExecType) = D (Restated), Tag 39 (OrdStatus) = 2 (filled) und Tag 11 (ClOrdID) = [N/A] generiert.~~

~~2.8.4~~2.8.3 Besonderheiten bei der Behandlung bestimmter Requests

Es sei ausdrücklich auf die Besonderheiten des Cancel Requests hingewiesen, der einen zweiten Ordertyp erfordert (Tag 5253).

2.9 Trade-Funktionalität

2.9.1 Unterstützte Nachrichten

Folgende Trade-Nachrichten werden unterstützt:

- TradeCaptureReport — Request: OTC- ~~und MiFID~~ Funktionalität
- TradeCaptureReportAck — Response auf ein TradeCaptureReport
- TradeCaptureReportSno — Information zu einer Schlussnote

Folgende FIX-Tags werden als Identifikationskriterien der unterstützten Nachrichten verwendet:

- Funktionalität (OTC, ~~MiFID,~~ SNO)
  - 6556 BusinessTransactionType
  - 487 TradeReportTransType
  - 856 TradeReportType

- Identifikation eines Geschäfts bzw. eines Reports
  - 880 TrdMatchID
  - 6555 OrigTrdMatchID

- Weitere Identifikationskriterien
  - 571 TradeReportID
  - 572 TradeReportRefID
  - 150 ExecType

Details in den Kapiteln zu „7.4~~7~~.5 Tradefunktionalität“

2.9.2 Tradeidentifikation

Jede Nachricht enthält das Feld TradeReportID (Tag 571) als eindeutigen Identifier. Nachrichten, die eine vorherige Aktion referenzieren, enthalten zusätzlich das Feld TradeReportRefID (Tag 572).

Über diese Felder gibt es im BT-FIX Gateway keinen Chaining Mechanismus. Im BT-FIX Gateway findet keine Prüfung auf Eindeutigkeit für das Feld TradeReportID statt. Es wird auch nicht geprüft, ob die TradeReportRefID eine vorhandene, bereits gelieferte, TradeReportID enthält.

Die Eindeutigkeit bzw. Richtigkeit dieser Felder in den Request-Nachrichten muss vom Client sichergestellt werden.

In einer Response-Nachricht werden die Felder TradeReportID und TradeReportRefID (sofern vorhanden) mit dem Inhalt aus der Request-Nachricht versorgt.

Im TradeCaptureReportSno wird von ~~XONTRO~~FAGSE eine eindeutige TradeReportID generiert.

Als Schlüsselfelder für die Identifikation der Trade-Nachrichten werden im BT-FIX Gateway ausschließlich die in ~~XONTRO~~T7 GSE vergebenen Report- bzw. Geschäftsnummern verwendet. Diese werden in den Feldern TrdMatchID (Tag 880) und OrigTrdMatchID (Tag 6555) übermittelt.

2.10 Reject Verhalten

Kann das BT-FIX Gateway einen von einem OMS gestellten Request nicht in einen Auftrag an ein Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system umsetzen (wegen formaler Fehler oder Inkonsistenzen der Nachrichteninhalte), dann erfolgt immer ein Reject auf Session Level (MsgType 3).

Dies gilt für

- fehlende mandatory oder conditional Mandatory Tags
- nicht zulässige Tags
- ungültige Werte von Tags
- ungültige Kombinationen von Werten

Bei Unterschieden zwischen RoE und den Standard FIX Definitionen gelten die Festlegungen der RoE.

Fehler, die ein Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system erkennt, werden über einen Execution Report, Cancel Reject oder einen Business Message Reject mitgeteilt.

Ist ein Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system nicht verfügbar, dann liefert das BT-FIX Gateway einen Business Message Reject mit Reason Code 4 ("Application not available").

Business Message Reject und **Reject** Nachrichten werden im Kapitel 6 FIX-Nachrichten vom Typ Reject und Business Message Reject beschrieben. Sie können als negative Antworten auf **jeden Request** versendet werden. Clients und Order Management Systeme müssen eine entsprechende Verarbeitung vorsehen.

2.11 Verhalten bei ResendRequest

Ist in den vom OMS gesendeten Requests eine Lücke in der Sequenznummer (MsgSeqNum) entstanden, dann fordert das BT-FIX Gateway die fehlenden Sequenznummern mit einem ResendRequest an. Die Lücke muss dann umgehend vom OMS geschlossen werden.

Werden stattdessen mehr als 500 weitere Requests gesendet, ohne die Lücke zu schliessen, so erfolgt ein automatischer Logout durch das BT-FIX Gateway. Alle Requests nach der Lücke werden dadurch verworfen.

2.12 Inbetriebnahme

Eine erfolgreiche Teilnahme an der Simulation ist Voraussetzung für die Aufnahme des produktiven Betriebs.

3 Leistungsmerkmale

3.1 Eingehende und Ausgehende Nachrichten

Der Begriff "eingehende Nachricht" (Request) wird für alle Nachrichten vom Kundensystem (OMS) zum Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system verwendet. Diese Festlegung wird auch für Nachrichten verwendet, bei welchen nicht die gesamte Übertragungsstrecke durchlaufen wird.

Übertragungsstrecke für eingehende Nachrichten:

OMS ➔ FIX Engine (Kunde) ➔ BT-FIX Gateway ➔ Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system

Der Begriff "ausgehende Nachricht" (Response, Broadcast) wird für alle Nachrichten vom Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system zum Kundensystem (OMS) verwendet.

Übertragungsstrecke für ausgehende Nachrichten:

Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system ➔ BT-FIX Gateway ➔ FIX Engine (Kunde) ➔ OMS

3.2 Szenarien und Nachrichten des Sessionlevels

3.2.1 Verarbeitung FIX-Requests

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten
Technische Requests		
Anmeldung	Logon	Logon (positiv) Logon + Logout (negativ)
Anmeldung mit gleichzeitiger Passwortänderung	Logon	Logon (positiv) Logon + Logout (negativ)
Abmeldung	Logout	Logout
Passwortänderung	User Request (4.4) Benutzerdefinierter User Request (4.2)	User Response (4.4) Benutzerdefinierte User Response (4.2)
Allgemeine Ablehnungen (möglich für jeden Request)		
Session Level Reject	jede Request-Nachricht	Reject
Allgemeine Ablehnung durch ein Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system oder das BT-FIX Gateway	jede Request-Nachricht	Business Message Reject

3.2.2 Systemgenerierte Nachrichten

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten
System Shutdown		
Abmeldung	-	Logout
Statusnachrichten	-	News “End-of-Day Processing” “End-of-Day Cut-off”
Technische Nachrichten		
Prüfen der physischen Verbindung	-	Heartbeat
Anforderung eines Heartbeats	-	TestRequest
Anforderung von Nachrichten	-	Resend Request

3.3 Szenarien und Nachrichten des Applikationslevels

3.3.1 Verarbeitung FIX-Requests

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten
Orderfunktionalität~~, Auftragsverarbeitung~~		
Ordereingang	New Order Single	Execution Report
Orderlöschung	Order Cancel	Execution Report (positiv, vorläufig) Order Cancel Reject (negativ)
Orderänderung	Order Cancel/Replace	Execution Report (positiv, vorläufig) Order Cancel Reject (negativ)
~~Auftragseingang~~	~~New Order Single~~	~~Execution Report~~
~~Auftragslöschung~~	~~Order Cancel~~	~~Execution Report (positiv)~~ ~~Order Cancel Reject (negativ)~~
~~Auftragsänderung~~	~~Order Cancel/Replace~~	~~Order Cancel Reject (negativ)~~
Tradefunktionalität		
OTC-Geschäftseingang	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck
OTC-Geschäftsstorno	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck
~~OTC-Geschäftsdurchlieferung~~	~~TradeCaptureReport~~	~~TradeCaptureReportAck~~
~~MiFID-Report-Eingang~~	~~TradeCaptureReport~~	~~TradeCaptureReportAck~~
~~MiFID-Report-Storno~~	~~TradeCaptureReport~~	~~TradeCaptureReportAck~~

3.3.2 Externe Eingaben / systemgenerierte Nachrichten

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten
Orderfunktionalität~~, Auftragsverarbeitung~~		
Ordereingang	-	Execution Report
Orderlöschung	-	Execution Report (positiv, vorläufig) Order Cancel Reject (negativ)
Orderänderung	-	Execution Report (positiv, vorläufig) Order Cancel Reject (negativ)
Orderausführung	-	Execution Report
~~Auftragseingang~~	~~-~~	~~Execution Report~~
~~Auftragslöschung~~	~~-~~	~~Execution Report (positive, vorläufig)~~ ~~Order Cancel Reject (negativ)~~
~~Auftragsausführung~~	~~-~~	~~Execution Report~~

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten
~~Nachrichten an den Auftragsempfänger~~	-	~~Execution Report~~
~~Statusänderungen eines Auftrags (nur Vestima)~~	-	~~Execution Report~~
~~Storno einer Auftragsausführung (nur Vestima)~~	-	~~Execution Report~~
Tradefunktionalität		
Geschäftsinformationen (Schlussnoten-Realtime)	-	TradeCaptureReportSno
Ereignisse		
Ereignismitteilung	-	News

3.4 Unterschiede zwischen FIX 4.2 und FIX 4.4

Die vorliegenden RoE beschreiben die Anforderungen an FIX Version 4.4. Die relevanten Unterschiede zu FIX Version 4.2, die durch das BT-FIX Gateway ebenfalls unterstützt wird, betreffen die Orderstatusverwaltung, das Konzept des "Parties Component Blocks", die Nachrichten zur Passwortänderung und die Trade-Nachrichten.

3.4.1 Orderrouting

Handelt es sich bei einer Session um eine Verbindung der Version 4.2, wird zusätzlich das Feld ExecTransType (Tag 20) in einem Execution Report geliefert. Dieses Tag wird immer mit dem Wert 0 ("New") belegt.

Die Verwaltung der beteiligten Parteien über den Parties Component Block ist in einer Session der Protokollversion 4.2 nicht möglich. Der Component Block entfällt, die Repeating Groups werden in den Nachrichten wie folgt ersetzt[3]:

<parties>	**Tag 4.2**	**Feldname**	**Kommentare**
<entering firm>	6031	EnteringFirm	String(4), KVNr des Anschlussinhabers
<executing firm>	76	ExecBroker	String(4), zugelassene KVNr des Orderaufgebers
<market maker>	9318	MktMkerID	String(4), KVNr des Maklers, wird ignoriert
~~<systematic internaliser>~~	~~9318~~	~~MktMkerID~~	~~String(5), Xetra MemberID~~
<session>	5177	Source	String, KVNr bzw. MemberID des Eingebers von einem anderen Interface
<executing system>	7931	VenueID	String, folgende Belegung ist möglich: ~~"XETRA"~~ ~~"XETRA-2"~~ "XONTROT7 GSE" "MAX-ONE" ~~"INVESTRO"~~
~~<intermediary>~~	~~109~~	~~ClientID~~	~~String(10) numerisch, INVESTRO-Vertriebspartner~~
<client identification code>	20003	PartyIDClientID	String(20), Shortcode. (ESMA RTS24 Feld 3) Spezielle Werte: 1 = AGGR 2 = PNAL
	21103	PartyIDClientIDQualifier	Integer Tag wird ignoriert. Der Qualifier zur ClientID sagt aus, ob der angegebene Shortcode im Tag 20003 ein LEI oder eine natürliche Person repräsentiert. 23 = LEI (Legal Entity Identifier) 24 = Nat. Person
	21303	PartyIDClientIDSource	Char Klassifizierung des Tag 20003. P = Shortcode Die Angabe von Tag 21303 ist nicht notwendig.
<investment decision maker>	20122	PartyIDInvestmentDecisionMaker	String(20), Shortcode oder Algorithmus. (ESMA RTS24 Feld 4)

[3] Die in spitzen Klammern angegebenen Namen sind die in diesem Dokument verwendeten Bezeichner der Occurrences des <parties> Component Block, **keine** FIX Feldnamen.

<parties>	Tag 4.2	Feldname	Kommentare
	21222	PartyIDInvestmentDecisionMakerQualifier	Integer Der Qualifier zum InvestmentDecisionMaker sagt aus, ob es sich bei der PartyID im Tag 20122 um einen Algorithmus oder um den Shortcode für eine natürliche Person handelt. 22 = Algorithmus 24 = Shortcode für nat. Person Fehlt Tag 21222, wird von einem Shortcode ausgegangen.
	21422	PartyIDInvestmentDecisionMakerSource	Char Klassifizierung des Tag 20122. P = Shortcode, oder in Verbindung mit Tag 21222 auch Algorithmus. Die Angabe von Tag 21422 ist nicht notwendig.
<Execution within firm>	20012	PartyIDExecutingTrader	String(20), Shortcode oder Algorithmus. (ESMA RTS24 Feld 5) Spezielle Werte: 3 = NORE
	21112	PartyIDExecutingTraderQualifier	Der Qualifier zum ExecutingTrader sagt aus, ob es sich bei der PartyID im Tag 20012 um einen Algorithmus oder um den Shortcode für eine natürliche Person handelt. 22 = Algorithmus 24 = Shortcode für nat. Person Fehlt Tag 21112, wird von einem Shortcode ausgegangen.
	21312	PartyIDExecutingTraderSource	Char Klassifizierung des Tag 20012. P = Shortcode, oder in Verbindung mit Tag 21112 auch Algorithmus. Die Angabe von Tag 21312 ist nicht notwendig.

~~Konflikte bei der Verwendung des Tags 9318 können nicht auftreten. Bei keinem der Zielsysteme können beide Parteien gleichzeitig vorhanden sein.~~

3.4.2 Passwortänderung

Die für eine Passwortänderung erforderlichen Nachrichten der MsgTypes "BE" - User Request - und "BF" - User Response - sind in Version 4.2 nicht definiert. Bei unveränderter Nachrichtenstruktur wird "BE" durch "UBE" und "BF" durch "UBF" ersetzt.

Soll die Version 4.2 benutzt werden, dann ist darauf zu achten, dass der Standardumfang der in 4.2 definierten Tags um die aus den Folgeversionen entnommenen zusätzlichen Standardtags erweitert werden muss, siehe: Anhang D: Erweiterungen des 4.2 Sprachumfangs.

3.4.3 Trade-Nachrichten

Die MsgTypes "AE" - TradeCaptureReport und "AR" - TradeCaptureReportAck sind in Version 4.2 nicht definiert. Bei unveränderter Nachrichtenstruktur wird "AE" durch "UAE" und "AR" durch "UAR" ersetzt. Innerhalb der userdefinierten TradeCaptureReport-Nachricht und TradeCaptureReportSno-Nachricht werden die Party-Repeating Groups nicht mehr, wie oben beschrieben, ersetzt.

4 FIX-Nachrichten, Detailbeschreibung zu Header/Trailer

4.1 Erläuterungen FIX Header/Trailer

Legende **FIX Header/Trailer**

Sortierung: FIX Header und Trailer enthalten Felder, die eine feste Position am Anfang oder Ende einnehmen müssen und solche, die an einer beliebigen, sonstigen Stelle im Header/Trailer stehen können. Felder, die eine feste Position einnehmen müssen, sind in der Tabelle grau hinterlegt und stehen an der Position, die sie auch in der Nachrichtenstruktur einnehmen müssen. Alle anderen Felder sind nach Tags aufsteigend sortiert.

Spalten: RF (required FIX) und R (required) enthält eine der Angaben Mandatory/Optional, alle anderen Überschriften sind selbsterklärend.

Inhalte: Das Feld **"Kommentare"** enthält zunächst das FIX Format des Feldes, dann eine Feldbeschreibung und eine Beschreibung von Restriktionen, Angaben zu Länge und Position etc. Entscheidend für die Behandlung eines Tags ist der Eintrag in der Spalte "R".

4.2 FIX Header <standard message header>

Eingehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
8	BeginString	M	M	String Kennzeichnung der FIX Version muss immer = "FIX.4.4" oder "FIX.4.2" sein feste Feldposition (1)
9	BodyLength	M	M	Length Nachrichtenlänge feste Feldposition (2)
35	MsgType	M	M	String Typ der Nachricht feste Feldposition (3) nur die vom BT-FIX Gateway definierten Typen sind zulässig
34	MsgSeqNum	M	M	SeqNum Folgenummer der Nachricht, vom sendenden System vergeben, lückenlos pro Session, Startwert = "1". Die Sequenznummer der FIX Engine wird innerhalb eines Tages hochgezählt, unabhängig davon, wie oft eine Session beendet und wieder aufgebaut wurde. Am nächsten Tag startet die Sequenznummer wieder mit "1"
43	PossDupFlag	O	O	Boolean Wird bei einer Retransmission mit identischer Folgenummer von der Engine auf "Y" gesetzt
49	SenderCompID	M	M	String Identifikation des sendenden Systems. Ist zwischen dem Eigentümer des Systems und der BrainTrade GmbH zu vereinbaren. Werden von einem Eigentümer mehrere Systeme betrieben, dann können diese nicht gleichzeitig aktiv sein Das Tag SenderCompID muss auf allen Systemen identisch belegt werden
52	SendingTime	M	M	UTCTimestamp
56	TargetCompID	M	M	String Identifikation des empfangenden Systems. Wird von der BrainTrade GmbH festgelegt
97	PossResend	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.
122	OrigSendingTime	O	O	UTCTimestamp Bei Antworten auf einen Resend Request des BT-FIX Gateway: Timestamp der Originalnachricht Aus Kompatibilitätsgründen aufgenommen Das Tag wird ignoriert
369	LastMsgSeqNumProcessed	O	O	SeqNum Letzte vom sendenden System verarbeitete Folgenummer

Ausgehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
8	BeginString	M	M	String Kennzeichnung der FIX Version immer = "FIX.4.4" oder "FIX.4.2" feste Feldposition (1)
9	BodyLength	M	M	Length Nachrichtenlänge feste Feldposition (2)
35	MsgType	M	M	String Typ der Nachricht feste Feldposition (3) nur die vom BT-FIX Gateway definierten Typen sind zulässig
34	MsgSeqNum	M	M	SeqNum Folgenummer der Nachricht, vom sendenden System vergeben, lückenlos pro Session, Startwert = 1
43	PossDupFlag	O	O	Boolean Wird bei einer Retransmission mit gleicher Folgenummer auf "Y" gesetzt, wird bei einer Antwort auf einen Resend Request immer gesetzt
49	SenderCompID	M	M	Identifikation des empfangenden Systems. Wird von der BrainTrade GmbH festgelegt
52	SendingTime	M	M	UTCTimestamp
56	TargetCompID	M	M	Identifikation des sendenden Systems. Ist zwischen dem Eigentümer des Systems und der BrainTrade GmbH zu vereinbaren
97	PossResend	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
122	OrigSendingTime	O	O	UTCTimestamp Bei Antworten auf einen Resend Request des Clients: Timestamp der Originalnachricht

4.3 FIX Trailer <standard message trailer>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
10	CheckSum	M	M	3 Byte Checksum feste Feldposition (letztes Feld)

5 FIX-Nachrichten des Sessionlevels

5.1 Erläuterungen FIX Datenteil

Spalten: RF (required FIX) und R (required) enthalten eine der Angaben Mandatory/Optional, ~~XEOMI~~ 7M die Angaben **M**andatory/**O**ptional/**C**onditional/**N**ot allowed für die Handels- ~~bzw. Abwicklungs~~systeme **X**~~etra~~[4]/X**E**~~tra Ffm-2~~[5]/X**O**~~NTROT~~**7** GSE/**M**AX-ONE/~~I~~~~NVESTRO~~.

Inhalte: In den Spalten **R/RF** werden M/C nur vergeben, wenn das Tag für alle Zielsysteme mandatory/conditional mandatory ist. In **XEO7MI** findet sich dann kein Eintrag.

Das Feld **"Kommentar"** enthält zunächst das FIX Format des Feldes. Es folgen eine Feldbeschreibung und eine Beschreibung von Restriktionen, Angaben zu Länge und Position etc.
Eine Bezeichnung Integer(5) bedeutet, dass nach dem Entfernen führender Nullen maximal fünf signifikante Stellen zulässig sind, eine Bezeichnung Float(10,3) heißt, dass nach dem Entfernen führender Nullen maximal zehn signifikante Stellen, davon 3 Nachkommastellen vorkommen dürfen. Es handelt sich hierbei lediglich um eine verkürzte Beschreibung der für dieses BT-FIX Gateway zulässigen Formate, **nicht** um FIX Konventionen.

[4] ~~vgl. hierzu bitte auch Abschnitt 2.4 Zielsysteme~~
[5] ~~vgl. hierzu bitte auch Abschnitt 2.4 Zielsysteme~~

5.2 Logon / Logon mit gleichzeitiger Passwortänderung

Ein Logon Request (ggf. mit gleichzeitiger Passwortänderung) wird in allen Fällen zunächst von der FIX Engine des BT-FIX Gateway mit einer Logon Nachricht beantwortet. Wird der Request nicht akzeptiert, dann erhält der Teilnehmer eine zusätzliche Logout Nachricht. [Weitere Informationen zum zukünftigen Passwortmanagement werden noch bekanntgegeben.]

Logon Request

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "A" (MsgType)
98	EncryptMethod	M	M		Integer Verschlüsselungsmethode **muss auf 0 = "keine" gesetzt sein**
108	HeartBtInt	M	M		Integer Heartbeatintervall wird gegen den im BT-FIX Gateway konfigurierten Wert geprüft
141	ResetSeqNumFlag	O	O	OOOOO	Boolean Anforderung zum Rücksetzen der Sequence Number
383	MaxMessageSize	O	O	OOOOO	Length Maximale Nachrichtenlänge (Empfang) wird nicht ausgewertet
553	Username	O	M		siehe PartyID in <entering Firm> userID Es werden nur numerische Werte akzeptiert
554	Password	O	M		String(8) Passwort Wert muss nummerische Ziffern und Buchstaben enthalten. Sonderzeichen sind nicht zulässig
789	NextExpectedMsgSeqNum	O	O	OOOOO	SeqNum Nächste erwartete Sequence Number wird nicht ausgewertet reserviert für zukünftige Erweiterungen
925	NewPassword	O	O	OOOOO	String(8) Passwort neu wenn das NewPassword vorhanden ist wird ein Logon mit gleichzeitiger Passwortänderung durchgeführt Wert muss nummerische Ziffern und Buchstaben enthalten. Sonderzeichen sind nicht zulässig
<standard message trailer>		M	M		

Logon Response

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "A" (MsgType)
98	EncryptMethod	M	M		Integer Verschlüsselungsmethode immer auf 0 = "keine" gesetzt
108	HeartBtInt	M	M		Integer Heartbeatintervall wird gegen den im BT-FIX Gateway konfigurierten Wert geprüft
141	ResetSeqNumFlag	O	O	OOOOO	Boolean Anforderung zum Rücksetzen der Sequence Number
383	MaxMessageSize	O	O	OOOOO	Length Maximale Nachrichtenlänge (Empfang)
553	Username	O	O	OOOOO	String(10) userID Das Tag ist zur Zeit nie belegt
789	NextExpectedMsgSeqNum	O	O	OOOOO	SeqNum Nächste Erwartete Sequence Number wird nicht belegt reserviert für zukünftige Erweiterungen
<standard message trailer>		M	M		

Bei Ablehnung eines Logon wird zusätzlich die folgende Nachricht versendet. SessionStatus muss nicht in allen Fällen belegt sein.

Logout Response

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "5" (MsgType)
58	Text		O	OOOOO	String Fehlertext
1409	SessionStatus		O	OOOOO	Integer Errorcode 5 = "Invalid username or password" 7 = "Logons are not allowed at this time" 8 = "Password expired"
<standard message trailer>		M	M		

Wird ein Logon mit "Password expired" abgelehnt, dann ist ein Logon mit Passwortänderung erforderlich. Im Logon Request ist das Tag 554 (altes Password) und das Tag 925 (NewPassword) zu liefern.

5.3 Passwortänderung

Dieser Request erfordert eine bestehende Session. Er kann also **bei einem abgelaufenen Passwort nicht verwendet werden**. [Weitere Informationen zum zukünftigen Passwortmanagement werden noch bekanntgegeben.]

User Request

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "BE" (MsgType)
553	Username	M	M		String userID
554	Password	O	M		String(8) Passwort Wert muss nummerische Ziffern und Buchstaben enthalten. Sonderzeichen sind nicht zulässig
923	UserRequestID	M	M		String(16) Eindeutiger Schlüssel
924	UserRequestType	M	M		Integer Requesttyp muss auf 3 = "Passwortänderung" gesetzt sein
925	NewPassword	O	M		String(8) Passwort neu Wert muss nummerische Ziffern und Buchstaben enthalten. Sonderzeichen sind nicht zulässig
<standard message trailer>		M	M		

User Response

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "BF" (MsgType)
553	Username	M	M		String userID
923	UserRequestID	M	M		String(16) Eindeutiger Schlüssel
926	UserStatus	O	M		Integer User Status Passwortänderung erfolgreich 5 = "Passwortänderung erfolgreich" Passwortänderung abgelehnt 2 = "Nicht eingeloggt" 3 = "User nicht erkannt" 4 = "Passwort fehlerhaft" 6 = "sonstige" Weitere Information wird bei Ablehnungen im Tag 927 geliefert
927	UserStatusText	O	O	OOOOO	String Passwortänderung erfolgreich das Tag wird nicht geliefert Passwortänderung abgelehnt erläuternder Text zu 926
<standard message trailer>		M	M		

5.4 Logout

Logout Request

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "5" (MsgType)
<standard message trailer>		M	M		

Logout Response

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "5" (MsgType)
58	Text		O	OOOOO	String erläuternder Text zur Abmeldung
<standard message trailer>		M	M		

5.5 System Shutdown

Der System Shutdown wird durch eine News Nachricht mit Status "002" = "End of Business Day" eingeleitet. Eingehende Requests werden ab diesem Zeitpunkt abgelehnt, noch auf ihre Auslieferung wartende Nachrichten werden ausgeliefert. Die beteiligten Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systeme erzeugen möglicherweise auch noch weitere Nachrichten. Sobald auch dieser Prozess beendet ist, erhält der Kunde eine News Nachricht mit Status "003" = "End of Business Day Cut-Off" und - mit geringem zeitlichem Abstand - eine Logout Nachricht. Danach wird in jedem Fall die Verbindung abgebaut.

Nr.	**System shutdown**	messageflow		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handels- bzw. Abwicklungssystem
1	news ("2","End of Business Day")		←	
	weitere Requests vom Client			
2	NewOrderSingle	→		
	Ablehnung auf Requests nach "End of Business Day"			
3	Business Message Reject (4)		←	
	Nachrichten vom System werden noch geliefert			←
4	Execution Report ("Trade","Partially filled")		←	
5	News ("3", "End of Business Day Cut-Off")		←	
6	Logout		←	
~~7~~	~~Logout~~	→	-	-
8	Verbindungsabbau		←	

News Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "B" (MsgType)
33	LinesOfText		M		NumInGroup Anzahl Zeilen mit "1" belegt
58	Text		M		String Text der News Messages End of Business Day "End of Day Processing – No more Input messages" End of Business Day Cut-Off "End of Business Day Cut-Off, System unavailable"
148	Headline		M		String Message Status "002" = End of Business Day "003" = End of Business Day Cut-Off
<standard message trailer>		M	M		

6 FIX-Nachrichten vom Typ Reject und Business Message Reject

Beschrieben werden im Folgenden lediglich die Datenteile. Beide Nachrichtentypen besitzen weder Party- noch Instrumentinformationen.

Reject (MsgType = 3)

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
45	RefSeqNum	M	M		SeqNum Sequenznummer des abgelehnten Requests
58	Text	O	O	OOOOO	String Fehlertext
371	RefTagID	O	M		Integer Tag auf das sich die Fehlermeldung bezieht
372	RefMsgType	O	M		String MsgType der abgelehnten Nachricht
373	SessionRejectReason	O	O	OOOOO	Integer Grund der Ablehnung
5555	ReturnCode		O	OOOOO	Integer Returncode
9803	TradingSystemID		O	OOOOO	Integer Identifier des Systems, das die Ablehnung erzeugt hat

Wird ein Standardcode in Tag 373 (SessionRejectReason) vergeben, dann kann Tag 58 (Text) belegt sein. Kann kein Standardcode vergeben werden, dann sind die Tags 5555 (ReturnCode), 9803 (TradingSystemID) und 58 (Text) belegt, **Tag 373 (SessionRejectReason) fehlt**. Referenziert wird in Tag 371 (RefTagID) das fehlerhafte Tag, bei Prüfungen eines Zusammenhangs das Tag, welches fehlt oder nicht zulässig ist.

Business Message Reject (MsgType = j)

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
45	RefSeqNum	O	M		SeqNum Sequenznummer des abgelehnten Requests
58	Text	O	O	OOOOO	String Fehlertext
372	RefMsgType	M	M		String MsgType der abgelehnten Nachricht
380	BusinessRejectReason	M	M		Integer Grund der Ablehnung
5555	ReturnCode		O	OOOOO	Integer Returncode
9803	TradingSystemID		O	OOOOO	Integer Identifier des Systems, das die Ablehnung erzeugt hat

Wird ein Standardcode in Tag 380 (BusinessRejectReason) vergeben, dann kann Tag 58 (Text) belegt sein. Kann kein Standardcode vergeben werden, dann sind die Tags 5555 (ReturnCode), 9803 (TradingSystemID) und 58 (Text) belegt, **Tag 380 (BusinessRejectReason) wird auf "0" gesetzt**.

7 FIX-Nachrichten des Applicationlevels

7.1 Erläuterungen FIX Datenteil

Sortierung:

Die Elemente des <instrument> Component Blocks können in beliebiger Reihenfolge übermittelt werden. Sie müssen nicht aufeinander folgen. Für die vom BT-FIX Gateway versendeten Nachrichten gilt das Gleiche.

Repeating Groups enthalten Felder, die eine feste Position am Anfang einnehmen müssen und solche, die an einer beliebigen, sonstigen Stelle in der Repeating Group stehen können. Eine Repeating Group beginnt immer mit dem Tag, welches die Anzahl der Gruppen enthält, danach folgt das 1. Tag innerhalb dieser Gruppe. Felder, die eine feste Position einnehmen, sind in der Tabelle grau hinterlegt und stehen an der Position, die sie auch in der Repeating Group einnehmen müssen. Alle anderen Felder sind nach Tags aufsteigend sortiert, können jedoch in beliebiger Reihenfolge übermittelt werden. Für die vom BT-FIX-Gateway erstellten Repeating Groups gilt das Gleiche.

Spalten:

RF (required FIX) und R (required) enthalten eine der Angaben **M**andatory/**O**ptional/**C**onditional, ~~XEO~~7M~~I~~ die Angaben **M**andatory/**O**ptional/**C**onditional/**N**ot allowed für die Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systeme **X**etra/X**E**tra Ffm-2/X**O**NTRO~~T~~7 GSE/**M**AX-ONE/~~I~~NVESTRO: Bei einem Order-Cancel/-Replace Request werden auch die Werte **A**enderbar/**U**nverändert verwendet. EnterOTC, DeleteOTC, ~~ReverseOTC, EnterMIFID, DeleteMifid~~ enthalten **M**andatory/**O**ptional/**C**onditional/**N**ot allowed/**I**gnoriert für die Request-Vorfälle Einstellung, Storno und~~, Durchlieferung~~ OTC-Geschäfte~~ und Einstellung, Storno MiFID-Reports~~.
Alle anderen Überschriften sind selbsterklärend.~~ Bei INVESTRO wird in bestimmten Fällen die Spalte mit "-" angegeben, als Hinweis dass die beschriebene Aktion für INVESTRO nicht relevant (nicht möglich) ist, z.B. Auftragsänderung.~~

Inhalte:

In den Spalten **R/RF** werden M/C nur vergeben, wenn das Tag für alle Zielsysteme mandatory/conditional mandatory ist. In **X~~EO~~7M~~I~~** findet sich dann kein Eintrag. Handelt es sich um ein Feld einer Repeating Group oder eines Component Blocks, dann bedeutet der Eintrag "M", dass das Feld innerhalb der übergeordneten Struktur mandatory ist. Die entsprechende Eigenschaft hinsichtlich der Nachricht findet sich dann bei der Struktur. Ist ein Tag in einem Zielsystem mandatory, in einem anderen nicht wird insgesamt der Code "O" vergeben.

Mit dem Code "C" werden alle Felder gekennzeichnet, die von einem anderen Feld abhängig sind. Beispiel: StopPx hängt von OrdType ab. In diesem Fall erhält StopPx den Code "C".

Das Feld **"Kommentar"** enthält zunächst das FIX Format des Feldes. Es folgen eine Feldbeschreibung und eine Beschreibung von Restriktionen, Angaben zu Länge und Position etc.
Eine Bezeichnung Integer(5) bedeutet, dass nach dem Entfernen führender Nullen maximal fünf signifikante Stellen zulässig sind, eine Bezeichnung Float(10,3) heißt, dass nach dem Entfernen führender Nullen maximal zehn signifikante Stellen, davon 3 Nachkommastellen vorkommen dürfen. Es handelt sich hierbei lediglich um eine verkürzte Beschreibung der für dieses BT-FIX Gateway zulässigen Formate, **nicht** um FIX Konventionen.

7.2 Orderfunktionalität

7.2.1 Order~~- bzw. Auftrags~~einstellung

7.2.1.1 ~~Abläufe – Orders~~Abläufe – Orders

Nr.	**Ordereinstellung positiv**	**messageflow**		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	new order single	→		
			→	
	optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)			←
2	execution report ("Pending New", "Pending New")		←	
	endgültige Bestätigung positiv			←
3	execution report ("New", "New")		←	

Nr.	**Ordereinstellung negativ**	**messageflow**		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	new order single	→		
			→	
	optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)			←
2	execution report ("Pending New", "Pending New")		←	
	endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)			←
3	execution report ("Rejected", "Rejected")		←	

Nr.	**Ordereinstellung ohne endgültige Bestätigung**	**messageflow**		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	new order single	→		
			→	
	optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)			←
2	execution report ("Pending New", "Pending New")		←	
	Tagesende: vorläufige Bestätigung mit PendingReason 4 = "order status unknown (end of day)"			←
3	execution report ("Pending New", "Pending New")		←	

7.2.1.2 Request "NewOrderSingle"

7.2.1.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)

7.2.1.3 INVESTRO "classic“

7.2.1.4 Nr.	7.2.1.5 Auftragseinstellung positiv		7.2.1.6	7.2.1.7 messageflow	
7.2.1.8			7.2.1.9	7.2.1.10 FE Customer	7.2.1.11 BT FIX Gateway	7.2.1.12 INVESTRO
7.2.1.13 1	7.2.1.14 new order single	7.2.1.15	7.2.1.16	7.2.1.17 →	7.2.1.18	7.2.1.19
7.2.1.20	7.2.1.21		7.2.1.22	7.2.1.23	7.2.1.24 →	7.2.1.25
7.2.1.26	*7.2.1.27 endgültige Bestätigung positiv*		7.2.1.28	7.2.1.29	7.2.1.30	7.2.1.31 ←
7.2.1.32 2	7.2.1.33 execution report ("New", "New")		7.2.1.34	7.2.1.35	7.2.1.36 ←	7.2.1.37
7.2.1.38	7.2.1.39	7.2.1.40	7.2.1.41	7.2.1.42	7.2.1.43	7.2.1.44
7.2.1.45	*7.2.1.46 Nachricht an den Auftragsempfänger*		7.2.1.47	7.2.1.48	7.2.1.49	7.2.1.50 ←
7.2.1.51 3	7.2.1.52 execution report ("Order Status", "New")		7.2.1.53	7.2.1.54	7.2.1.55 ←	7.2.1.56
7.2.1.57	7.2.1.58	7.2.1.59	7.2.1.60	7.2.1.61	7.2.1.62	7.2.1.63
7.2.1.64 Nr.	7.2.1.65 Auftragseinstellung negativ		7.2.1.66	7.2.1.67 messageflow	
7.2.1.68			7.2.1.69	7.2.1.70 FE Customer	7.2.1.71 BT FIX Gateway	7.2.1.72 INVESTRO

7.2.1.73 1	7.2.1.74 new order single	7.2.1.75	7.2.1.76	7.2.1.77	7.2.1.78	7.2.1.79
7.2.1.80	7.2.1.81		7.2.1.82	7.2.1.83	7.2.1.84	7.2.1.85
7.2.1.86	*7.2.1.87 endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)*		7.2.1.88	7.2.1.89	7.2.1.90	7.2.1.91
7.2.1.92 2	7.2.1.93 execution report ("Rejected", "Rejected")		7.2.1.94	7.2.1.95	7.2.1.96	7.2.1.97

7.2.1.98 INVESTRO/Vestima

7.2.1.99 Nr.	7.2.1.100 positive Auftragseinstellung an INVESTRO/Vestima		7.2.1.101	7.2.1.102	7.2.1.103 messag
7.2.1.104			7.2.1.105	7.2.1.106	7.2.1.107 FE Custom
7.2.1.111 1	7.2.1.112 new order single	7.2.1.113	7.2.1.114	7.2.1.115	7.2.1.116
7.2.1.120	7.2.1.121	7.2.1.122	7.2.1.123	7.2.1.124	7.2.1.125
7.2.1.129	7.2.1.130	7.2.1.131	7.2.1.132	7.2.1.133	7.2.1.134
7.2.1.138	*7.2.1.139 Annahmebestätigung INVESTRO*		7.2.1.140	7.2.1.141	7.2.1.142
7.2.1.146 2	7.2.1.147 execution report ("Pending New", "Pending New")		7.2.1.148	7.2.1.149	7.2.1.150
7.2.1.154	*7.2.1.155 Annahmebestätigung Vestima*	7.2.1.156	7.2.1.157	7.2.1.158	7.2.1.159
7.2.1.163	7.2.1.164	7.2.1.165	7.2.1.166	7.2.1.167	7.2.1.168
7.2.1.172 3	7.2.1.173 execution report ("Pending New", "Pending New")		7.2.1.174	7.2.1.175	7.2.1.176
7.2.1.180	*7.2.1.181 optional Provision check*		7.2.1.182	7.2.1.183	7.2.1.184

~~7.2.1.188~~	~~7.2.1.189~~	~~7.2.1.190~~	~~7.2.1.191~~	~~7.2.1.192~~	~~7.2.1.193~~
~~7.2.1.197 4~~	~~7.2.1.198 execution report ("Pending New", "Pending New")~~		~~7.2.1.199~~	~~7.2.1.200~~	~~7.2.1.201~~
~~7.2.1.205~~	~~*7.2.1.206 optional, wenn OHA den Auftrag endgültig bestätigt*~~		~~7.2.1.207~~	~~7.2.1.208~~	~~7.2.1.209~~
~~7.2.1.213~~	~~7.2.1.214~~	~~7.2.1.215~~	~~7.2.1.216~~	~~7.2.1.217~~	~~7.2.1.218~~
~~7.2.1.222 5~~	~~7.2.1.223 execution report ("New", "New")~~		~~7.2.1.224~~	~~7.2.1.225~~	~~7.2.1.226~~

~~Anmerkungen:~~
~~Nr. 1-4: Nach jeder vorläufigen Bestätigung (pending new) kann noch eine Ablehnung (Rejection) des Auftrages erfolgen.~~
~~Exkurs Provision Check:~~
~~In Vestima gibt es zwei Varianten, die für den INVESTRO Teilnehmer konfiguriert werden können:~~
~~Variante 1: Wird bei der Prüfung auf Kontodeckung (redemption check) festgestellt, dass keine Deckung vorhanden ist, wird der Auftrag sofort abgelehnt und rejected.~~
~~Variante 2: Wird bei der Prüfung auf Kontodeckung (redemption check) festgestellt, dass keine Deckung vorhanden ist, wird der Auftrag 5 Tage vorgehalten und täglich geprüft, ob Deckung vorhanden ist. Ist nach 6 Tagen immer noch keine Deckung vorhanden, wird der Auftrag endgültig abgelehnt. Ansonsten werden zwei Provision-Check Nachrichten geliefert (erst negativ, dann positiv).~~
~~Bei der Variante 2 können folgende vorläufigen Bestätigungen erstellt werden:~~
~~Auftragsänderung in Vestima durch negativen Provisions-Check~~
~~Auftragsänderung in Vestima durch positiven Provisions-Check~~
~~Nr. 5: Der endgültige Status wird nur dann gesendet, wenn der Auftragsempfänger in Vestima den Auftrag bestätigt (Dieses Verhalten wird von Vestima konfiguriert und ist nicht zwingend für jeden Auftragsempfänger eingestellt):~~
~~Auftragseinstellung in Vestima durch Vestima-Depotbank positiv bestätigt~~
~~Auftragslöschung durch Vestima-Depotbank~~

Request "NewOrderSingle"

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "D" (MsgType)
<parties>		O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 1 – 6 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
<entering firm>		O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>		O	O	OOOOO	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben, fehlt die Gruppe, dann werden die Daten des Anschlussinhabers für die Transformationen verwendet
<market maker>		O	O	NOOOO	Daten, die den Orderempfänger beschreiben sind, nur für XONTROT7 GSE und MAX-ONE zulässig.Dieser Tag wird ignoriert. Für alle anderen Handelssysteme ignoriert
<intermediary>		O	O	NNNNO	Daten, die den Vertriebspartner beschreiben, nur für INVESTRONicht zulässig.
<systematic internaliser>		O	O	ONNNN	Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben. Nicht zulässig.
<client identification code>		O	O	NNOON	Identifikation des Kunden
<investment decision maker>		O	O	NNOON	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Investitionsentscheidung verantwortet.
<Execution within firm>		O	O	NNOON	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Orderausführung verantwortet.
end <parties>					
<instrument>		M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
<trading sessions>		O	O	ONOOO	Trading Session Information Relevant ist nur die TradingSessionSubID alternativ können auch die Einzeltags 336 und 625 geliefert Auch für FIX 4.2 kann die Repeating Group in dieser Form verwendet werden. Es ist zu beachten, dass der Aufbau der Gruppe der Version 4.4 entnommen ist und von der Definition der Version 4.2. abweicht
<OrderAttributes>		O	O	NNOON	Repeating Group für Order-Attribute
<ValueChecksGrp>		O	O	NNOON	Kennzeichen für die Prüfung auf den maximal für eine Order zulässigen Kurswert am Börsenplatz.
1	Account	O	O	MMOOO	String(2), aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number Möglicher Wertebereich: P1 – Eigengeschäft der Bank A1 – Kundengeschäft der Bank
11	ClOrdID	M	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom sendenden System vergeben werden muss. Der Identifier muss für die gesamte Lebensdauer der Order eindeutig sein. Wird vom BT-FIX Gateway überprüft

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7~~MI~~	Kommentare
21	HandlInst	M / O	M / O		Char für "FIX.4.2" mandatory für "FIX.4.4" optional Instructions for order handling on Broker trading floor Valid values: 1 = Automated execution order, private, no Broker intervention 2 = Automated execution order, public, Broker intervention OK 3 = Manual order, best execution Dieses Tag wird ignoriert
38	OrderQty	O	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen
40	OrdType	M	M		Char Zulässig sind ~~Xetra~~ ~~1 = "Market"~~ ~~2 = "Limit"~~ ~~3 = "Stop"~~ ~~4 = "Stop Limit"~~ ~~K = "Market with Leftover"~~ ~~P = "Pegged"~~ ~~Xetra Ffm-2,~~ MAX-ONE 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit" ~~XONTRO~~T7 GSE 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" ~~INVESTRO / Vestima~~ ~~1 = "Market"~~
44	Price	C	C		Price, Float(13,5) Orderlimit, muss bei Limitorders Tag 40 (OrdType) = "2", "4", "P" angegeben sein, darf bei anderen Werten von OrdType nicht angegeben sein.
54	Side	M	M		Char Seite der Order 1 = "Buy" 2 = "Sell"
58	Text	O	O	~~O~~OO~~O~~	String(2~~4~~5) ~~An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben~~

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7~~MI~~	Kommentare
59	TimeInForce	O	O	~~OOOO~~O	Char Zulässig sind ~~Xetra~~ ~~0 = "Day"~~ ~~3 = "Immediate or Cancel"~~ ~~4 = "Fill or Kill"~~ ~~6 = "Good till Date"~~ ~~INVESTRO / Vestima~~ ~~Dieses Tag wird ignoriert.~~ ~~alle anderen Systeme~~ 0 = "Day" 6 = "Good till Date" Default: "0"
60	TransactTime	M	M		UTC Timestamp Zeitstempel des sendenden Systems oder des Orderaufgebers Dieses Tag wird ignoriert
99	StopPx	O	O	~~CC~~CCC~~N~~	Price, Float(13,5) Stop Limit, muss bei Stop Orders Tag 40 (OrdType) = "3", "4" angegeben sein. Es darf bei anderen Werten von OrdType nicht angegeben sein.
100	ExDestination	O	M		Exchange MIC Code
110	MinQty	O	O	~~CN~~NNN~~N~~	Qty, Float(12,3) Minimal auszuführendes Volumen~~; ist nicht zulässig nur für Midpoint Orders zulässig (OrdType = "P")~~
432	ExpireDate	C	C		LocalMktDate Ordergültigkeit bis, muss bei Tag 59 = "6" angegeben sein, bei anderen Ausprägungen von TimeInForce nicht zulässig ~~Besonderheiten:~~ ~~XONTRO~~ ~~Zeichnungsaufträge~~ ~~Bei Zeichnungsaufträgen wird die Angabe im Feld ExpireDate nicht berücksichtigt.~~ ~~Das Gültigkeitsdatum wird vom System zu dem kleinsten von folgenden Werten gesetzt:~~ ~~- maximale Ordergültigkeit (360 Tage)~~ ~~- Datum des letzten Tilgungstermins~~ ~~Fondssegment Hannover~~ ~~Bei Orders im Fondssegment Hannover wird die Angabe im Feld ExpireDate nicht berücksichtigt.~~ ~~Das Gültigkeitsdatum wird vom System zu dem kleinsten von folgenden Werten gesetzt:~~ ~~- maximale Ordergültigkeit (360 Tage)~~ ~~- Datum des letzten Tilgungstermins~~ ~~-~~ ~~- Diese Fälle werden in der Response-Nachricht (Execution Report) über eindeutige Ausprägungen des Tags 9933 (CombinedOrderType) gekennzeichnet.~~

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7~~MI~~	Kommentare
					~~INVESTRO / Vestima~~ ~~Bei Fondsaufträgen wird die Angabe im Feld ExpireDate nicht berücksichtigt.~~ ~~Das Gültigkeitsdatum wird vom System auf die maximale Ordergültigkeit (360 Tage) gesetzt.~~
526	SecondaryClOrdID	O	O	~~OO~~OO~~O~~	String(16) Bankinterne Ordernummer Weiterer Identifier, der benutzt werden kann, um eine eigene Ordernummer des sendenden Systems oder des Orderaufgebers zu übermitteln. Wird vom BT-FIX Gateway selbst nicht geprüft. Es gelten aber die Regeln des jeweiligen Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systems. Die Eindeutigkeit wird nicht vom System geprüft.
1094	PegPriceType		O	~~C~~NNN~~N~~	Integer ~~Nur für Xetra Midpoint Orders anzugeben:~~ ~~2 = "Mid-price peg"~~ Ist ~~bei anderen Ausprägungen von OrdType~~ nicht zulässig.
1138	DisplayQty		O	~~C~~NNN~~N~~	Qty, Float(12,3) Ist nicht zulässig~~Nur für Xetra Iceberg Orders anzugeben, maximal sichtbares Volumen, darf nur bei Limitorders angegeben sein~~.
1724	OrderOrigination	O	O	~~NN~~OO~~N~~	Integer Kennzeichen für DEA (Direct Electronic Access). (ESMA RTS 24, Feld 2) 5 = DEA (Direct Electronic Access) Fehlendes Tag bedeutet „kein DEA“.
1815	TradingCapacity	O	O	~~NN~~OO~~N~~	Integer Handelsfunktion. (ESMA RTS 24, Feld 7) 1 = AOTC (Handel für Kunde) 5 = DEAL (Handel für eigene Rechnung) 6 = DEAL (Handel als Market Maker) 9 = MTCH (Zusammenführung sich deckender Kundenaufträge) Fehlendes Tag bedeutet „1=AOTC“
5076	FundReinvestIncome		O	~~NN~~NN~~O~~	Char ~~Y = Kauf zu Wiederanlage~~ ~~Space = sonstiges~~ ~~Nur für INVESTRO.~~Ist nicht zulässig.
5078	FundSpecialDealDiscount		O	~~NN~~NN~~O~~	Char ~~Y = Kauf zum Rücknahmepreis = (R)~~ ~~Space = sonstiges~~ ~~Nur für INVESTRO~~Ist nicht zulässig.
5156	UnreleasedDate		O	~~NNO~~N~~O~~ ~~N~~	LocalMktDate MAX-ONE Wird für die Kennzeichnung von Orders verwendet, die erst in der Zukunft gültig sind. Muss mit einem Wert >= aktueller Handelstag belegt sein. Jeder Wert > aktueller Handelstag wird akzeptiert, auch wenn dies kein gültiger Handelstag ist. Das tatsächliche Datum Gültig-Ab wird vom Handelssystem intern gesetzt. Der gesetzte Wert wird in der Response-Nachricht (auch im Tag 5156 - Feld Unreleased Date) geliefert.

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7MI	Kommentare
5253	OrdTypeExt		C	~~NNON~~O ~~N~~	Char Zulässig sind ~~XONTRO,~~ MAX-ONE E = "EG-Order" ~~Besonderheit nur für XONTRO:~~ ~~Das Kennzeichen EG-Order ist bei einer Folgetags-Order nicht erlaubt.~~
<standard message trailer>		M	M		

~~7.2.1.230~~7.2.1.3 Response "Execution Report" - Identifikationskriterien

Nachfolgend die FIX-Tags innerhalb des ExecutionReport zur Identifikation der Responses auf die Ordereinstellungen:

FIX Tags		Response auf die Ordereinstellung			
Tag	Feld	Vorläufig	Positiv	Negativ	Negativ (nur Vestima)
39	OrdStatus	A = "Pending New"	0 = "New"	8 = "Rejected"	4 = "Cancelled"
150	ExecType	A = "Pending New"	0 = "New"	8 = "Rejected"	4 = "Cancelled"
5946	PendingReason	~~1 = "buffered"~~ 2 = "locked stock" ~~3 = "response delayed"~~ 4 = "order status unknown (end of day)" ~~5 = "verification pending"~~	-	-	-
~~nur für Aufträge in Vestima Gattungen~~					
~~5048~~	~~OrdSubStatus~~	~~D = "provision check negativ"~~ ~~E = "provision check positiv"~~ ~~I = "order entry received in Vestima"~~	~~F = "enter confirmation from OHA"~~	-	~~G = "delete from Vestima"~~
~~5476~~	~~PrivateReference~~	~~"Order-Entry received in Vestima"~~ ~~"Provision check"~~	~~"OHA Confirmation - successful Order-Entry"~~	-	~~Text von Vestima (Erläuterung zu der Löschung)~~

~~7.2.1.23~~17.2.1.4 Response "Execution Report" - Nachrichtendaten

Der zugehörige New Order Single Request kann auch nur einen Party Eintrag enthalten (die Entering Firm agiert auch als Executing Firm). Im Execution Report werden in jedem Fall getrennte Einträge mit identischer PartyID erzeugt. Zusätzlich kann auch ein Eintrag für einen Market Maker generiert werden.

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "8" (MsgType)
<parties>		O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur die Werte 2 – 4 können vorkommen
<entering firm>		O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>		O	O	~~MM~~MM~~M~~	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
<market maker>		O	O	~~NO~~OO~~O~~	Daten, die den Orderempfänger beschreiben~~, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig~~
<intermediary>		O	O	~~NN~~NN~~O~~	Daten, die den Vertriebspartner beschreiben~~, nur für INVESTRO zulässig.~~. Wird nicht geliefert.
<systematic internaliser>		O	O	~~ON~~NN~~N~~	Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben. Wird nicht geliefert.
end <parties>					
<instrument>		M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
1	Account	O	O	~~MM~~OM~~O~~	String(2), aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number Wenn in der Request-Nachricht nicht vorhanden werden von den Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systemen Defaultwerte gesetzt
6	AvgPx	M	M		Schnittpreis, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt
11	ClOrdID	O	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags
14	CumQty	M	M		Qty, Float(12,3) Gesamtausführungsmenge, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt
17	ExecID	M	M		String eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig
37	OrderID	M	M		String(~~13~~20) Eindeutige Ordernummer des Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systems Wenn keine Ordernummer vorhanden wird "[N/A]" geliefert. Das ist der Fall bei Ablehnungen und bei vorläufigen Bestätigungen, die vor der Vergabe einer Ordernummer generiert werden.
38	OrderQty	O	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus 0 = "New" Einstellung endgültig positiv A = "Pending New" Einstellung vorläufig angenommen (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason) 8 = "Rejected" Einstellung abgelehnt Vestima 4 = "Cancelled" Ablehnung eines Auftrags durch Vestima-Depotbank (wird als Auftragslöschung übermittelt)
40	OrdType	O	M		Char Ordertyp
44	Price	C	C		Price, Float(13,5) Limit der Order Orderlimit, wird für OrdType "2", "4" und "P" belegt
54	Side	M	M		Char Seite der Order 1 = Buy 2 = Sell
58	Text	O	O	OOOOO	String(254) An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben Textfeld
59	TimeInForce	O	M		Char
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp [microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss] Zeitstempel des Handels- bzw. Abwicklungssystems
99	StopPx	C	O	CCCCN	Price, Float(13,5) Stop Limit, wird für OrdType "3" und "4" belegt
100	ExDestination	O	M		Exchange MIC Code Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt
110	MinQty	O	O	CNNNN	Qty, Float(12,3) Minimal auszuführendes Volumen. Wird nicht geliefert. wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt
150	ExecType	M	M		Char Art des Report 0 = "New" Einstellung endgültig positiv A = "Pending New" Einstellung vorläufig angenommen (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason) 8 = "Rejected" Einstellung abgelehnt INVESTRO I = "OrderStatus" Nachricht an den Auftragsempfänger bei einer positiven Einstellung (OrdStatus "New")

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
					Vestima 4 = "Cancelled" Ablehnung eines Auftrags durch Vestima-Depotbank (wird als Auftragslöschung übermittelt)
151	LeavesQty	M	M		Qty, Float(12,3) offene Menge der Order mit dem Gesamtvolumen belegt
336	TradingSessionID	O	O	ONOOO	String(1) Aus dem New Order Single Request immer mit Tag 625 zusammen verwendet enthält immer den Wert "1"
432	ExpireDate	O	M		LocalMktDate Ordergültigkeit bis nur bei TimeInForce = "6" belegt (Tag 59)
526	SecondaryClOrdID	O	O	OOOOO	String(16) Bankinterne Ordernummer
625	TradingSessionSubID	O	O	CNCCO	String immer mit Tag 336 zusammen verwendet
1094	PegPriceType		O	CNNNN	Integer Nur für Xetra Midpoint Orders wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt enthält immer den Wert "2"Wird nicht geliefert.
1138	DisplayQty		O	CNNNN	Qty, Float(12,3) Nur für Xetra Iceberg Orders, maximal sichtbares Volumen, darf nur bei Limitorders angegeben sein Wird nicht geliefert.
5048	OrdSubStatus		O	NNNNC	Char Wird nicht geliefert.Nur bei Nachrichten für Aufträge in Vestima-Gattungen belegt. Vestima Vorläufig (OrdStatus A = “Pending New“ PendingReson 5 = “verification pending”) I = “order entry received in Vestima” Auftragseinstellung in Vestima empfangen D = "provision check negativ" Auftragsänderung in Vestima durch negativen Provisions-Check E = "provision check positiv" Auftragsänderung in Vestima durch positiven Provisions-Check Endgültig positiv (OrdStatus 0 = “New“) F = "enter confirmation from OHA" Auftragseinstellung in Vestima durch Vestima-Depotbank positive bestätigt Endgültig negativ (OrdStatus 4 = “Cancelled“) G = "delete from Vestima" Auftragslöschung durch Vestima-Depotbank In diesem Fall wird OrdStatus = 4 und ExecType 4 ("Cancelled") geliefert
5076	FundReinvestIncome		O	NNNNO	Char Wird nicht geliefert.Y = Kauf zu Wiederanlage Nur für INVESTRO.

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
5078	FundSpecialDealDiscount		O	NNNNO	Char Wird nicht geliefert.Y = Kauf zum Rücknahmepreis = (R) Nur für INVESTRO.
5156	UnreleasedDate		O	NNOOO	LocalMktDate XONTRO, INVESTRO, MAX-ONE Datum Gültig-ab für Orders, die erst in der Zukunft gültig werden. Das Feld enthält der Börsentag, ab dem eine Order gültig ist. XONTRO Folgetagsorders, Fondssegment Hannover MAX-ONE Folgetagsorders INVESTRO Aufträge nach Annahmeschluss, ggf. unter Berücksichtigung des Emittenten- oder Gattungs-Feiertagskalenders.
5253	OrdTypeExt		C	NNONON	Char Zweiter Ordertyp für EG-Orders Zulässig sind XONTRO; MAX-ONE E = "EG-Order"
5476	PrivateReference		O	NNNNC	String Wird nicht geliefert.Ergänzung zu OrdSubStatus Vestima Vorläufig "Order-Entry received in Vestima" "provision check" Endgültig positiv "OHA Confirmation – successful Order-Entry" Endgültig negativ Text von Vestima – Erläuterung zu der Ablehnung des Auftrags
5689	VersionID		O	MMNNN	Integer(18) Wird nicht geliefert. Xetra, Xetra Ffm-2 Schlüssel zur Updatekontrolle

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
5946	Pending Reason		O	CCCCC	String das BT-FIX Gateway liefert immer Integer(1) Das Feld ist nur bei vorläufigen Bestätigungen ("Pending New" - OrdStatus = A, ExecType = A) belegt 1 = “buffered” Ordereingang wegen nicht verfügbarem Handelssystem vorgehalten (Xetra, Xetra Ffm-2) 2 = “locked stock” Ordereingang wegen Orderbuchsperre (XONTROT7 GSE, MAX-ONE) bzw. wegen Locked-Stock (Xetra, Xetra Ffm-2) vorgehalten. 3 = “response delayed (intraday)" keine Bestätigung vom Handelssystem innerhalb eines bestimmten, konfigurierbaren Zeitintervalls empfangen (Xetra, Xetra Ffm-2) 4 = “order status unknown (end of day)” Bis Ende des Handelstages wurde keine endgültige Bestätigung (positiv oder negativ) zum Ordereingang erhalten. Der Orderstatus ist unbekannt. 5 = “verification pending” XONTRO EG-Order vorläufig angenommen INVESTRO / Vestima Auftrag für eine Vestima-Gattung vorläufig angenommen.
9933	CombinedOrderType		O	NNONN	Char Wird nicht geliefert."Z" = Zeichnungsauftrag "H" = Fondssegment Hannover In den Fällen, in denen dieses Tag geliefert wird, wird das Gültigkeitsdatum der Order vom Handelssystem gesetzt und im Feld ExpireDate (Tag 432) geliefert. Das ExpireDate in der Request-Nachricht wird nicht berücksichtigt. Siehe weitere Details in der Beschreibung des Tags 432 (ExpireDate) bei der Request-Nachricht "NewOrderSingle"
	Folgende Felder sind nur bei Ablehnungen ("Rejected" - OrdStatus = 8, ExecType = 8) belegt				
5555	ReturnCode		O	CCCCC	Integer Returncode
9320	OrderRejectReasonTxt		O	CCCCC	String Fehlertext des Handels- bzw. Abwicklungssystems
9803	TradingSystemID		O	CCCCC	Integer Identifiziert das System, welches den Fehlercode erzeugt hat
<standard message trailer>		M	M		

7.2.2 Order~~- bzw. Auftrags~~löschung

7.2.2.1 Abläufe – Orders

Nr.	**Orderlöschung positiv**	**messageflow**		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")	→		
			→	
	optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)			←
2	execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")		←	
	endgültige Bestätigung positiv			←
3	execution report ("Canceled", "Canceled")		←	

Nr.	**Orderlöschung negativ**	**messageflow**		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")	→		
			→	
	optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)			←
2	execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")		←	
	endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)			←
3	order cancel reject ("Rejected")		←	

Nr.	**Orderlöschung ohne endgültige Bestätigung**	**messageflow**		
		FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")	→		
			→	
	optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)			←
2	execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")		←	
	Tagesende: vorläufige Bestätigung mit PendingReason 4 = "order status unknown (end of day)"			←
3	execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")		←	

Anmerkungen zum Messageflow:

Der Execution Report "Pending Replace" oder "Pending Cancel" bedeutet in Verbindung mit dem Completion Code 127650 (MODIFICATION/CANCELLATION ACCEPTED BUT TEMPORARILY POSTPONED), dass eine Orderänderung bzw. -löschung logisch bereits endültig, aber aus technichen Gründen vorübergend zurückgestellt ist. Der endgültige Execution Report der Bestätigung "Replace" oder "Canceled" folgt.

~~7.2.2.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)~~

~~7.2.2.3 INVESTRO "classic"~~

~~7.2.2.4~~	~~7.2.2.5~~ ~~Auftragslöschung positiv~~	~~7.2.2.6~~	~~7.2.2.7~~ ~~messageflow~~		
~~7.2.2.8~~		~~7.2.2.9~~	~~7.2.2.10~~ ~~FE Customer~~	~~7.2.2.11~~ ~~BT FIX Gateway~~	~~7.2.2.12~~ ~~INVESTRO~~
~~7.2.2.13~~	~~7.2.2.14~~ ~~order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")~~	~~7.2.2.15~~	~~7.2.2.16~~ →	~~7.2.2.17~~	~~7.2.2.18~~
~~7.2.2.19~~	~~7.2.2.20~~	~~7.2.2.21~~	~~7.2.2.22~~	~~7.2.2.23~~ →	~~7.2.2.24~~

7.2.2.25	7.2.2.26 *endgültige Bestätigung positiv*	7.2.2.27	7.2.2.28	7.2.2.29	7.2.2.30
7.2.2.31	7.2.2.32 execution report ("Canceled", "Canceled")	7.2.2.33	7.2.2.34	7.2.2.35	7.2.2.36
7.2.2.37	7.2.2.38	7.2.2.39	7.2.2.40	7.2.2.41	7.2.2.42	7.2.2.43
7.2.2.44	7.2.2.45 *Nachricht an den Auftragsempfänger*	7.2.2.46	7.2.2.47	7.2.2.48	7.2.2.49
7.2.2.50	7.2.2.51 execution report ("Order Status", "Canceled")	7.2.2.52	7.2.2.53	7.2.2.54	7.2.2.55
7.2.2.56	7.2.2.57	7.2.2.58	7.2.2.59	7.2.2.60	7.2.2.61	7.2.2.62
7.2.2.63	7.2.2.64	7.2.2.65	7.2.2.66	7.2.2.67	7.2.2.68	7.2.2.69

7.2.2.70	7.2.2.71 Auftragslöschung negativ	7.2.2.72	7.2.2.73 messageflow		
7.2.2.74		7.2.2.75	7.2.2.76 FE Customer	7.2.2.77 BT FIX Gateway	7.2.2.78 INVESTRO
7.2.2.79	7.2.2.80 order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")	7.2.2.81	7.2.2.82	7.2.2.83	7.2.2.84
7.2.2.85	7.2.2.86	7.2.2.87	7.2.2.88	7.2.2.89	7.2.2.90
7.2.2.91	7.2.2.92 *endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)*	7.2.2.93	7.2.2.94	7.2.2.95	7.2.2.96
7.2.2.97	7.2.2.98 order cancel reject ("Rejected")	7.2.2.99	7.2.2.100	7.2.2.101	7.2.2.102

7.2.2.103 INVESTRO/Vestima

7.2.2.104 Nr.	7.2.2.105 positive Auftragslöschung an INVESTRO/Vestima		7.2.2.106	7.2.2.107	7.2.2.108 messag
7.2.2.109			7.2.2.110	7.2.2.111	7.2.2.112 FE Custom
7.2.2.116 1	7.2.2.117 ordercancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")		7.2.2.118	7.2.2.119	7.2.2.120
7.2.2.124	7.2.2.125	7.2.2.126	7.2.2.127	7.2.2.128	7.2.2.129
7.2.2.133	7.2.2.134	7.2.2.135	7.2.2.136	7.2.2.137	7.2.2.138
7.2.2.142	*7.2.2.143 Annahmebestätigung INVESTRO*		7.2.2.144	7.2.2.145	7.2.2.146
7.2.2.150 2	7.2.2.151 execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")		7.2.2.152	7.2.2.153	7.2.2.154
7.2.2.158	*7.2.2.159 Validierung Vestima*	7.2.2.160	7.2.2.161	7.2.2.162	7.2.2.163
7.2.2.167	7.2.2.168	7.2.2.169	7.2.2.170	7.2.2.171	7.2.2.172
7.2.2.176 3	7.2.2.177 execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")		7.2.2.178	7.2.2.179	7.2.2.180
7.2.2.184	*7.2.2.185 Bestätigung der Löschung durch OHA*		7.2.2.186	7.2.2.187	7.2.2.188
7.2.2.192	7.2.2.193	7.2.2.194	7.2.2.195	7.2.2.196	7.2.2.197
7.2.2.201 4	7.2.2.202 execution report ("Canceled", "Canceled")		7.2.2.203	7.2.2.204	7.2.2.205
7.2.2.209	7.2.2.210	7.2.2.211	7.2.2.212	7.2.2.213	7.2.2.214
7.2.2.218	7.2.2.219	7.2.2.220	7.2.2.221	7.2.2.222	7.2.2.223
7.2.2.227 Nr.	7.2.2.228 negative Auftragslöschung an INVESTRO/Vestima		7.2.2.229	7.2.2.230	7.2.2.231 messag
7.2.2.232			7.2.2.233	7.2.2.234	7.2.2.235 FE Custom

7.2.2.239 1	7.2.2.240 ordercancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")		7.2.2.241	7.2.2.242	7.2.2.243
7.2.2.247	7.2.2.248	7.2.2.249	7.2.2.250	7.2.2.251	7.2.2.252
7.2.2.256	7.2.2.257	7.2.2.258	7.2.2.259	7.2.2.260	7.2.2.261
7.2.2.265	*7.2.2.266 Annahmebestätigung INVESTRO*		7.2.2.267	7.2.2.268	7.2.2.269
7.2.2.273 2	7.2.2.274 execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")		7.2.2.275	7.2.2.276	7.2.2.277
7.2.2.281	*7.2.2.282 Validierung Vestima*	7.2.2.283	7.2.2.284	7.2.2.285	7.2.2.286
7.2.2.290	7.2.2.291	7.2.2.292	7.2.2.293	7.2.2.294	7.2.2.295
7.2.2.299 3	7.2.2.300 execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")		7.2.2.301	7.2.2.302	7.2.2.303
7.2.2.307	*7.2.2.308 Ablehnung der Löschung durch OHA*		7.2.2.309	7.2.2.310	7.2.2.311
7.2.2.315	7.2.2.316	7.2.2.317	7.2.2.318	7.2.2.319	7.2.2.320
7.2.2.324 4	7.2.2.325 execution report ("Rejected", "Rejected")		7.2.2.326	7.2.2.327	7.2.2.328

7.2.2.332 Anmerkungen zum Messageflow:

7.2.2.333 Alle Löschungen werden von Vestima als Löschanfragen bewertet. Erst die Bestätigung der Löschung durch den Empfänger in Vestima führt zur Löschung des Auftrags in INVESTRO.

7.2.2.334 Auf alle Pending Cancel Nachrichten kann noch ein Reject der Cancelation erfolgen.

7.2.2.335 Nr. 2: Bestätigung, dass Löschung in INVESTRO empfangen und an Vestima weitergeleitet wurde

7.2.2.336 Nr. 3: Auftragslöschung in Vestima empfangen

7.2.2.337 Nr. 4: Auftragslöschung in Vestima durchgeführt (positiv) bzw. abgelehnt (negativ)

7.2.2.3387.2.2.2 Request "Order Cancel Request"

Wird die Order über die OrigClOrdID identifiziert, dann kann ExDestination fehlen. Ist das Tag vorhanden, dann muss es aber korrekt belegt sein. Wird OrderID zur Identifikation benutzt, dann muss ExDestination belegt sein. Die Angabe von ExDestination verbessert die Performance.

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7~~MI~~	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "F" (MsgType)
<parties>		O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 1 – 5 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
<entering firm>		O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>		O	O	~~OO~~OOO~~O~~	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben, fehlt die Gruppe, dann werden die Daten des Anschlussinhabers für die Transformationen verwendet
<client identification code>		O	O	~~NN~~OO~~N~~	Identifikation des Kunden
<investment decision maker>		O	O	~~NN~~OO~~N~~	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Investitionsentscheidung verantwortet.
<Execution within firm>		O	O	~~NN~~OO~~N~~	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Orderausführung verantwortet.
end <parties>					
<instrument>		M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
<OrderAttributes>		O	O	~~NN~~OO~~N~~	Repeating Group für Order-Attribute
11	ClOrdID	M	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom sendenden System vergeben werden muss. Der Identifier muss für die gesamte Lebensdauer der Order eindeutig sein. Wird vom BT-FIX Gateway geprüft
37	OrderID	O	C		String(~~13~~20) kann zur Identifikation einer Order verwendet werden, die OrigClOrdID muss in diesem Fall auf "[N/A]" gesetzt sein
38	OrderQty	M	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen Dieses Tag wird ignoriert
41	OrigClOrdID	M	M		String(16) ClOrdID des letzten erfolgreichen verarbeiteten FIX Requests zu dieser Order, falls auf "[N/A]" gesetzt, wird Tag 37 zur Identifikation der Order herangezogen.
54	Side	M	M		Char Seite der Order 1 = "Buy" 2 = "Sell" MAX-ONE akzeptiert einen Cancel Request auch bei einer falschen, aber formal korrekten Angabe
60	TransactTime	M	M		UTC Timestamp Zeitstempel des sendenden Systems oder des Orderaufgebers Dieses Tag wird ignoriert
100	ExDestination		O	~~OO~~OOO~~O~~	Exchange MIC Code

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7~~M~~I	Kommentare
5253	OrdTypeExt		OC	~~C~~OOO~~O~~	Char Alternativer Ordertyp Ist für ~~XONTRO,~~ MAX-ONE ~~oder INVESTRO~~ ein Wert angegeben, dann wird er ignoriert. Der Request wird akzeptiert. ~~Wird für Xetra Ffm-2 ein Wert angegeben, muss er mit dem Wert der Order übereinstimmen, das Tag ist jedoch optional~~ ~~Wird für Xetra ein Wert angegeben, muss er ebenfalls mit dem Wert der Order übereinstimmen.~~ ~~Ist die Order vom Typ "Stop", "Stop Limit", "Midpoint" oder "Iceberg" muss das Tag belegt sein~~ ~~Zulässig sind~~ ~~Xetra:~~ ~~1 = "Market"~~ ~~2 = "Limit"~~ ~~3 = "Stop"~~ ~~4 = "Stop Limit"~~ ~~K = "Market with Leftover"~~ ~~M = "Midpoint"~~ ~~I = "Iceberg"~~ ~~Xetra Ffm-2~~ ~~1 = "Market"~~ ~~2 = "Limit"~~ ~~3 = "Stop"~~ ~~4 = "Stop Limit"~~
6042	CxlReason	O	O	~~N~~~~N~~OO~~N~~	Integer Kennzeichnung einer Orderlöschung durch Kill-Funktionalität (MIFID II). 1 = Cancel durch Kill-Funktion
<standard message trailer>		M	M		

~~7.2.2.339~~7.2.2.3 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv~~, negativ von Vestima~~)

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "8" (MsgType)
<parties>		O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur der Wert 2 kann vorkommen
<entering firm>		O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>		O	O	~~MM~~MM~~M~~	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
end <parties>					
<instrument>		M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
6	AvgPx	M	M		Schnittpreis, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt
11	ClOrdID	O	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags. Der im Cancel Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
14	CumQty	M	M		Qty, Float(12,3) Gesamtausführungsmenge
17	ExecID	M	M		String eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig
37	OrderID	M	M		String(~~13~~20) Eindeutige Ordernummer des Handels~~- bzw. Abwicklugnssystems~~
38	OrderQty	M	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus 4 = "Canceled" Löschung endgültig positiv 6 = "Pending Cancel" Löschung vorläufig angenommen (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason) ~~Vestima~~ ~~8 = "Rejected"~~ ~~Auftragslöschung in Vestima durch Vestima OHA abgelehnt~~
41	OrigClOrdID	O	M		String(16) Der im Cancel Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
44	Price	O	O	~~NN~~CC~~O~~	Price, Float(13,5) Orderlimit, wird für OrdType "2", "4" und "P" belegt
54	Side	M	M		Char Seite der Order
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp [microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss] Zeitstempel des Handels ~~bzw. Abwicklungssystems~~

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
100	ExDestination		M		Exchange MIC Code
150	ExecType	M	M		Char Art des Report 4 = "Canceled" Löschung endgültig positiv 6 = "Pending Cancel" Löschung vorläufig angenommen (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason) ~~INVESTRO~~ ~~Nachricht an den Auftragsempfänger~~ ~~wird mit I = "OrderStatus" belegt.~~ ~~Nachricht an den Empfänger bei einer positiven Einstellung (OrdStatus "Canceled")~~ ~~Vestima~~ ~~8 = "Rejected"~~ ~~Auftragslöschung in Vestima durch Vestima OHA abgelehnt~~
151	LeavesQty	M	M		Qty, Float(12,3) offene Menge der Order mit "0" belegt
526	SecondaryClOrdID	O	O	~~OO~~OO~~O~~	String(16) Bankinterne Ordernummer
5048	OrdSubStatus		O	~~NN~~NN~~C~~	Char ~~Nur bei Nachrichten für Aufträge in Vestima-Gattungen belegt.~~ Wird nicht geliefert. ~~Vestima~~ ~~Vorläufig (OrdStatus 6 = "Pending Cancel"~~ ~~PendingReson 5 = "verification pending")~~ ~~A = "delete received in Vestima"~~ ~~Auftragslöschung in Vestima empfangen~~ ~~Endgültig positiv (OrdStatus 4 = "Canceled")~~ ~~B = "delete executed in Vestima"~~ ~~Auftragslöschung in Vestima durch Vestima OHA durchgeführt~~ ~~Endgültig negativ (OrdStatus 8 = "Rejected")~~ ~~C = "delete rejected in Vestima"~~ ~~Auftragslöschung in Vestima durch Vestima OHA abgelehnt~~
5476	PrivateReference		O	~~NN~~NN~~C~~	String Ergänzung zu OrdSubStatus. Wird nicht geliefert. ~~Vestima~~ ~~Vorläufig~~ ~~"delete request received in Vestima"~~ ~~Endgültig positiv~~ ~~"deletion processed by Vestima / OHA"~~ ~~Endgültig negative~~ ~~Text von Vestima – Erläuterung zu der Ablehnung der Auftragslöschung~~

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
5946	Pending Reason		O	~~CC~~CC~~C~~	String das BT-FIX Gateway liefert immer Integer(1) Das Feld ist nur bei vorläufigen Bestätigungen ("Pending Cancel" - OrdStatus = 6, ExecType = 6) belegt ~~1 = "buffered"~~ ~~Orderlöschung wegen nicht verfügbarem Handelssystem vorgehalten (Xetra, Xetra Ffm-2)~~ 2 = "locked stock" Orderlöschung wegen Orderbuchsperre (~~XONTRO~~T7 GSE, MAX-ONE) ~~bzw. wegen Locked-Stock (Xetra, Xetra Ffm-2)~~ vorgehalten. ~~3 = "response delayed (intraday)"~~ ~~keine Bestätigung vom Handelssystem innerhalb eines bestimmten, konfigurierbaren Zeitintervalls empfangen (Xetra, Xetra Ffm-2)~~ 4 = "order status unknown (end of day)" Bis Ende des Handelstages wurde keine endgültige Bestätigung (positiv oder negativ) zu der Orderlöschung erhalten. Der Orderstatus ist unbekannt. ~~5 = "verification pending"~~ ~~INVESTRO / Vestima~~ ~~Auftragslöschung für eine Vestima-Gattung vorläufig angenommen~~
<standard message trailer>		M	M		

~~7.2.2.3407~~.2.2.4 Response "Order Cancel Reject" (endgültig negativ)

Bei abgelehnten Orderlöschungen wird statt eines Execution Reports ein Order Cancel Reject versendet.

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "9" (MsgType)
<parties>			M		
453	NoPartyIDs		M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur der Wert 2 kann vorkommen
<entering firm>			M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>			O	~~OO~~OO~~O~~	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
end <parties>					
11	ClOrdID	M	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags Der im Cancel Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
37	OrderID	M	M		String(1320) Eindeutige Ordernummer des Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systems Das Tag kann fehlen oder mit [N/A] belegt sein
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus wird mit 8 = "Rejected" belegt
41	OrigClOrdID	M	M		String(16) Der im Cancel Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp Zeitstempel des Handels ~~bzw. Abwicklungs~~systems
100	ExDestination		M		Exchange MIC Code Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt
102	CxlRejReason	O	M		Integer wird mit 99 = "Other" belegt, falls kein passender Reason Code vorhanden ist. In diesem Fall liefert Tag 5555 einen Fehlercode und Tag 9320 einen Fehlertext
434	CxlRejResponseTo	M	M		Char 1 = "Order Cancel Request"
5555	ReturnCode		M		Integer Returncode
9320	OrderRejectReasonTxt		M		String Fehlertext des Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systems
9803	TradingSystemID		M		Integer Identifiziert das System, welches den Returncode erzeugt hat
<standard message trailer>		M	M		

7.2.3 Order~~- bzw. Auftrags~~änderung

7.2.3.1 Abläufe – Orders

Nr.	**Orderänderung positiv**		**messageflow**		
			FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel/replace ("ClOrdID", "OrigClOrdID")		→		
				→	
	optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)				←
2	execution report ("Pending Replace", "Pending Replace")			←	
	endgültige Bestätigung positiv				←
3	execution report ("Replace", aktueller Orderstatus)			←	

Nr.	**Orderänderung negativ**		**messageflow**		
			FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel/replace ("ClOrdID", "OrigClOrdID")		→		
				→	
	optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)				←
2	execution report ("Pending Replace", "Pending Replace")			←	
	endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)				←
3	order cancel reject ("Rejected")			←	

Nr.	**Orderänderung ohne endgültige Bestätigung**		**messageflow**		
			FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
1	order cancel/replace ("ClOrdID", "OrigClOrdID")		→		
				→	
	optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)				←
2	execution report ("Pending Replace", "Pending Replace")			←	
	Tagesende: vorläufige Bestätigung mit PendingReason 4 = "order status unknown (end of day)"				←
3	execution report ("Pending Replace", "Pending Replace")			←	

Anmerkungen zum Messageflow:

Der Execution Report "Pending Replace" oder "Pending Cancel" bedeutet in Verbindung mit dem Completion Code 127650 (MODIFICATION/CANCELLATION ACCEPTED BUT TEMPORARILY POSTPONED), dass eine Orderänderung bzw. -löschung logisch bereits endültig, aber aus technichen Gründen vorübergend zurückgestellt ist. Der endgültige Execution Report der Bestätigung "Replace" oder "Canceled" folgt.

~~7.2.3.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)~~

~~Nr.~~	~~**Auftragsänderung negativ**~~	-	~~**messageflow**~~		
-		-	~~FE Customer~~	~~BT FIX Gateway~~	~~INVESTRO~~
~~1~~	~~order cancel/replace ("ClOrdID", "OrigClOrdID")~~	-	→	-	-
-	-	-	-	→	-
-	~~*endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)*~~	-	-	-	←
~~2~~	~~order cancel reject ("Rejected")~~	-	-	←	-

~~7.2.3.3~~7.2.3.2 Request "Order Cancel Replace Request"

Üblicherweise muss ein Cancel/Replace Request alle Felder der Order liefern. Das BT-FIX Gateway unterstützt dieses Verhalten, lässt aber - als alternative Erweiterung - auch zu, dass nur die zu ändernden optionalen Tags gesendet werden. Mandatory Tags müssen immer angegeben werden, die Behandlung von conditional mandatory Tags ist der Requestbeschreibung zu entnehmen. Die Bemerkung "**nicht änderbar**" ist als Hinweis zu verstehen. Das BT-FIX Gateway kann dies nicht prüfen, die Felder werden immer weitergegeben.

~~Änderungen von INVESTRO-/Vestima-Aufträgen sind nicht möglich.~~
~~Order Cancel/Replace Requests mit ExDestination "XINV" (INVESTRO) werden immer abgelehnt.~~

Wird die zu ändernde Order über die OrigClOrdID identifiziert, dann kann ExDestination fehlen. Ist das Tag vorhanden, dann muss es aber korrekt belegt sein. Wird OrderID zur Identifikation benutzt, dann muss ExDestination belegt sein.

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "G" (MsgType)
<parties>		O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 2 – 6 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
<entering firm>		O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>		O	O	~~M~~MM~~-~~	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben, fehlt die Gruppe, dann werden die Daten des Anschlussinhabers für die Transformationen verwendet
<market maker>		O	O	~~N~~OO~~-~~	Daten, die den Orderempfänger beschreiben. ~~Wird nicht geliefert., nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig~~ ~~Wird für alle anderen Handelssysteme ignoriert~~
<systematic internaliser>		O	O	~~O~~NN~~-~~	Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben. Ist nicht zulässig.
<client identification code>		O	O	~~N~~OO~~N~~	Identifikation des Kunden
<investment decision maker>		O	O	~~N~~OO~~N~~	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Investitionsentscheidung verantwortet.
<Execution within firm>		O	O	~~N~~OO~~N~~	Mitarbeiter oder Algorithmus des Handelsteilnehmers, der die Orderausführung verantwortet.
end <parties>					
<instrument>		M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
<trading sessions>		O	O	~~O~~NO~~-~~	Trading Session Information Relevant ist nur die TradingSessionSubID alternativ können auch die Einzeltags 336 und 625 geliefert werden Auch für FIX 4.2 kann die Repeating Group in dieser Form verwendet werden. Es ist zu beachten, dass der Aufbau der Gruppe der Version 4.4 entnommen ist und von der Definition der Version 4.2. abweicht
<OrderAttributes>		O	O	~~N~~OO~~N~~	Repeating Group für Order-Attribute

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7~~M~~I	Kommentare
<ValueChecksGrp>		O	O	~~NN~~OO~~N~~	Kennzeichen für die Prüfung auf den maximal für eine Order zulässigen Kurswert am Börsenplatz.
1	Account	O	O	~~MM~~NN-	String(2), aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number Nicht änderbar Möglicher Wertebereich: P1 – Eigengeschäft der Bank A1 – Kundengeschäft der Bank
11	ClOrdID	M	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom sendenden System vergeben werden muss. Der Identifier muss für die gesamte Lebensdauer der Order eindeutig sein. Wird vom BT-FIX Gateway geprüft
21	HandlInst	M / O	M / O		Char für "FIX.4.2" mandatory für "FIX.4.4" optional Instructions for order handling on Broker trading floor Valid values: 1 = Automated execution order, private, no Broker intervention 2 = Automated execution order, public, Broker intervention OK 3 = Manual order, best execution Dieses Tag wird ignoriert
37	OrderID	O	C		String(~~13~~20) Ordernummer des Handelssytems nicht änderbar kann zur Identifikation einer Order verwendet werden, die OrigClOrdID muss in diesem Fall auf "[N/A]" gesetzt sein
38	OrderQty	O	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen incl. ausgeführter Menge Bei ~~XONTRO~~T7 GSE und MAX-ONE entspricht dies der Ursprungsnominalen. Eine Änderung der Oty ist nicht möglich. ~~XONTRO~~T7 GSE Der Request wird abgelehnt wenn die OrderQty und die Ursprungsnominale der Order nicht übereinstimmen. ~~Xetra, Xetra Ffm-2,~~ MAX-ONE Das Tag wird ignoriert.

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
40	OrdType	M	M		Char Zulässig sind ~~Xetra:~~ ~~1 = "Market"~~ ~~2 = "Limit"~~ ~~3 = "Stop"~~ ~~4 = "Stop Limit"~~ ~~K = "Market with Leftover"~~ ~~P = "Pegged"~~ ~~Xetra Ffm-2,~~ MAX-ONE 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit" ~~XONTROT~~7 GSE 1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop"
41	OrigClOrdID	M	M		String(16) ClOrdID des letzten erfolgreichen verarbeiteten FIX Requests zu dieser Order, falls auf "N/A" gesetzt, wird Tag 37 zur Identifikation der Order herangezogen
44	Price	O	C		Price, Float(13,5) Orderlimit, muss bei Limitorders Tag 40 (OrdType) = "2", "4", "P" angegeben sein
54	Side	M	M		Char Seite der Order 1 = "Buy" 2 = "Sell" nicht änderbar
58	Text	O	O	~~OO~~OO-	String(2~~5~~4) ~~An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben~~
59	TimeInForce	O	O	~~OO~~OO-	Char Zulässig ist: 6 = Good till Date kein Default, soll das Gültigkeitsdatum einer Order geändert werden, dann muss das Tag mit "6" belegt sein, Tag 432 muss den neuen Wert enthalten
60	TransactTime	M	M		UTC Timestamp Zeitstempel des sendenden Systems oder des Orderaufgebers. Dieses Tag wird ignoriert
99	StopPx	O	O	~~CC~~CC-	Price, Float(13,5) Stop Limit, muss bei Stop Orders Tag 40 (OrdType) = "3", "4" angegeben sein
100	ExDestination	O	O	~~OO~~OO-	Exchange MIC Code nicht änderbar
432	ExpireDate	O	C		LocalMktDate Ordergültigkeit bis, bei Änderungen der Ordergültigkeit anzugeben, siehe Tag 59

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7MI	Kommentare
526	SecondaryClOrdID	O	O	~~OO~~OO~~-~~	String(16) Bankinterne Ordernummer Weiterer Identifier, der benutzt werden kann, um eine eigene Ordernummer des sendenden Systems oder des Orderaufgebers zu übermitteln. Wird vom BT-FIX Gateway nicht geprüft. Die Eindeutigkeit wird nicht vom System geprüft.
1094	PegPriceType		O	~~C~~NNN~~-~~	Integer ~~Nur für Xetra Midpoint Orders anzugeben:~~ ~~2 = "Mid-price peg"~~Ist nicht zulässig.
1138	DisplayQty		O	~~C~~NNN~~-~~	Qty, Float(12,3) ~~Nur für Xetra Iceberg Orders anzugeben, maximal sichtbares Volumen~~Ist nicht zulässig.
1724	OrderOrigination	O	O	~~N~~NOO~~N~~	Integer Kennzeichen für DEA (Direct Electronic Access). (ESMA RTS 24, Feld 2) 5 = DEA (Direct Electronic Access) Fehlendes Tag bedeutet „kein DEA“.
5689	VersionID		O	~~OO~~NN~~-~~	Integer(18) ~~Xetra, Xetra Ffm-2~~ ~~Schlüssel zur Updatekontrolle~~Ist nicht zulässig.
6126	OrigLeavesQty		O	~~N~~NOO~~-~~	Qty, Float(12,3) Noch ausführbare Menge zur Updatekontrolle Wird eine Prüfung der noch ausführbaren Nominale der Order gewünscht dann, dann muss diese im Tag 6126 mitgegeben werden (nur ~~XONTRO~~T7 GSE) Ansonsten ist das Tag nicht erforderlich
<standard message trailer>		M	M		

~~7.2.3.4~~7.2.3.3 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv)

Ein Cancel/Replace Request kann auch nur einen Party Eintrag enthalten (die Entering Firm agiert auch als Executing Firm). Im Execution Report werden in jedem Fall getrennte Einträge mit identischer PartyID erzeugt. Zusätzlich kann auch ein Eintrag für einen Market Maker generiert werden.

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "8" (MsgType)
<parties>		O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur die Werte 2 – 3 können vorkommen
<entering firm>		O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>		O	O	~~OO~~OO~~-~~	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
<market maker>		O	O	~~N~~OO~~-~~	Daten, die den Orderempfänger beschreiben~~, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig.~~
end <parties>					
<instrument>		M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
1	Account	M	M		String(2), aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number
6	AvgPx	M	M		Schnittpreis, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt
11	ClOrdID	O	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags- Aus dem Order Cancel/Replace Request übernommen
14	CumQty	M	M		Qty, Float(12,3) Gesamtausführungsmenge
17	ExecID	M	M		String eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig
37	OrderID	M	M		String(~~1~~320) Eindeutige Ordernummer des Handelssystems ~~Die Ordernummer kann wechseln (Xetra, Xetra Ffm-2). Ist dies der Fall, dann verbleiben alle bisher verwendeten ClOrdIDs bei der alten Ordernummer. Die "neue" Order muss über Tag 37 identifiziert werden~~
38	OrderQty	O	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus 0 = „New“ Änderung durchgeführt (endgültig) wird je nach Status der Order belegt Änderung vorläufig angenommen E = "Pending Replace" (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason)
40	OrdType	O	M		Char Ordertyp
41	OrigClOrdID	O	M		String(16) Aus dem Request kopiert ClOrdID des letzten erfolgreichen Requests zu dieser Order, falls der zugehörige Request die Order über Tag 41 identifiziert hat. Wurde die Order über Tag 37 identifiziert, enthält Tag 41 "[N/A]"
44	Price	C	C		Price, Float(13,5) Limit der Order
54	Side	M	M		Char Seite der Order
58	Text	O	O	~~OO~~OO~~-~~	String(2~~5~~4) ~~An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben~~ Textfeld
59	TimeInForce	O	O	~~MM~~OO~~-~~	Char
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp [microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss] Zeitstempel des Handelssystems
99	StopPx	C	O	~~CC~~CC~~-~~	Price, Float(13,5) Stop Limit

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7~~MI~~	Kommentare
100	ExDestination		M		Exchange MIC Code Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt
150	ExecType	M	M		Char Art des Report Änderung durchgeführt (endgültig) 5 = "Replace" Änderung vorläufig angenommen E = "Pending Replace" (genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason)
151	LeavesQty	M	M		Qty, Float(12,3) offene Menge der Order
336	TradingSessionID	O	O	~~ON~~OO-	String(1) immer mit Tag 625 zusammen verwendet "1" oder fehlend
432	ExpireDate	O	C		LocalMktDate Ordergültigkeit bis
526	SecondaryClOrdID	O	O	~~OO~~OO-	String(16) Bankinterne Ordernummer
625	TradingSessionSubID	O	O	~~CN~~CC-	String immer mit Tag 336 zusammen verwendet
1094	PegPriceType		O	~~CN~~NN-	Integer ~~Nur für Xetra Midpoint Orders~~Ist nicht zulässig.
1138	DisplayQty		O	~~CN~~NN-	Qty, Float(12,3) ~~Nur für Xetra Iceberg Orders, maximal sichtbares Volumen~~Ist nicht zulässig.
5689	VersionID		O	~~MM~~NN-	Integer(18) ~~Schlüssel zur Updatekontrolle~~Ist nicht zulässig.
5946	Pending Reason		O	~~CC~~CC~~C~~	String das BT-FIX Gateway liefert immer Integer(1) Das Feld ist nur bei vorläufigen Bestätigungen ("Pending Replace" - OrdStatus = E, ExecType = E) belegt ~~1 = "buffered"~~ ~~Orderänderung wegen nicht verfügbarem Handelssystem vorgehalten (Xetra, Xetra Ffm-2)~~ 2 = "locked stock" Orderänderung wegen Orderbuchsperre (~~XONTRO, MAX-ONE) bzw. wegen Locked-Stock (Xetra, Xetra Ffm-2)~~ vorgehalten. ~~3 = "response delayed (intraday)"~~ ~~keine Bestätigung vom Handelssystem innerhalb eines bestimmten, konfigurierbaren Zeitintervalls empfangen (Xetra, Xetra Ffm-2)~~ 4 = "order status unknown (end of day)" Bis Ende des Handelstages wurde keine endgültige Bestätigung (positiv oder negativ) zu der Orderänderung erhalten. Der Orderstatus ist unbekannt.
<standard message trailer>		M	M		

~~7.2.3.5~~7.2.3.4 Response "Order Cancel Reject" (endgültig negativ)

Statt eines Execution Reports wird ein Order Cancel Reject versendet.

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "9" (MsgType)
<parties>			M		
453	NoPartyIDs		M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur der Wert 2 kann vorkommen
<entering firm>			M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>			O	~~MM~~MM~~M~~	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
end <parties>					
11	ClOrdID	M	M		String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags Der im Order Cancel/Replace Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
37	OrderID	M	M		String(~~13~~20) Eindeutige Ordernummer des Handelssystems Das Tag kann fehlen oder mit [N/A] belegt sein
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus wird mit 8 = "Rejected" belegt
41	OrigClOrdID	M	M		String(16) Der im Order Cancel/Replace Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp Zeitstempel des Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systems
100	ExDestination		M		Exchange MIC Code Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt
102	CxlRejReason	O	M		Integer wird mit 99 = "Other" belegt, falls kein passender Reason Code vorhanden ist. In diesem Fall liefert Tag 5555 einen Fehlercode und Tag 9320 einen Fehlertext
434	CxlRejResponseTo	M	M		Char mit 2 = "Order Cancel/Replace Request"
5555	ReturnCode		M		Integer Returncode
9320	OrderRejectReasonTxt		M		String Fehlertext des Handels~~- bzw. Abwicklungs~~ systems
9803	TradingSystemID		M		Integer Identifiziert das System, welches den Returncode erzeugt hat
<standard message trailer>		M	M		

7.2.4 Order~~- bzw. Auftrags~~ausführung

7.2.4.1 Abläufe – Orders

Nr.	**Teilausführung**		**messageflow**		
			FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
	Teilausführung				
1	execution report ("Trade", "Partially Filled")			←	

Nr.	**Vollausführung**		**messageflow**		
			FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
	Vollausführung				
1	execution report ("Trade", "Filled")			←	

7.2.4.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)

7.2.4.3 INVESTRO "classic“

7.2.4.4 Nr.	7.2.4.5 Vollausführung		7.2.4.6	7.2.4.7 messageflow	
7.2.4.8			7.2.4.9	7.2.4.10 FE Customer	7.2.4.11 BT FIX Gateway	7.2.4.12 INVESTRO
7.2.4.13	7.2.4.14 *Vollausführung*		7.2.4.15	7.2.4.16	7.2.4.17	7.2.4.18
7.2.4.19 1	7.2.4.20 execution report ("Trade", "Filled")		7.2.4.21	7.2.4.22	7.2.4.23	7.2.4.24
7.2.4.25	7.2.4.26	7.2.4.27	7.2.4.28	7.2.4.29	7.2.4.30	7.2.4.31
7.2.4.32	7.2.4.33 *Nachricht an den Auftragsempfänger*		7.2.4.34	7.2.4.35	7.2.4.36	7.2.4.37
7.2.4.38 2	7.2.4.39 execution report ("Order Status", "Filled")		7.2.4.40	7.2.4.41	7.2.4.42	7.2.4.43

7.2.4.44

7.2.4.45 INVESTRO/Vestima

7.2.4.46 Nr.	7.2.4.47 Auftragsausführung und Storno		7.2.4.48	7.2.4.49	7.2.4.50 messag
7.2.4.51			7.2.4.52	7.2.4.53	7.2.4.54 FE Custom
7.2.4.58	7.2.4.59 *Auftragsausführung*		7.2.4.60	7.2.4.61	7.2.4.62
7.2.4.66	7.2.4.67	7.2.4.68	7.2.4.69	7.2.4.70	7.2.4.71
7.2.4.75 1	7.2.4.76 execution report ("Trade"; "Filled")	7.2.4.77	7.2.4.78	7.2.4.79	7.2.4.80
7.2.4.84	7.2.4.85 *Stornierung Auftragsausführung*		7.2.4.86	7.2.4.87	7.2.4.88

~~7.2.4.92~~	~~7.2.4.93~~	~~7.2.4.94~~	~~7.2.4.95~~	~~7.2.4.96~~	~~7.2.4.97~~
~~7.2.4.101~~ 2	~~7.2.4.102 execution report ("Restated", "Filled")~~	~~7.2.4.103~~	~~7.2.4.104~~	~~7.2.4.105~~	~~7.2.4.106~~
~~7.2.4.110~~	~~*7.2.4.111 neue Auftragsausführung*~~		~~7.2.4.112~~	~~7.2.4.113~~	~~7.2.4.114~~
~~7.2.4.118~~	~~7.2.4.119~~	~~7.2.4.120~~	~~7.2.4.121~~	~~7.2.4.122~~	~~7.2.4.123~~
~~7.2.4.127~~ 3	~~7.2.4.128 execution report ("Restated", "Filled")~~		~~7.2.4.129~~	~~7.2.4.130~~	~~7.2.4.131~~

~~7.2.4.135~~7.2.4.2 Nachricht zur Orderausführung "Execution Report"

Der zugehörige New Order Single Request kann auch nur einen Party Eintrag enthalten (die Entering Firm agiert auch als Executing Firm). Im Execution Report werden in jedem Fall getrennte Einträge mit identischer PartyID erzeugt. Zusätzlich kann auch ein Eintrag für einen Market Maker generiert werden.

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "8" (MsgType)
<parties>		O	M		
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt Nur die Werte 1 –3 können vorkommen
<entering firm>		O	M		Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben
<executing firm>		O	O	~~OO~~OOO~~O~~	Daten, die den Orderaufgeber beschreiben
<market maker>		O	O	~~N~~OOO~~O~~	Daten, die den Orderempfänger beschreiben.~~, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig~~
<systematic internaliser>		O	O	~~O~~NNN~~N~~	~~Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben~~Wird nicht geliefert.
end <parties>					
<instrument>		M	M		Zu handelndes Instrument als ISIN
<RegulatoryTradeIDGrp>		O	O	~~N~~NMM~~N~~	TVTIC (Trading venue transaction identifier)
6	AvgPx	M	M		Schnittpreis, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt
11	ClOrdID	O	M		String(16) Eindeutiger Identifier eines Requests. Eingesetzt wird der Wert, der im letzten für diese Order erfolgreichen FIX Request geliefert wurde. ~~Vestima~~ ~~Bei Nachrichten mit Tag 150 (ExecType) D (Restated) enthält die ClOrdID immer "[N/A]"~~
14	CumQty	M	M		Qty, Float(12,3) Gesamtausführungsmenge
15	Currency	O	O	~~OO~~OO~~O~~	Currency Handels-Währung am gehandelten Börsenplatz

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
17	ExecID	M	M		String eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig
31	LastPx	M	M		Price, Float(13,5) Preis der Ausführung
32	LastQty	M	M		Qty, Float(12,3) Volumen der Ausführung
37	OrderID	M	M		String(~~13~~20) Eindeutige Ordernummer des Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systems
38	OrderQty	O	M		Qty, Float(12,3) Ordervolumen (Gesamtvolumen der Order)
39	OrdStatus	M	M		Char OrderStatus ~~XONTRO, MAX-ONE, Xetra, Xetra Ffm-2~~ 1 = "Partially Filled" Teilausführung 2 = "Filled" Vollausführung ~~INVESTRO / Vestima~~ ~~2 = "Filled" Vollausführung~~ ~~(Teilausführungen sind nicht möglich)~~
44	Price	C	O	~~CC~~CN~~N~~	Price, Float(13,5) Limit der Order, wird für OrdType "2", "4" und "P" belegt. Fehlt für das Handelssystem MAX-ONE
54	Side	M	M		Char Seite der Order 1 = "Buy“ 2 = "Sell“
59	TimeInForce	O	M		Char
60	TransactTime	O	M		UTC Timestamp [microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss] Zeitstempel des Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systems
64	SettlDate	O	O	~~NN~~OO~~O~~	LocalMktDate ~~XONTRO, MAX-ONE~~ Valutadatum bei Ausführungen, die vor dem Emissionstermin erfolgen. ~~INVESTRO / Vestima~~ ~~SettlementDate von Vestima.~~ ~~Xetra, Xetra Ffm-2~~ ~~Das Feld wird nicht geliefert~~
99	StopPx	C	C		Price, Float(13,5) Stop Limit, wird für OrdType "3" und "4" belegt
100	ExDestination		M		Exchange MIC Code Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt
110	MinQty	O	O	~~C~~NNN~~N~~	Qty, Float(12,3) ~~Minimal auszuführendes Volumen~~ ~~wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt~~Wird nicht geliefert.

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7~~M~~I	Kommentare
150	ExecType	M	M	~~MM~~MM~~C~~	Char Art des Report alle Systeme das Feld mit F = "Trade" belegt (Nachrichten an den Orderaufgeber) ~~INVESTRO classic~~ ~~Bei Nachrichten an den Auftragsempfänger wird das Feld mit I = "OrderStatus" belegt~~ ~~Vestima~~ ~~wird in folgenden Fällen mit D = "Restated" belegt:~~ ~~- zur Kennzeichnung der Stornierung einer Auftragsausführung durch Vestima~~ ~~oder~~ ~~- zur Kennzeichnung einer Auftragsausführung von Vestima nach dem einer vorherigen Ausführung storniert wurde~~ ~~Bei ExecType = D wird das Tag 11 (ClOrdID) mit "[N/A]" belegt.~~
151	LeavesQty	M	M		Qty, Float(12,3) offene Menge der Order bei Teilausführung 0 bei Vollausführung
157	NumDaysInterest	O	O	~~OO~~OO~~N~~	Integer Stückzinstage analog FIX 4.4 Tag 157 auch für FIX.4.2
432	ExpireDate	O	M		LocalMktDate Ordergültigkeit bis
526	SecondaryClOrdID	O	O	~~OO~~OO~~O~~	String(16) Bankinterne Ordernummer
1094	PegPriceType		O	~~C~~NNN~~N~~	Integer ~~wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt~~Wird nicht geliefert.
1138	DisplayQty		O	~~C~~NNN~~N~~	Qty, Float(12,3) ~~Nur für Xetra Iceberg Orders, maximal sichtbares Volumen~~Wird nicht geliefert.
5048	OrdSubStatus		O	~~NN~~NN~~C~~	Char Wird nicht geliefert. ~~Nur für INVESTRO / Vestima~~ ~~"H" = disabled für die "Kennzeichnung der (Vestima-) Stornierung einer Auftragsausführung".~~ ~~In diesem Fall ist Tag 150 (ExecType) = D.~~ ~~Das Tag 11 (ClOrdID) wird mit [N/A] belegt.~~
5689	VersionID		O	~~M~~MNNN~~N~~	Integer(18) Wird nicht geliefert. ~~Xetra, Xetra Ffm-2~~ ~~Schlüssel zur Updatekontrolle~~
5944	InitialDisplayQty		O	~~C~~NNN~~N~~	Qty, Float(12,3) ~~Enthält für Iceberg Orders das ursprünglich eingestellte, maximal sichtbare Volumen~~Wird nicht geliefert.
~~6584~~	~~SpreadPctPremium~~		~~O~~	~~NNNNO~~	~~Float(5,3)~~ ~~Bonifikationssatz~~
6585	SpreadPctDiscount		O	~~NN~~NN~~O~~	Float(10,7) Wird nicht geliefert.~~Wiederanlagerabatt in Prozent~~
6611	TotalAccruedInterestAmt		O	~~NN~~NN~~O~~	Float(17,8) Wird nicht geliefert.~~Akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag~~

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
6893	Profit		O	NNNNO	Float(15,8) Wird nicht geliefert.Zwischengewinn
7491	CustomPrice1		O	NNNNO	Float(15,8) Wird nicht geliefert.Ausgabepreis Wird nur belegt wenn bei der Auftrags-Aufgabe die Tags 5076 oder 5078 belegt waren.
7680	OTCInd		M		Integer Kennzeichen börslich 0 = börslich 1 = außerbörslich
9583	MIFIDInternalizationIndicator		O	OONNN	Char Wird nicht geliefert.Xetra Best Trade Indikator
<standard message trailer>		M	M		

7.2.5 Auslösung einer Aktion über ein anderes Interface

7.2.5.1 Einstellungen, Änderungen und Löschungen von Orders bzw. Aufträgen

Einstellungen, Änderungen, Löschungen von Orders bzw. Aufträgen, die für einen FIX-Teilnehmer relevant sein können, können auch über andere Interfaces als das FIX Interface ausgelöst werden:

- ~~Dialog~~T7 GUIs ~~XONTRO~~T7 GSE, ~~INVESTRO,~~ MAX-ONE
- ~~Systemanschluss~~ ETI Gateway ~~Makler~~Spezialist ~~XONTRO~~T7 GSE
- MAX-ONE GUIs MAX-ONE
- ~~Xetra GUIs Xetra, Xetra Ffm-2~~
- ~~SAKI-Eingaben INVESTRO~~
- ~~Eingaben von Vestima OIs INVESTRO~~

Nachrichten an FIX Teilnehmer werden generiert, wenn das Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system eine (vorläufige oder endgültige) **positive Response** am auslösenden Interface generiert. Ist dies der Fall, dann wird ein FIX Teilnehmer auch über alle systemseitig veranlassten Folgeaktivitäten informiert. Entscheidend ist, ob die erste (auslösende) Aktion akzeptiert wird. Dies bedeutet, dass zum Beispiel für eine mit Status "Pending" akzeptierte Orderänderung, die nach Auflösung eines Locked-Stock Zustand abgelehnt wird, ein Execution Report vom Typ "Rejected" an den FIX Teilnehmer verschickt wird. Die Diskussion kann sich auf den Execution Report beschränken. Andere Nachrichtentypen sind nicht betroffen.

Der Execution Report entspricht weitestgehend der Antwort auf einen erfolgreich durchgeführten FIX-Request.

Der Execution Report für jeden Nachrichtentyp wird in folgenden Kapiteln beschrieben:

- Ordereinstellung 7.2.1.4~~7.2.1.5~~ Response "Execution Report" - Nachrichtendaten
- Orderänderung 7.2.3.3~~7.2.3.4~~ Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv)~~Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv)~~
- Orderlöschung 7.2.2.3~~7.2.2.4~~ Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv~~, negativ von Vestima~~)

Die Abweichungen im Execution Report (im Vergleich zu Antworten auf FIX Requests) sind:

- Im <parties> Component Block wird ein zusätzlicher Eintrag für die PartyRole **session** erzeugt.
- Der Execution Report liefert OrigClOrdID = [N/A] (Tag 41) und in ClOrdID (Tag 11) den Identifikationsbegriff des letzten erfolgreich durchgeführten Requests, der über das FIX Interface übermittelt wurde (falls vorhanden).

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
Im <parties> Component Block (Tag 453 wird erhöht)					
448	<session> PartyID		M		String KVNr bzw. MemberID des Eingebers
447	PartyIDSource		M		Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole		M		Integer wird mit 55 = "Session ID" belegt
802	NoPartySubIDs		M		NumInGroup wird mit "1" belegt
523	PartySubID		M		String(6) wird mit den letzten 6 Stellen des Identifikationsbegriffs des Eingebers belegt
803	PartySubIDType		M		Integer wird mit "4040" belegt (User Identifier)
11	ClOrdID		M		String(16) Identifikationsbegriff des letzten erfolgreich durchgeführten Requests, der über das FIX Interface übermittelt wurde (falls vorhanden), ansonsten "[N/A]“
41	OrigClOrdID		M		String(16) wird mit "[N/A]" belegt

7.2.5.2 Eingaben über die Investro-Funktion „Sammelerfassung von Aufträgen“

Bei Eingaben über die Investro-Funktion „Sammelerfassung von Aufträgen“ werden ExecutionReports verschickt, wenn der Auftrags-Aufgeber ein FIX-Teilnehmer ist.

Dies ist unabhängig davon, ob der Auftrags-Aufgeber Investro-TN ist oder nicht.

Die Feldbelegung im ExecutionReport entspricht der Beschreibung im Kapitel 7.2.5.1 Einstellungen, Änderungen und Löschungen von Orders.

~~7.2.5.3~~7.2.5.2 Umsetzung einer Stop Order

Bei der Umsetzung einer Stop Order wird ein Execution Report generiert.

Der Execution Report entspricht der Antwort auf einen erfolgreich durchgeführten Cancel/Replace Request (vgl. 7.2.3.3~~7.2.3.4~~ Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv)) mit folgenden Abweichungen:

- OrdStatus = 0 - “New“ (Tag 39).
- Im <parties> Component Block wird ein zusätzlicher Eintrag für die PartyRole **executing system** erzeugt.
- Der Execution Report liefert OrigClOrdID = [N/A] (Tag 41) und in ClOrdID (Tag 11) den Identifikationsbegriff des letzten erfolgreich durchgeführten Requests, der über das FIX Interface übermittelt wurde (falls vorhanden).
- Das Tag 6489 (TriggerIndicator) wird geliefert

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7MI	Kommentare
Im <parties> Component Block (Tag 453 wird erhöht)					
448	<executing system> PartyID		M		String mögliche Werte sind ~~XETRA~~ ~~XETRA-2~~ ~~XONTROT7 GSE~~ MAX-ONE
447	PartyIDSource		M		Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole		M		Integer wird mit 16 = "Executing System" belegt
802	NoPartySubIDs		M		NumInGroup wird mit "1" belegt
523	PartySubID		M		String wird mit "[N/A]" belegt
803	PartySubIDType		M		Integer wird mit 3 belegt (System)
11	ClOrdID		M		String(16) Identifikationsbegriff des letzten erfolgreich durchgeführten Requests, der über das FIX Interface übermittelt wurde (falls vorhanden), ansonsten "[N/A]“
39	OrdStatus		M		Char OrderStatus 0 = "New"
41	OrigClOrdID		M		String(16) wird mit "[N/A]" belegt
6489	TriggerIndicator		C	~~CC~~CC~~-~~	Char "Y" = Trigger Stop Order (fehlt bei der Antwort auf einen normalen Cancel/Replace)

~~7.2.5.4~~7.2.5.3 Aktivierung einer EG-Order

Wenn die Aktivierungsregel für eine EG-Order erfüllt ist, wird diese vom zuständigen Spezialisten~~skontroführenden Makler~~ aktiviert.

Für diese Aktion wird ein ExecutionReport verschickt. Dieser entspricht weitgehend demjenigen, der für eine Orderänderung über ein externes Interface verschickt wird (vgl. 7.2.5.1 Einstellungen, Änderungen und Löschungen von Orders).

In diesem Fall wird zusätzlich das Tag 6489 (TriggerIndicator) geliefert.

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7MI	Kommentare
6489	TriggerIndicator		C	~~NN~~CC-	Char ~~Nur XONTRO und~~ MAX-ONE "A" = Aktivierung einer EG-Order

~~7.2.5.5 Zurücksetzen einer bereits aktivierten EG-Order auf den ursprünglichen Status "EG"~~

~~Eine als EG-Order eingestellte Order, die bereits aktiviert wurde, kann in XONTRO nachträglich vom skontroführenden Makler wieder auf den Status EG zurückgesetzt werden.~~

~~Für diese Aktion wird ein ExecutionReport verschickt. Dieser entspricht weitgehend demjenigen, der für eine Orderänderung über ein externes Interface verschickt wird (vgl. 7.2.5.1 Einstellungen, Änderungen und Löschungen von Orders).~~

~~In diesem Fall werden zusätzlich die Tags 5253 (OrdTypeExt) und 6489 (TriggerIndicator) geliefert.~~

~~Tag~~	~~Feldname~~	~~RF~~	~~R~~	~~XEOMI~~	~~Kommentare~~
~~5253~~	~~OrdTypeExt~~		~~C~~	~~NNCN-~~	~~Char~~ ~~Nur XONTRO~~ ~~"E" = EG-Order~~
~~6489~~	~~TriggerIndicator~~		~~C~~	~~NNCN-~~	~~Char~~ ~~Nur XONTRO~~ ~~"B" = Order auf EG zurückgesetzt~~

7.2.6 Systemgenerierte Orderänderungen und Löschungen

In verschiedenen Situationen werden von den Handelssystemen Orders geändert und gelöscht:

- Stammdatenänderungen — Änderungen, Löschungen
- Kursaussetzungen — Löschungen
- Nebenrechte — Änderungen, Löschungen
- ~~Nicht akzeptierte EG-Orders (XONTRO) — Löschungen~~
- Orderverfall (MAX-ONE, T7 GSE, ~~Xetra, Xetra Ffm-2~~) — Löschungen
- ~~Kassaspitze wegen Teilausführung (XONTRO) — Änderungen, Löschungen~~
- ~~FOK, IOC und Market-to-Limit Orders (Xetra, Xetra Ffm-2) — Löschungen (Restnominale)~~
- Eingaben ~~vom Superuser~~der Marktsteuerung — Änderungen, Löschungen

Versendet werden in diesen Fällen Execution Reports, welche weitgehend denjenigen entsprechen, die als Antwort auf einen Cancel/Replace bzw. einen Cancel Request verschickt werden mit folgenden Abweichungen:

- Zusätzlicher Eintrag für die PartyRole **executing system** im <parties> Component Block.
- Zusätzliches Tag 5862 UpdateReason, welches den Änderungs- bzw. Lösch-Grund beinhaltet.
- Bei Löschungen wegen Orderverfall erhalten die FIX Nachrichten zusätzlich einen abweichenden OrdStatus "C" ("expired") und ExecType "C" ("expired").

Die vom Handelssystem ~~XONTROT~~7 GSE im Rahmen der Tagesendeverarbeitung geänderten und gelöschten Orders werden am nächsten Morgen an das jeweilige OMS übertragen.

~~Keine Orderänderungen oder -Löschungen erfolgen bei Zeichnungssperre.~~

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7MI	Kommentare
Im <parties> Component Block (Tag 453 wird erhöht)					
448	<executing system> PartyID		M		String mögliche Werte sind ~~XETRA~~ ~~XETRA-2~~ ~~XONTROT~~7 GSE MAX-ONE
447	PartyIDSource		M		Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole		M		Integer wird mit 16 = "Executing System" belegt
802	NoPartySubIDs		M		NumInGroup wird mit "1" belegt
523	PartySubID		M		String wird mit "[N/A]" belegt
803	PartySubIDType		M		Integer wird mit "3" belegt (System)
39	OrdStatus		M		Char OrderStatus wird bei Löschung wegen Orderverfall mit "C" belegt (expired)
150	ExecType		M		Char Art des Report wird bei Löschung wegen Orderverfall mit "C" belegt (expired)

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
5862	UpdateReason (zukünftig gültige Werte werden zu einem späteren Zeitpunkt bekanngegeben)		O	~~OO~~OO~~N~~	String(15) Grund der systemgenerierten Order-Änderung bzw. – Löschung Stammdatenänderungen "SBSL" = Entfall der SB/SL Fähigkeit der Gattung "MSEG" = Marktsegmentwechsel "EREO" = Datum der Redenominierung "ENOT" = Einstellung der Notierung "MBKS" = Änderung Kassa-Notierung (Mindestbetrag, kleinste handelbare Einheit, Inkrement) "MBVA" = Änderung Variabel-Notierung (Mindestbetrag, kleinste handelbare Einheit, Inkrement) "KSVA" = Notierung von Kassa auf Variabel "KSKH" = Einstellung Notierung Kassa "VAKS" = Notierung von Variabel auf Kassa "VAKH" = Einstellung Notierung Variabel "VKKS" = Kassa und Variabel auf Kassa "VKVA" = Kassa und Variabel auf Variabel "VKKH" = Einstellung Kassa- und Variabel-Notierung "LHBR" = Ende des Bezugsrechtshandels Nebenrechte "EXBR" = Ex Bezugsrecht "EXBA" = Ex Berichtigungsaktien "EXDI" = Ex Dividendenausschüttung "EXAG" = Ex Ausschüttung "EXDA" = Ex Dividendenausschüttung (Auslandsaktien) "EXSP" = Ex Split bei ausländischen Aktien "EXRS" = Ex Reversesplit "EXZS" = Ex Zinsen "EXAZ" = Ex Ausgleichszahlung "EXBO" = Ex Bonusrecht "EABC" = Ex Verschiedene Rechte "HL" = Hinweis (Orderlöschung) "HA" = Hinweis (Limitabschlag) "WKNA" = ISIN-Änderung Weitere Ereignisse ~~"SYSV" = Löschung nicht akzeptierter EG Order~~ "AUSG" = Kursaussetzung ~~"_Z" = Kursaussetzung mit dem Zusatz "gestrichen Ziehung"~~ ~~"XETRABATCH" = Xetra Batch (Löschung, Orderverfall)~~ ~~"XETRAGENERATED" = Löschung Restnominale (FOK, IOC oder MTL Orders)~~ ~~"SUPERUSER" = Eingabe durch den Superuser~~ ~~"KASSASPITZE" = Kassaspitze wegen Teilausführung~~ "ORDEREXPIRED" = Orderverfall ~~in MAX-ONE~~

7.2.7 Componenten Blocks und Repeating Groups

Es werden ausschließlich die folgenden Component Blocks/Repeating Groups der Version 4.4 verwendet:

- Instrument
- Parties
- Trading Sessions
- Order Attributes
- Value Checks
- Regulatory TradeID

7.2.7.1 Instrument Component Block <instrument>

Eingehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEQ7MI	Kommentare
55	Symbol	O	M		String **ignoriert**
48	SecurityID	O	M		String ISIN
22	SecurityIDSource	O	M		String muss immer = "4" sein

Ausgehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEQ7MI	Kommentare
55	Symbol	O	M		String Wird vom BT-FIX Gateway auf "[N/A]" gesetzt
48	SecurityID	O	M		String ISIN
22	SecurityIDSource	O	M		String Wird vom BT-FIX Gateway auf "4" gesetzt

Der Instrument Component Block wird mit <instrument> referenziert.

7.2.7.2 Party Konzept <parties>

Der "Parties" Component Block wird zur Beschreibung sämtlicher Teilnehmer eines Vorgangs verwendet. Die einzelnen Teilnehmer werden in getrennten Repeating Groups beschrieben.

Der Parties Component Block wird mit <parties> referenziert, die einzelnen Repeating Groups mit <entering firm>, <executing firm>, <market maker>, ~~<systematic internaliser>,~~ <session>, <executing system>, <Client Identification Code>, <Execution within Firm>, <Investment Decision Maker>.

Beispiel:
<entering firm> bedeutet eine Repeating Group innerhalb des Parties Component Block mit PartyRole 7 (Entering Firm).

Eingehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 1 – 6 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
448	PartyID	O	M		String **PartyRole=1** (**Executing Firm**) String(4), zugelassene KVNr des Orderaufgebers **PartyRole=3 (Client Identification Code)** String(20), Shortcode. (ESMA RTS24 Feld 3) Spezielle Werte: 1 = AGGR 2 = PNAL **PartyRole=7 (Entering Firm)** String(4), KVNr des Anschlussinhabers **PartyRole=12 (Execution within Firm)** String(20), Shortcode oder Algorithmus. (ESMA RTS24 Feld 5) Spezielle Werte: 3 = NORE ~~**PartyRole=29 (Intermediary)**~~ ~~String(10) numerisch, INVESTRO-Vertriebspartner~~ ~~**PartyRole=63 (Systematic Internaliser)**~~ ~~String(5), Xetra MemberID~~ **PartyRole=66 (Market Maker)** String(4), KVNr des ~~Makler~~Spezialisten **PartyRole=122 (Investment Decision Maker)** String(20), Shortcode oder Algorithmus. (ESMA RTS24 Feld 4)
447	PartyIDSource	O	M		Char PartyIDSource=D (KVNr), wenn PartyRole gleich 1 = "Executing Firm" 7 = "Entering Firm" ~~29 = "Intermediary"~~ ~~63 = "Systematic Internaliser"~~ 66 = "Market Maker" PartyIDSource=P (Shortcode), wenn PartyRole gleich 3 = "Client Identification Code“ 12 = "Execution within Firm“ 122 = "Investment Decision Maker“

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7~~M~~I	Kommentare
452	PartyRole	O	M		Integer muss mit einem der Werte 1 = "Executing Firm" 3 = "Client Identification Code“ 7 = "Entering Firm" 12 = "Execution within Firm“ ~~29 = "Intermediary"~~ ~~63 = "Systematic Internaliser"~~ 66 = "Market Maker", wird ignoriert 122 = " Investment Decision Maker“ belegt sein
2376	PartyRoleQualifier	O	O	~~N~~NOO~~N~~	Integer 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. 22 = „Algorithmus“ Kennzeichnet die PartyID als Algorithmus. Nur erlaubt für PartyRoles 12 = "Execution within Firm“ 122 = "Investment Decision Maker“ 23 = „LEI (Legal Entity Identifier)“ Kennzeichnet die PartyID als Shortcode für einen LEI Nur erlaubt für PartyRole 3 = "Client Identification Code“ 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“

Ausgehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 1 – 5 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
448	PartyID	O	M		String **PartyRole=1** (**Executing Firm**) String(4), zugelassene KVNr des Orderaufgebers **PartyRole=7 (Entering Firm)** String(4), KVNr des Anschlussinhabers **PartyRole=16 (Executing System)** folgende Belegung ist möglich: ~~"XETRA"~~ ~~"XETRA-2"~~ "~~XONTRO~~T7 GSE" "MAX-ONE" ~~"INVESTRO"~~ ~~**PartyRole=29 (Intermediary)**~~ ~~String(10) numerisch, INVESTRO-Vertriebspartner~~ **PartyRole=55 (Session ID)** String(4), KVNr des Eingebers ~~String(5), Xetra MemberID des Eingebers~~ ~~**PartyRole=63 (Systematic Internaliser)**~~ ~~String(5), Xetra MemberID~~ **PartyRole=66 (Market Maker)** String(4), KVNr des ~~Makler~~Spezialisten
447	PartyIDSource	O	M		Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole	O	M		Integer wird mit einem der Werte 1 = "Executing Firm" 7 = "Entering Firm" 16 = "ExecutingSystem" ~~29 = "Intermediary"~~ 55 = "Session ID" ~~63 = "Systematic Internaliser"~~ 66 = "Market Maker", wird ignoriert belegt
802	NoPartySubIDs	O	C		NumInGroup wird mit "1" belegt oder fehlt. Nur für PartyRole 16 und 55 zulässig
523	PartySubID	O	C		String wird für PartyRole 55 mit dem Identifikationsmerkmal des Eingebers bei Eingabe über ein anderes Interface belegt. Wird für PartyRole 16 auf "[N/A]" gesetzt
803	PartySubIDType	O	C		Integer wird für PartyRole 55 mit "4040" belegt (User Identifier) wird für PartyRole 16 mit "3" belegt (System)

7.2.7.3 Trading Sessions Repeating Group <trading sessions>

Nur bei eingehenden Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7M~~I~~	Kommentare
386	NoTradingSessions	O	O	~~OO~~OO~~O~~	NumInGroup **ignoriert** Nur der Wert "1" ist zulässig Ist das Tag vorhanden, dann müssen die Tags 336 und 625 direkt folgen
336	TradingSessionID	O	O	~~OO~~OO~~O~~	String(1) **ignoriert** Nur der Wert "1" ist zulässig muss vorhanden sein, falls Tag 386 vorhanden ist muss vorhanden sein, falls Tag 625 vorhanden ist
625	TradingSessionSubID	O	O	~~OO~~OO~~O~~	String muss vorhanden sein, falls Tag 336 vorhanden ist Zulässig sind ~~Xetra, Xetra Ffm-2~~ ~~2 = "Opening auction only"~~ ~~3 = "Main trading"~~ ~~4 = "Closing auction only"~~ ~~6 = "Main auction"~~ ~~100 = "Auction only"~~ ~~101= "End-of-day auction"~~ ~~102 = "Pending for next auction"~~ ~~103 = "Closing crossing"~~ ~~104 = "Accept surplus~~ ~~105 = "Special auction"~~ ~~XONTRO~~T7 GSE ~~2 = "Opening auction only" (EK - EK-Order)~~ 6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order) MAX-ONE 6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order) ~~INVESTRO / Vestima~~ ~~Das Feld wird ignoriert~~ Die Belegung der Werte entspricht den FIX 5.0 Definitionen

Statt der Repeating Group <trading sessions> - die immer nur aus einer Instanz bestehen darf – können alternativ auch die einzelnen Tags TradingSessionID (336) und TradingSessionSubID (625) verwendet werden. Das Tag NoTradingSessions (386) darf dann nicht vorhanden sein.

Die Trading Sessions Repeating Group wird mit <trading sessions> referenziert.

7.2.7.4 Order Attribute Repeating Group <OrderAttributes>

Nur bei eingehenden Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7MI	Kommentare
2593	NoOrderAttributes	O	O	~~NN~~OO~~N~~	NumInGroup Anzahl der Order-Attribute. Nur die Werte 1 – 3 sind zulässig. Der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen.
2594	OrderAttributeType	O	O	~~NN~~OO~~N~~	Integer Art des Attributes. 0 = AGGR (Aggregated Order) Die Angabe dieses Attributes schließt die gleichzeitige Angabe der Party <client identification code> aus. (ESMA RTS 24 Feld 3) 1 = PNAL (Pending Allocation) Die Angabe dieses Attributes schließt die gleichzeitige Angabe der Party <client identification code> aus. (ESMA RTS 24 Feld 3) 2 = Liquidity provision activity order (ESMA RTS 24 Feld 8) Nur in NewOrderSingle-Nachricht erlaubt. 6 = NORE Die Angabe dieses Attributes schließt die gleichzeitige Angabe der Party <Execution within firm> aus. (ESMA RTS 24 Feld 5)
2595	OrderAttributeValue	O	O	~~NN~~OO~~N~~	String(1) Wert zum OrderAttributeType Y = Yes

7.2.7.5 Value Checks Repeating Group <ValueChecksGrp>

Nur bei eingehenden Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	~~XEO~~7MI	Kommentare
1868	NoValueChecks	O	O	~~NN~~OO~~N~~	NumInGroup Anzahl der enthaltenen ValueCheck-Einträge. Nur der Wert 1 ist zulässig.
1869	ValueCheckType	O	O	~~NN~~OO~~N~~	Integer Art des Attributes. 1 = Prüfung auf maximal zulässigen Kurswert am Börsenplatz (ESMA RTS 7 Opt-Out-Flag)
1870	ValueCheckAction	O	O	~~NN~~OO~~N~~	Integer Wert zum ValueCheckType 0 = keine Prüfung 1 = Prüfung durchführen (Default)

7.2.7.6 Regulatory TradeID Repeating Group <RegulatoryTradeIDGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEQ7MI	Kommentare
1907	NoRegulatoryTradeID	O	O		NumInGroup Nur der Wert 1 ist zulässig.
1903	RegulatoryTradeID	O	O		String(52) TVTIC (Trading venue transaction identifier) Derie T7 GSE TVTIC setzt sich zusammen aus: Envir Flag (1) + SecurityID (20) + TranTime (20) + DealType (1) + MatchStepID (10) MAX-ONE TVTIC: Segment MIC (4 Stellen) + ISIN (12 Stellen) + Börsentag (8 Stellen) + UTC-Zeit Kursbestätigung (12 Stellen)
1906	RegulatoryTradeIDType	O	O		Integer Art der Regulatory TradeID 5 = TVTIC (Trading venue transaction identifier)

7.2.8 Besonderheiten der Tag Behandlung

Fehlerhafte Tags eines New Order Single Requests werden in einem Execution Report immer zurückgegeben.

Werden im Rahmen eines erfolgreichen New Order Single Defaultwerte gesetzt, dann werden sie in den Execution Report übernommen. Optionale Tags des Execution Report sind darüber hinaus nur belegt, wenn sie auch im Request vorhanden waren.

Wird eine Order über ein anderes Interface als das FIX Interface eingestellt, dann werden, in bestimmten Fällen, optionale Tags auch dann übermittelt, wenn sie keine signifikanten Werte enthalten, ein Client muss folglich in diesen Konstellationen in der Lage sein Nachrichteninhalte wie 12=0 oder 526=" " zu verarbeiten.

Diese Aussagen gelten auch für Cancel/Replace Requests - soweit dies im Fall abgelehnter Requests bei der eingeschränkten Informationsmenge der Cancel Reject Nachricht möglich ist.

Nachlaufende Spaces werden vom BT-FIX Gateway entfernt; besteht ein Tag nur aus Spaces dann bleibt ein Space erhalten.

Beispiel:

Eine Order wird geändert: der Ordertext wird von "ungleich SPACE" auf "SPACE" geändert.

Diese Änderung wird als ExecutionReport mit Tag 58 = " " übermittelt. Damit ist es eindeutig, dass der neue Ordertext SPACE ist.

Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima) - Besonderheiten

7.2.9 Nachrichten an den Auftragsempfänger (INVESTRO "classic")

Bei positiven Einstellungen und Löschungen von Aufträgen und bei Auftragsausführungen werden “Execution Reports“ für den Auftragsempfänger generiert.

Diese entsprechen denjenigen, die für die Einstellung und Löschung von Orders über ein anderes Interface und für die Ausführung von Orders verschickt werden (vgl. 7.2.5 Auslösung einer Aktion über ein anderes Interface, 7.2.4 Order- bzw. Auftragsausführung) mit folgenden Abweichungen:

1. Kennzeichnung der Nachrichten an den Empfänger

   Tag 150 (ExecType) = I (Order Status)

   Im <parties> Component Block wird ein zusätzlicher Eintrag für die PartyRole **executing system** mit PartyID “INVESTRO“ erzeugt.

   Damit ist es eindeutig, ob bei einer empfangenen Nachricht die Bank Aufgeber oder Empfänger des Auftrags ist.

2. Folgende Felder werden dem Empfänger nicht geliefert

SecondaryClOrdID	Tag 526	Bankinterne Ordernummer
Text	Tag 58	Ordertext
PartyID / PartySubID (FIX 4.4)	Tags 448 / 523	ID-KZ des Eingebers (User Identifier)
Source (FIX 4.2)	Tag 5177	ID-KZ des Eingebers (User Identifier)
SpreadPctPremium	Tag 6584	Bonifikationssatz
SpreadPctDiscount	Tag 6585	Wiederanlagerabatt in Prozent
TotalAccruedInterestAmt	Tag 6611	Akkum. ausschüttungsgleicher Ertrag
Profit	Tag 6893	Zwischengewinn
CustomPrice1	Tag 7491	Ausgabepreis

Tag	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentare
Im <parties> Component Block (Tag 453 wird erhöht)					
448	<executing system> PartyID		M		String INVESTRO
447	PartyIDSource		M		Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole		M		Integer wird mit 16 = "Executing System" belegt
802	NoPartySubIDs		M		NumInGroup wird mit "1" belegt
523	PartySubID		M		String wird mit "[N/A]" belegt
803	PartySubIDType		M		Integer wird mit "3" belegt (System)
150	ExecType		M		Char Art des Report wird mit "I" belegt (Order Status)

~~7.2.10 Auftragsrouting an INVESTRO mit Vestima-Gattungen~~

~~7.2.10.1 Direkte Ablehnung in INVESTRO~~

~~Auftragseinstellungen und -Löschungen für Vestima Gattungen werden beim Eingang in INVESTRO formal geprüft.~~

~~Bei formalen Fehlern (z.B. fehlende Pflichtfelder) werden diese an Vestima nicht weitergeleitet, sondern direkt abgelehnt (vgl. 7.2.1 Order- bzw. Auftragseinstellung und 7.2.2 Order- bzw. Auftragslöschung).~~

~~7.2.10.2 Übergabe an Vestima~~

~~Nachrichten für Vestima Gattungen werden generell vorläufig bestätigt. Erst nach der Rückmeldung von Vestima wird eine endgültige Bestätigung (positiv oder negativ) ausgegeben.~~

~~Zusätzlich können von Vestima Statusänderungen (Prüfungen auf Kontendeckung) zu einem Auftrag geliefert werden, die an die FIX-Teilnehmer als vorläufige Nachrichten weitergegeben werden.~~

~~In den oben beschriebenen vorläufigen Bestätigungen werden Execution Reports (Pending-Nachrichten) mit Pending-Reason = 5 (Verification Pending) generiert.~~

~~Weitere Information über den Auftragsstatus wird über die FIX-Tags 5048 (OrdSubStatus) und 5476 (PrivateReference) geliefert.~~

~~Es ist möglich, dass ein Auftrag von Vestima ausgeführt wird (Mitteilung über SWIFT-Nachricht MT515) und später die Ausführung storniert wird (MT515 CANCEL). Nach dem Storno kann von Vestima wieder eine Ausführung generiert werden (neuer MT515).~~

~~Die Information zu den SWIFT-Nachrichten MT515 bzw. MT515-CANCEL wird über ExecutionReports mit speziellen Ausprägungen der Tags 39 (OrdStatus), 150 (ExecType) und 5048 (OrdSubStatus) übermittelt.~~

7.3 Ereignisse

7.3.1 Abläufe

Nr.	Ereignis		messageflow		
			FE Customer	BT FIX Gateway	Handelssystem
	Ereignis				
1	news				

7.3.2 Ereignismitteilung "News"

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
<standard message header>		M	M		Tag 35 = "B" (MsgType)
<LinesOfTextGrp>		O	M		
<InstrmtGrp>		O	O		
148	Headline		M		String Ereignisschlüssel - FIXOF Kursaussetzung ~~bzw. Zeichnungssperre~~ - FIXON Rücknahme der Kursaussetzung ~~bzw. Zeichnungssperre~~ ~~- TREXP Verlängerung der Börsenzeit für eine Börse~~ - TRINT Unterbrechung der Kursfeststellung - TRSTA Freigabe der Kursfeststellung - BOINT Unterbrechung der Börsenversammlung - NBSTA Freigabe der Börsenversammlung - BOEND, EHEND, ~~XEBAT~~ Handelssystem-spezifische "Ende"-Nachrichten
<routingGrp>		O	M		
6255	EndTime		O	~~O~~OO~~O~~	String Ende Börsenzeit (Ereignis TREXP) Format „HHMM0000“
6516	NewsValidUntil		O	~~O~~OO~~O~~	LocalMktDate Datum bis
6517	NewsEventDate		O	~~O~~OO~~O~~	LocalMktDate Datum bzw. Datum ab
<standard message trailer>		M	M		

7.3.3 NoLinesOfText Repeating Group <LinesOfTextGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEO7MI	Kommentare
33	LinesOfText		M		NumInGroup Anzahl Zeilen mit "1" ~~oder "2"~~ belegt
58	Text		M		String ~~1. Zeile:~~ Text zum Ereignis ~~2. Zeile optional:~~ ~~"_Z" = Kursaussetzung mit dem Zusatz "gestrichen Ziehung"~~ ~~"PO" = Zeichnungssperre mit dem Zusatz "Public Offering"~~

7.3.4 NoRelatedSym Repeating Group <InstrmtGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEQ7MI	Kommentare
146	NoRelatedSym	O	O		NumInGroup Anzahl Zeilen mit "1" belegt Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 55, 22 und 48.
55	Symbol	O	C		String ist vorhanden, falls Tag 146 vorhanden ist Wird vom BT-FIX Gateway auf "[N/A]" gesetzt.
22	SecurityIDSource	O	C		String ist vorhanden, falls Tag 146 vorhanden ist Wird vom BT-FIX Gateway auf "4" gesetzt
48	SecurityID	O	C		String ist vorhanden, falls Tag 146 vorhanden ist ISIN

7.3.5 NoRoutingIDs Repeating Group <RoutingGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEQ7MI	Kommentare
215	NoRoutingIDs	O	O		NumInGroup Nur die Werte "1", "2", "3" sind zulässig Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 216 und 217.
216	RoutingType	O	C		Integer Ist vorhanden, falls Tag 215 vorhanden ist. Wird vom BT-FIX Gateway auf "1" gesetzt.
217	RoutingID	O	C		String Ist vorhanden, falls Tag 215 vorhanden ist. Beinhaltet - 1. Group-Element immer Handelssystem - 2. Group-Element immer Börsenplatz - 3. Group-Element immer Empfänger Anmerkungen: Sollte ein Empfänger vorhanden sein, dann sind das Handelssystem und der Börsenplatz ebenfalls vorhanden, u.U. ist der Inhalt "[N/A]". Sollte ein Börsenplatz vorhanden sein, dann ist das Handelssystem ebenfalls vorhanden, u.U. ist der Inhalt "[N/A]"

7.4 Tradefunktionalität

7.4.1 Unterstützte Vorfälle

Szenario	Eingehende Nachrichten	Ausgehende Nachrichten	Empfänger der ausgehenden Nachrichten
OTC-Geschäftseingang	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck	Eingeber
OTC-Geschäftsstorno	TradeCaptureReport	TradeCaptureReportAck	Eingeber
~~OTC-Geschäftsdurchlieferung~~	~~TradeCaptureReport~~	~~TradeCaptureReportAck~~	~~Eingeber~~
~~MiFID-Report-Eingang~~	~~TradeCaptureReport~~	~~TradeCaptureReportAck~~	~~Eingeber~~
~~MiFID-Report-Storno~~	~~TradeCaptureReport~~	~~TradeCaptureReportAck~~	~~Eingeber~~
Geschäftsinformationen (Schlussnoten-Realtime)	-	TradeCaptureReportSno	Beide Kontrahenten (abhängig von der Konfiguration der Anschlüsse)

Bei der Einstellung und, Storno ~~und Durchlieferung~~ eines OTC-Geschäftes wird immer eine Bestätigung an den Eingeber zurückgegeben (siehe Tabelle oben).

Zusätzlich werden die aus dem Geschäft resultierenden Schlussnoten an beide Kontrahenten verschickt.

Bei Geschäftseingaben in Dialog oder über SAKI werden die beteiligten FIX-Teilnehmer über die generierten Schlussnoten über FIX-Nachrichten informiert.

Bei Geschäften, die aus einer Kursfeststellung und aus Maklereingaben entstehen, werden alle beteiligten FIX-Teilnehmer über die generierten Schlussnoten über FIX-Nachrichten informiert. Die Nachrichten für die Schlussnoten enthalten die Daten über die betroffenen Orders ~~und halben Geschäften~~.

Die Ausgabe der Schlussnoten-Information (TradeCaptureReportSno) ist abhängig von der Teilnehmer-Konfiguration: diese wird nur an FIX-Teilnehmer geliefert, die für den Bezug von Schlussnoten-Realtime konfiguriert sind.

7.4.2 Abläufe

Nr.	**OTC-Requests** ~~**MiFID-Requests**~~	**messageflow** FE Customer	BT FIX Gateway	~~XONTROT7~~ GSE
1	trade caputure report	→		
			→	
	Bestätigung (immer endgültig)			←
3	trade caputure report ack		←	

Nr.	**SNO-Realtime**	**messageflow** FE Customer	BT FIX Gateway	~~XONTROT7~~ GSE
	Schlussnote			←
1	trade capture report sno (für den Kontrahent 1)		←	
2	trade capture report sno (für den Kontrahent 2)		←	

7.4.3 OTC-Geschäfte - Requests

7.4.3.1 Request "TradeCaptureReport" - Identifikationskriterien

Nachfolgend die FIX-Tags innerhalb des TradeCaptureReport zur Identifikation der Trade-Requests:

	6556 BusinessTransactionType	**487** TradeReportTransType	**856** TradeReportType
OTC-Geschäftseingang (EnterOTC)	Tag nicht vorhanden	0 (new)	0 (submit)
OTC-Geschäftsstorno (DeleteOTC)	Tag nicht vorhanden	1 (cancel)	6 (TradeReportCancel)
~~OTC-Geschäftsdurchlieferung (ReverseOTC)~~	~~Tag nicht vorhanden~~	~~4 (reverse)~~	~~0 (submit)~~
~~MiFID-Report-Eingang (EnterMifid)~~	~~1 (TradeAdvice)~~	~~0 (new)~~ ~~2 (replace)~~ ~~Amendement~~	~~0 (submit)~~
~~MiFID-Report-Storno~~	~~1 (TradeAdvice)~~	~~1 (cancel)~~	~~6 (TradeReportCancel)~~

	6556 BusinessTransactionType	**487** TradeReportTransType	**856** TradeReportType
~~(DeleteMifid)~~			

In allen Fällen ist das Tag 571 (TradeReportID) mit einem eindeutigem Wert zu belegen (Unique identifier of trade capture report). Die Eindeutigkeit muss von dem FIX-Teilnehmer sichergestellt werden, da im FIX-Gateway keine Prüfung stattfindet.

Das Feld TradeReportID in den Request-Nachrichten wird in den Response-Nachrichten zurückgegeben.

Für die Stornierung ~~von MiFID-Reports und für die Storno- und Durchlieferung~~ von OTC-Geschäften wird die Geschäftsnummer im Tag 880 (TrdMatchID) angegeben.

In den folgenden Kapiteln werden die Nachrichtenformate für die unterstützen Vorfälle beschrieben.

Die Spalten RF (required FIX) und R (required) enthalten eine der Angaben **M**andatory/**O**ptional, die Spalte~~n~~ EnterOTC ~~bis DeleteMifid~~ die Angaben **M**andatory/**O**ptional/**C**onditional/**N**ot allowed/**I**gnored

7.4.3.2 Request "TradeCaptureReport" - Nachrichtendaten

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
<standard message header>		M	M			Tag 35 = "AE" (MsgType)
30	LastMkt	O	M			Exchange MIC Code Börsenplatz
31	LastPx	M	M			Price, Float(10,4)
32	LastQty	M	M			Qty, Float(13,3)
60	TransactTime	M	M			UTCTimestamp Zeitstempel
64	SettlDate	O		C	I	LocalMktDate Datum Festvaluta Nur mit Tag 5053 gemeinsam zu verwenden.
75	TradeDate	M	M			LocalMktDate Schlusstag (AS) Datum des Abschlusses des Geschäfts.
283	LocationID	O	O	I	N	String(4) Wird vom BT-FIX-Gateway noch nicht verwendet.

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
487	TradeReportTransType	O	M			Integer 0 = new für EnterOTC ~~EnterMiFID~~ 1 = cancel für DeleteOTC ~~DeleteMiFID~~ ~~2 = replace für EnterMiFID (amendment)~~ ~~4 = reverse für ReverseOTC~~
570	PreviouslyReported	M	M	C	C	Boolean wenn Tag 487 = new, dann Tag 570 = N, ansonsten = Y N für EnterOTC ~~EnterMiFID~~ Y für ~~ReverseOTC~~ ~~EnterMiFID (amendment)~~ DeleteOTC ~~DeleteMiFID~~
571	TradeReportID	M	M			String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom FIX-Client vergeben wird. Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.
572	TradeReportRefID	O	O	N	M	String(16) Identifier des Auftrags, der vom FIX-Client vergeben wird.
578	TradeInputSource	O	O	O	I	String(4) Segment-MIC eines „nicht ~~XONTROT7 GSE~~ Börsenplatzes zur Markierung des Geschäfts im Sinne der CSDR.
818	SecondaryTradeReportID	O	O	O	I	String(13) Bankinterne OTC-Nummer, vom FIX-Client vergeben. Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.
880	TrdMatchID	O	O	N	M	String(16) ursprüngliche Geschäftsnummer Identifier - von XONTRO - des ursprünglichen Auftrags.
856	TradeReportType	O	M			Integer 0 (submit) für EnterOTC ~~ReverseOTC~~ ~~EnterMiFID~~ 6 = TradeReportCancel für DeleteOTC ~~DeleteMiFID~~
<instrument>		M	M			
<TrdRegTimestamps>		O		O	I	Abweichender Abschlusstag (AA) bzw. Abschlussdatum.
5053	TradeType2	O		C	I	Integer Festvaluta-Kennzeichnung 1 (DVP) = FZ Nur mit Tag 64 gemeinsam zu verwenden.

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
5179	TradeTime	O		O	I	String Abschluss-Uhrzeit (hhmmss) In Central European Time (CET) EnterOTC ~~/ EnterMiFID~~ Default ist die aktuelle Uhrzeit.
~~5681~~	~~ExchangeTradeType~~	~~O~~		~~C~~	~~I~~	~~Char~~ ~~Kennzeichen Emissionsgeschäft~~ ~~"1"= Emissionsgeschäft~~ ~~Bei Kombination mit Tag 9473 nur 1=AC zulässig.~~
6556	BusinessTransactionType	O	O	N	N	String 1 = TradeAdvice
5458	MDDelayed	O	O	I	I	Boolean Delay-Indikator. Wird ignoriert
7017	VolumeIndicator	O	O	I	I	Integer Einheit der Effektennotiz 1 =Stück, 2 = Prozent, 3 = Promille, 4 = Punkte, 9 = Sonstige
7566	TimezoneOffset	O	O	I	I	Integer Abweichung der Abschlussuhrzeit zu UTC. Hier ist anzugeben, wie weit der Ort, dessen Uhrzeit als Abschlussuhrzeit gemeldet wird, von der Universal Time Coordinated (UTC) abweicht.
7567	ReportedPxDiff	O	O	I	I	Boolean Abweichender Preis Indikator
7568	ReportedPxReason	O	O	I	I	Char Verhandelter Preis Indikator "N" = negotiated Trade. Wird ignoriert
7680	OTCInd	O	O	O	I	Integer OTC (Off Exchange order) indicator 0 = börslich 1= außerbörslich (Default)
<TrdCaptRptSideGrp>		M	M			
<standard message trailer>		M	M			

7.4.3.3 Instrument Component Block <instrument>Instrument Component Block <instrument>

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
55	Symbol	O	M			String Börsenkürzel Wird vom BT-FIX-Gateway ignoriert

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
48	SecurityID	M	M			String ISIN
22	SecurityIDSource	M	M			String muss immer = "4" sein

Der Instrument Component Block wird mit <instrument> referenziert.

7.4.3.4 NoTrdRegTimestamps Repeating Group <TrdRegTimestamps>

Der "TrdRegTimestamps" Component Block beinhaltet die Repeating Group NoTrdRegTimestamps.

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
768	NoTrdRegTimestamps	O	O	O	I	NumInGroup Nur der Wert 1 sind zulässig. Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 769 und 770.
769	TrdRegTimestamp	O	C	C	I	UTCTimestamp Folgt dem Tag 768, wenn Tag 768 vorhanden ist. Das Feld enthält den (abweichenden) Abschlusstag des Geschäfts ~~bzw. das Abschlussdatum des MiFID-Reports~~. Enter OTC Erlaubt ist die Eingabe von "Nicht-Börsentagen in der Vergangenheit", wobei diese Eingabe max. 90 Tage zurückreichen darf. Ist das Feld nicht belegt, wird das Geschäft mit dem Datum des aktuellen Börsentags abgeschlossen. ~~Enter MiFID~~ ~~Erlaubt ist die Eingabe von Kalendertagen.~~ ~~Ist das Feld nicht belegt, wird der MiFID-Report mit dem Datum des aktuellen Börsentags generiert.~~
770	TrdRegTimestampType	O	C	C	I	Integer Ist vorhanden, falls Tag 768 vorhanden ist. Gültige Werte 1 = "Execution Time" (Abschluss-Zeitstempel)

7.4.3.5 NoTransactionCosts Repeating Group <courtage>

~~NoTransactionCosts Repeating Group <courtage>~~

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
9471	NoTransactionCosts	O	O	O	I	NumInGroup Nur der Wert 1 ist zulässig. Ist das Tag vorhanden, dann folgt das Tags 9473. Ggf. folgt das Tag 9476.
9473	TransactionCostCode	O	O	C	I	Char Folgt dem Tag 9471, wenn dieses vorhanden ist. Zulässige Werte sind: 1 = AC (Abweichende Courtage) 2 = FC (Franco Courtage) 3 = FR (Franco Rechnung) ~~4 = HC (Halbe Courtage)~~ ~~In Kombination mit Tag 5681 nur 1=AC zulässig.~~ Bei 3 = FR ~~ist die~~ in Kombination mit ~~den~~ Tag~~s~~ 12.
9476	TransactionCostAmt	O	O	C	I	Float(9,2) Courtage Ist vorhanden, falls Tag 9473 den Wert 1 = AC enthält.

7.4.3.6 NoSides Repeating Group <TrdCaptRptSideGrp>

Der "TrdCaptRptSideGrp" Component Block beinhaltet die Repeating Group NoSides, welche die Repeating Groups NoTransactionCosts und NoPartyIDs beinhaltet.

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
552	NoSides	M	M	2	1	NumInGroup Für EnterOTC: Nur der Wert "2" ist zulässig. ~~Für die die sonstigen Requests:~~ ~~Nur der Wert "1" ist zulässig.~~ Es folgt das Tag 54 (Side).
<Side 1>		M	M			<Side 1> für die Geschäfts-Angaben des Eingebers

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
<Side 2>		O	O	M	N	<Side 2> für die Geschäfts-Angaben zum Kontrahenten

<Side1>

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
54	Side	M	M			Char Seite des Trades 1 = Buy 2 = Sell
37	OrderID	M	M			String Mit "[N/A]" belegt.
<parties>		O	M			
453	NoPartyIDs	O	M			NumInGroup Nur die Werte "1" bis "4" sind zulässig.
<entering firm>		O	M			
<executing firm>		O	O	O	O	
<report originator>		O	O	N	N	
<execution venue>		O	O	N	N	
end <parties>		O	M			
12	Commission	O	O	O	I	Float(9,2) Spesen Das Feld enthält die Angabe des Spesenbetrags. ~~Bei Finanzierungsschätzen ist die Angabe nicht erlaubt.~~
15	Currency	O	O	M	I	Currency Währung der Notierung. Bei EnterOTC wird das Feld nicht berücksichtigt.
58	Text	O	O	O	I	String(3024) Frei wählbarer Text.
155	SettlCurrFxRate	O	O	C	I	Float(10,5) Devisenkurs des Geschäfts. Nur mit Tag 156 gemeinsam zu verwenden.
156	SettlCurrFxRateCalc	O	O	C	I	Char D=divide Nur mit Tag 155 gemeinsam zu verwenden.
~~6584~~	~~SpreadPctPremium~~	~~O~~	~~O~~	~~O~~	~~I~~	~~Float(5,3)~~ ~~Bonifikationssatz~~ ~~Das Feld enthält die Prozentangabe des Bonifikationssatzes für die Bonifikationsberechnung.~~ ~~Bei Finanzierungsschätzen ist das Feld Mussfeld. Ansonsten ist eine Eingabe nur bei Emissionsgeschäften möglich.~~
6586	CashOffset	O	O	O	I	Float(9,2) Wiederanlagerabatt Eine Eingabe ist nur bei Investmentzertifikaten möglich. Wird ignoriert.
<courtage>		O	O	O	I	

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
9596	ClientFreeField1	O	O	C	I	String Provision Das Feld ist auf Float(10,3) > 0 eingeschränkt. Nur mit Tag 9597 gemeinsam zu verwenden. ~~Falls Tag 9597 "PM" enthält, muss der Wert <= 99,999 sein~~ Falls Tag 9597 "PD" enthält, muss der Wert <= 9999999,990 sein (letzte Nachkommastelle = 0)
9597	ClientFreeField2	O	O	C	I	String(2) Schlüsselcode zur Provision. Nur mit Tag 9596 gemeinsam zu verwenden. Zulässig ist ~~sind~~ "PM" = Provisionssatz "PD" = Provisionsbetrag

<Side2>

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
54	Side	M	M	M	N	Char Seite des Trades für "contra firm" 1 = Buy 2 = Sell
37	OrderID	M	M	M	N	String Mit "[N/A]" belegt.
<parties>		O	O			
453	NoPartyIDs	O	O			NumInGroup Nur der Wert "1" ist zulässig.
<contra firm>		O	O	M	N	
end <parties>		O	M			

7.4.3.7 Party Konzept <parties>

Der "Parties" Component Block wird zur Beschreibung sämtlicher Teilnehmer eines Vorgangs verwendet.

Der TradeCaptureReport für FIX 4.2 ist eine userdefinierte Message die von der Nachrichtenstruktur identisch zu dem TradeCaptureReport für FIX 4.4 gehalten ist. Sollte ein FIX 4.2 - Teilnehmer auch Trade-Nachrichten beziehen wollen, so muss dieser Teilnehmer die NoPartyIDs Repeating Group vorsehen und auch verarbeiten können.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
453	NoPartyIDs	O	M	NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 1 – 4 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen. Es folgen die Tags 448, 447, 452.
448	PartyID	O	M	String **PartyRole=1 (Executing Firm)** String(4), zugelassene KVNr des Geschäftseingebers **PartyRole=7 (Entering Firm)** String(4), KVNr des Anschlussinhabers **PartyRole=17 (Contra Firm)** String(4), KVNr des Kontrahenten **PartyRole=62 (Report Originator)** String(11, Code zur Identifizierung des meldenden Instituts **PartyRole=73 (Execution Venue)** String(12) Hier ist anzugeben, ob das gemeldete Geschäft • ein OTC-Geschäft, • ein internalisiertes Geschäft oder • ein auf einer Plattform (und ggf. welcher) zustande gekommenes Geschäft ist. • Konstante "OTC" für OTC-Geschäfte • Konstante "SI" für systematische Internalisierer Zur Identifizierung einer Plattform: • "B" plus BIC (ISO 9662, 11-stellig alphanumerisch) • "M" plus MIC (ISO 10383, 4-stellig alphanumerisch) • "I" plus IBEI (ISO 16327, 10-stellig alphanumerisch)
447	PartyIDSource	O	M	Char muss immer = "D" sein
452	PartyRole	O	M	Integer muss mit einem der Werte 1 = "Executing Firm" 7 = "Entering Firm" 17 = "Contra Firm" 62 = "Report Originator" 73 = "Execution Venue" belegt sein

Der Parties Component Block wird mit <parties> referenziert, die einzelnen Repeating Groups mit <entering firm>, <executing firm>, <contra firm>, <report originator>, <execution venue>.

7.4.4 OTC-Geschäfte ~~und MiFID-Reports~~ - Responses

7.4.4.1 Response "TradeCaptureReportAck" - Identifikationskriterien

Nachfolgend die FIX-Tags innerhalb TradeCaptureReportAck zur Identifikation der Trade-Responses.

TradeCaptureReportAck (positive Bestätigung)

	6556 Business TransactionType	**487** TradeReport TransType	**856** TradeReportType	**150** ExecType
OTC Einstellung	nicht vorhanden	0 (new)	0 (submit)	0 (new)
OTC Storno	nicht vorhanden	1 (cancel)	6 (TradeReportCancel)	4 (canceled)
~~OTC Durchlieferung~~	~~nicht vorhanden~~	~~4 (reverse)~~	~~0 (submit)~~	~~0 (new)~~
~~MiFID Einstellung~~	~~1 (TradeAdvice)~~	~~0 (new)~~	~~0 (submit)~~	~~0 (new)~~
~~MiFID Storno~~	~~1 (TradeAdvice)~~	~~1 (cancel)~~	~~6 (TradeReportCancel)~~	~~4 (canceled)~~

In allen Fällen werden die Tags 571 (TradeReportID) und 572 (TradeReportRefID) mit dem Inhalt aus der Request-Nachricht belegt.

Das Tag 880 (TrdMatchID) enthält bei Einstellungen (OTC~~, MiFID~~) die generierte Geschäftsnummer ~~bzw. Report-Nummer, bei Durchlieferung die Geschäftsnummer des neu generierten Geschäftes~~.

~~Bei Durchlieferungen wird das Tag 6555 (OrigTrdMatchID) mit der Geschäftsnummer aus der Request-Nachricht (Tag 880) belegt.~~

~~Bei einer Durchlieferung werden dann beide Geschäftsnummern geliefert:~~

- ~~Tag 880 (TrdMatchID) neue Geschäftsnummer~~
- ~~Tag 6555 (OrigTrdMatchID) alte Geschäftsnummer~~

TradeCaptureReportAck (negative Bestätigung)

Feldbelegung wie bei einer positiven Bestätigung aber mit Tag 150 (ExecType) = 8 (rejected).

In allen Fällen werden die Tags 571 (TradeReportID) und 572 (TradeReportRefID) mit dem Inhalt aus der Request-Nachricht belegt.

~~Bei Durchlieferungen wird das Tag 6555 (OrigTrdMatchID) mit der Geschäftsnummer aus der Request-Nachricht (Tag 880) belegt. Bei allen anderen Requests wird die Geschäftsnummer aus der Request-Nachricht im Tag 880 geliefert.~~

7.4.4.2 Response "TradeCaptureReportAck" - Nachrichtendaten

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
<standard message header>		M	M			Tag 35 = "AR" (MsgType)
<instrument>		M	M			
30	LastMkt	O	M			Exchange MIC Code Börsenplatz, der vom FIX-Client verwendet wurde. Analog FIX 5.0 Definition von TradeCaptureReportAck.
58	Text	O	C	C	C	String Fehlertext des Handels~~- bzw. Abwicklungs~~systems Gemeinsam mit den Tags 751, 5555, 9803.
60	TransactTime	M				UTCTimestamp Zeitstempel
150	ExecType	M	M			Char Art des Reports. 0 = "New", bei erfolgreichem EnterOTC ~~ReverseOTC~~ ~~EnterMiFid,~~ 4 = "Canceled", bei erfolgreichem DeleteOTC ~~DeleteMiFid~~ 8 = " Rejected", bei Ablehnung
487	TradeReportTransType	O	M			Integer 0 = "new", wenn Antwort auf EnterOTC ~~EnterMiFID~~ 1 = "cancel", wenn Antwort auf DeleteOTC ~~DeleteMiFID~~ ~~2 = "replace", wenn Antwort auf~~ ~~EnterMiFID~~ ~~4 = "reverse", wenn Antwort auf~~ ~~ReverseOTC~~
571	TradeReportID	M	M			String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom FIX-Client vergeben wurde. Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.
572	TradeReportRefID	O	O	N	M	String(16) Identifier des Auftrags, der vom FIX-Client vergeben wurde. Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.
751	TradeReportRejectReason	O	O	O	O	Integer Reject-Reason Nur wenn Tag 150 = 8, dann 99 = Other Gemeinsam mit den Tags 58, 5555, 9803.

Tag	Feldname	RF	R	EnterOTC	DeleteOTC	Kommentare
818	SecondaryTradeReportID	O	O	O	-	String(13) Bankinterne OTC-Nummer, die vom FIX-Client vergeben wurde. Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.
856	TradeReportType	O	M			Integer 0 = "submit", wenn Antwort auf EnterOTC ~~ReverseOTC~~ ~~EnterMiFID~~ 6 = "TradeReportCancel", wenn Antwort auf DeleteOTC ~~DeleteMiFID~~
880	TrdMatchID	O	M			String(16) Geschäftsnummer Bei positiver Antwort: Eindeutiger Identifier des Auftrags vom Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system vergeben. Bei negativer Antwort, "[N/A]".
5555	ReturnCode	O	C	C	C	Integer Fehlercode (bspw. 3730) Gemeinsam mit den Tags 58, 751, 9803.
6555	OrigTrdMatchID	O	O	-	-	String(16) Alte Geschäftsnummer, wie sie vom FIX-Client im Request als TrdMatchID verwendet wurde. Wird nicht geliefert.
6556	BusinessTransactionType	O	O	N	N	String 1 = TradeAdvice
9591	PriceCheckingFlag	O	O	-	-	Integer Indikator für einen PriceAlert. 2 = severe (PriceAlert)
9803	TradingSystemID	O	C	C	C	Integer Identifikation des Systems, welches den Fehlercode erzeugt hat. Gemeinsam mit den Tags 58, 751, 5555.
<standard message trailer>		M	M			

7.4.4.3 Instrument Component Block <instrument>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
22	SecurityIDSource	O	M	String Wird vom BT-FIX Gateway auf "4" gesetzt
48	SecurityID	O	M	String ISIN
55	Symbol	O	M	String Wird vom BT-FIX Gateway auf "[N/A]" gesetzt

7.4.5 Schlussnoten-Realtime

Die Schlussnoten-Informationen werden den Teilnehmern über eine User-Defined Nachricht "TradeCaptureReportSno" (MsgType ‚USN') übermittelt.

Diese wird analog dem für FIX 4.4 definierten TradeCaptureReport (MsgType AE), aber ohne die Restriktion für das Tag 552 (NoSides), definiert: in FIX 4.4 und FIX 5.0 kann dieses Tag nur die Werte 1 und 2 enthalten. In der neuen Nachricht "TradeCaptureReportSno" sind für das Tag 552 (NoSides) Werte größer 2 möglich.

Zu einer Schlussnote können 1 oder mehrere Nachrichten geliefert werden.

Jeder "TradeCaptureReportSno" kann pro Seite (Kauf/Verkauf) eine ~~bis zu 15~~ Orderreferenz~~en~~ enthalten.

Die Orderreferenz ~~en werden~~wird als zusätzliche "Side~~s~~" innerhalb der Repeating Group "NoSides" (Tag 552) übermittelt.

~~Die Anzahl von "TradeCaptureReportSno" Nachrichten, die zu einer Schlussnote geliefert werden, ist von der Anzahl von Orderreferenzen abhängig: bei 1 bis 15 Orderreferenzen wird eine einzelne Nachricht geliefert, bei über 15 Orderreferenzen werden mehrere Nachrichten mit jeweils bis zu 15 Orderreferenzen geliefert.~~

Orderreferenzen werden geliefert, wenn das Geschäft aus Orders entstand und der Teilnehmer für den Empfang von Ordernummer konfiguriert ist (Einstellung über die Teilnehmer-Konfiguration). Je nach Einstellung werden entweder die ~~DWZ~~Exchange- oder die bankinternen Ordernummern geliefert.

Diese Logik wird entsprechend auch bei den manuellen Eingabe-Bezügen angewandt.

Die letzte Nachricht zu einer Schlussnote wird über das Tag 9954 (NextMsgFlag) mit der Ausprägung "N" gekennzeichnet. ~~Alle vorherigen Nachrichten (falls welche vorhanden) werden mit der Ausprägung "Y" gekennzeichnet.~~

~~Alle zu einer Schlussnote zusammengehörenden Nachrichten werden zusammen (d.h. ohne weitere Nachrichten dazwischen) geliefert.~~

~~Die verschiedenen Nachrichten zu einer Schlussnote unterscheiden sich nur bei den Orderreferenzen. Die allgemeinen Daten (Geschäftsdaten, Kontrahenten…) werden in jeder Nachricht (redundant) geliefert. Das Tag 6732 (DealerNote) wird jedoch nur einmalig in der ersten Nachricht geliefert.Das Tag 880 (TrdMatchID) enthält die Geschäftsnummer.~~

Das Tag 571 (TradeReportID) wird in jeder Nachricht mit einem eindeutigen, von ~~XONTRO~~FAGSE vergebenen Wert belegt.

~~Die Verknüpfung aller zusammengehörenden Nachrichten erfolgt über die Geschäftsnummer und die Geschäftsart und die Satzart, die in den FIX-Tags 880 (TrdMatchID) und 54 (Side) und 829 (TrdSubType) bei jedem „TradeCaptureReportSno“ geliefert werden.~~

7.4.5.1 Geschäftsinformation "TradeCaptureReportSno"

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
<standard message header>		M		Tag 35 = "USN" (MsgType)
<instrument>		M		
30	LastMkt	O	M	Exchange MIC Code T7 GSE-BörsenBörsenplatz "XDUS" = Duesseldorf "XFRA" = Frankfurt "XHAM" = Hamburg "XHAN" = Hannover "XMUN" = Muenchen
31	LastPx	M		Price, Float(10,4) Kurs
32	LastQty	M		Qty, Float(13,3) Geschäfts-Nominale
75	TradeDate	M		LocalMktDate Schlusstag Datum des Geschäfts-Abschlusses (ggf. abweichender AS).
60	TransactTime	M		UTCTimestamp Zeitstempel des sendenden Systems
64	SettlDate	O	C	LocalMktDate Datum Festvaluta Nur mit Tag 5053 gemeinsam.
283	LocationID	O	M	String Börsenplatz des Meldewesens Wird als FIX-Data-Type Exchange geliefert. ~~Xontro~~T7 GSE-Börsen "XBER" = Berlin "XDUS" = Duesseldorf ~~"XETR" = Xetra~~ "XFRA" = Frankfurt "XHAM" = Hamburg "XHAN" = Hannover ~~"XINV" = Investro Abwicklungssystem~~ "XMUN" = Muenchen "XSTU" = Stuttgart ~~Nicht-Xontro-Börsen~~ ~~"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~~ ~~"TQEX" = Amsterdam - Turquoise Europe~~ ~~"TREU" = 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~~
487	TradeReportTransType	O	M	Integer 0 = new

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
570	PreviouslyReported	M	M	Boolean N = no
571	TradeReportID	M	M	String(16) Eindeutiger Identifier des Auftrags, der von ~~XONTROL~~FAGSE vergeben wird.
578	TradeInputSource	O	O	String(4) Segment-MIC eines „nicht ~~XONTROT7~~ GSE Börsenplatzes zur Markierung des Geschäfts im Sinne der CSDR.
<TrdRegTimestamps>		O		- Abschlussdatum + abweichende Abschlussuhrzeit (AU) Wurde ein Abweichendes Abschlussdatum (AA) eingegeben, so wird dieser in das Abschlussdatum übernommen, ansonsten ist das Abschlussdatum immer der Schlusstag aus dem Tag 75. - Eingabezeit
820	TradeLinkID	O	O	String(16) Wegen-Geschäftsnummer
828	TrdType	O	O	Integer OTC Post-trade indicator Indikator für die Art der Transaktion gemäß ESMA RTS 22 Feld 63. 9001 = ACTX (Agency cross transaction) 9002 = CANC (Cancellation) 9101 = ACTX CANC (Agency cross transaction and Cancellation)
829	TrdSubType	O	M	Integer Satzart siehe Kapitel 14 Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart) bspw. 9012= "Kauf - Direktgeschäft"
856	TradeReportType	O	M	Integer 0 = submit
880	TrdMatchID	O	O	String(16) Geschäftsnummer
1125	OrigTradeDate	O	O	LocalMktDate ursprünglicher Schlusstag ~~(bei Aufgabenschließung und -weitergabe)~~
1126	OrigTradeID	O	O	String(16) Ursprünglicher Geschäftsnummer (~~bei Aufgabenschließung, Aufgabenweitergabe und Durchlieferung)~~ Wird nicht geliefert.
<RegulatoryTradeIDGrp>		O	O	TVTIC (Trading venue transaction identifier)
5053	TradeType2	O	C	Integer Festvaluta-Kennzeichnung 1 (DVP) = FZ 7 (when issued) = FE Nur mit Tag 64 gemeinsam.
5494	LastTrader	O	O	Integer Ursprünglicher Makler ~~(bei Aufgabenschließung und -weitergabe)~~
5665	MKTXPriceDiff	O	O	Float(15,2) Kurs-Differenz-Betrag ~~Wenn negativer Betrag, dann überweist der Makler.~~ ~~Ansonsten erhebt der Makler.~~Wird nicht geliefert.
6034	ConcessionAmt	O	O	Float(9,2) Boni-Differenz-Betrag. Wir nicht geliefert.
6475	ClientIndicator	O	O	Char Y = "IW-Geschäft". Wird nicht geliefert.
6732	DealerNote	O	O	String(350) diverse SAKI-Feldinhalte mit \ getrennt. In TradeCaptureReportSno wurden alle relevanten Tags zur Beschreibung eines Geschäfts definiert. Im Tag 6732 werden Feldinhalte, die zusätzlich in einer SAKI-SNO-Nachricht bzw.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
				aufgrund von zusätzlichen Anforderungen enthalten sind, aufgenommen. Kennzeichen Lieferfreigabe ab 3.6.2013 immer Space\ Abweichender Kontrahentenkurs \ Kennzeichen für Abweichender Schlusstag \ Art des Wertpapiers \ ~~Verwahrmöglichkeit~~ Verwahrart \ Zinstermin \ APMT-Konstante \ Abschlusskurs-Währung \ Kurswert-Währung \ Kursdifferenz-Währung \ Stückzins-Währung \ Kennzeichen für Courtage \ Kennzeichen für Spesen \ Kennzeichen für Wiederanlagerabatt \ Kennzeichen für Bonifikation \ Kennzeichen für Boni-Differenz \ Kennzeichen für Provision \ Courtage-Währung \ Spesen-Währung \ Wiederanlagerabatt-Währung \ Bonifikations-Währung \ Boni-Differenz-Währung \ Provisions-Währung \ Kennzeichen für Wiederanlagerabatt \ Kennzeichen für Bonifikation \ Bonischlüssel \ Kennzeichen für Boni-Differenz \ Kennzeichen für Order-Referenz \ Eingeber-ID \ Formate und Werte siehe im Kapitel Anhang C: Benutzerdefinierte Tags
7017	VolumeIndicator	O	O	Integer Einheit der Effektennotiz 1 =Stück, 2 = Prozent, 3 = Promille
7680	OTCInd	O	M	Integer OTC (Off Exchange) indicator 0 = börslich 1 = außerbörslich
9954	NextMsgFlag	O	M	Boolean ~~Y = (weitere) Folgesätze werden geliefert~~ N = keine (weiteren) Folgesätze
9807	RegFeeFlag	O	O	Char Courtage-Schlüssel aus der jeweiligen Courtage Staffel. Hierbei ist zu beachten, dass Schlussnoten, die aus der Zuteilung heraus erstellt werden, keinen Courtage-Schlüssel erhalten, da in diesem Fall evtl. die Ursprungsnominale verändert wurde. Wird nicht geliefert.
9893	DiscountRate	O	O	Float(9,7) ~~Diskontsatz (Nur für Finanzierungsschätze)~~ Wird nicht geliefert.
<SnoRealtimeSideGrp>		M		
<standard message trailer>		M	M	

7.4.5.2 Instrument Component Block <instrument>

Der "Instrument" Component Block beinhaltet die Repeating Group NoSecAltID.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
55	Symbol	O	M	String Börsenkürzel Wird vom BT-FIX Gateway ggf. "[N/A]" gesetzt
48	SecurityID	O	M	String ISIN
22	SecurityIDSource	O	M	String Wird vom BT-FIX Gateway auf "4" gesetzt
223	CouponRate	O	O	Float(13,9) Zinssatz
228	Factor	O	C	Float(10,9) Poolfaktor / Umrechnungsfaktor Mit Tag 691 zusammen.
240	RedemptionDate	O	O	LocalMktDate Letzter Tilgungstermin (letzte Fälligkeit)
<SecAltIDGrp>		O	O	
691	Pool	O	C	String Kennzeichen für Tag 228. 1 = PF (Poolfaktor) 2 = FS (Fundierungsschuldverschreibungen) 3 = IK (Indexierungskoeffizient)
6611	TotalAccruedInterestAmt	O	O	Float(17,8) Akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag Das Feld wird gefüllt, sofern ein akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag ~~in WSS hinterlegt~~vorhanden ist ~~oder~~ ~~falls der akkumulierte ausschüttungsgleiche Ertrag in der Geschäftseingabe INVESTRO eingegeben wurde.~~ ~~Bei Vestima-Geschäften ist das Feld nicht belegt.~~
6893	Profit	O	O	Float(15,8) Zwischengewinn ~~Das Feld wird gefüllt, sofern ein Zwischengewinn in WSS hinterlegt ist oder der Zwischengewinn in der Geschäftseingabe INVESTRO eingegeben wurde.~~ ~~Bei Vestima-Geschäften ist das Feld nicht belegt.~~Wird nicht geliefert.
7491	CustomPrice1	O	O	Float(15,8) Ausgabepreis ~~Das Feld wird gefüllt bei Kaufaufträgen, die zur Wiederanlage oder zur Rücknahme preisausgezeichnet wurden~~ ~~oder~~ ~~falls der Ausgabepreis in der Geschäftseingabe INVESTRO (Kürzel „AP“) eingegeben wurde.~~ ~~Bei Vestima-Geschäften ist das Feld nicht belegt.~~ Wird nicht geliefert.

7.4.5.3 NoSecAltID Repeating Group <SecAltIDGrp>

Der SecAltIDGrp Component Block beinhaltet die Repeating Group NoSecAltID.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
454	NoSecAltID	O	O	NumInGroup Wird vom BT-FIX Gateway auf die Werte 1, 2 oder 3 gesetzt. Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 455 und 456.
455	SecurityAltID	O	C	String WP-Kurzbezeichnung WKN ISIN Ist vorhanden, falls Tag 454 vorhanden ist.
456	SecurityAltIDSource	O	C	String Wird vom BT-FIX Gateway auf "8" = "Exchange Symbol" (WP-Kurzbezeichnung) "B" = "Wertpapier" (WKN) "4" = "ISIN" gesetzt. Ist vorhanden, falls Tag 454 vorhanden ist.

7.4.5.4 NoTrdRegTimestamps Repeating Group <TrdRegTimestamps>

Der "TrdRegTimestamps" Component Block beinhaltet die Repeating Group NoTrdRegTimestamps.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
768	NoTrdRegTimestamps	O	O	NumInGroup Nur die Werte 1 und 2 sind zulässig. Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 769 und 770.
769	TrdRegTimestamp	O	C	UTCTimestamp [microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss] Ist vorhanden, falls Tag 768 vorhanden ist.
770	TrdRegTimestampType	O	C	Integer Ist vorhanden, falls Tag 768 vorhanden ist. Gültige Werte 1 = "Execution Time" (Abschluss-Zeitstempel) 2 = "Time In" (Eingabezeit)

7.4.5.5 NoMiscFees Repeating Group <gebühren>

Der "MiscFeesGrp" Component Block beinhaltet die Repeating Group NoMiscFees.

Wird nicht geliefert.

~~Tag~~	~~Feldname~~	~~RF~~	~~R~~	~~Kommentare~~
~~136~~	~~NoMiscFees~~	~~O~~	~~O~~	~~NumInGroup Nur der Wert 1 ist zulässig. Ist das Tag vorhanden, dann folgen die Tags 137, 138 und 139.~~
~~137~~	~~MiscFeeAmt~~	~~O~~	~~C~~	~~Float(9,2) Gebühren, die Differenz - wenn ungleich 0 - aus dem ausmachenden Betrag und dem Kurswert. Ist vorhanden, falls Tag 136 vorhanden ist.~~
~~138~~	~~MiscFeeCurr~~	~~O~~	~~C~~	~~Currency Ist vorhanden, falls Tag 136 vorhanden ist. Währung zur Gebühr~~
~~139~~	~~MiscFeeType~~	~~O~~	~~C~~	~~String "7" = Other~~

7.4.5.6 NoTransactionCosts Repeating Group <courtage>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
9471	NoTransactionCosts	O	O	NumInGroup Nur der Wert 1 ist zulässig. Ist das Tag vorhanden, dann folgt das Tags 9473 und ggf. 9476
9473	TransactionCostCode	O	C	Char Ist vorhanden, falls Tag 9471 vorhanden ist. Zulässige Werte sind: 0 = Standardcourtage 1 = AC (Abweichende Courtage) 2 = FC (Franco Courtage) 3 = FR (Franco Rechnung) ~~4 = HC (Halbe Courtage)~~ ~~5 = PC (Prozentcourtage, nur bei maklervermittelten Geschäften möglich)~~
9476	TransactionCostAmt	O	C	Float(9,2) Courtage Ist vorhanden, falls Tag 9471 vorhanden ist.

7.4.5.7 NoSides Repeating Group <SnoRealtimeSideGrp>

Die Repeating Group NoSides beinhaltet die Repeating Groups NoTransactionCosts, NoMiscFees und NoPartyIDs.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
552	NoSides	M	M	NumInGroup Nur die Werte größer gleich 2 sind zulässig. Es folgt das Tags 54 (Side).
<Side 1>		M	M	<Side 1> für die Geschäfts-Angaben des Eingebers
<Side 2>		O	O	<Side 2> für die Geschäfts-Angaben zum Kontrahenten
<Side #>		O	O	<Side 3> bis <Side n> für die Orderreferenzen

<Side1>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
54	Side	M	M	Char Seite des Trades für <entering firm> 1 = Buy 2 = Sell
37	OrderID	M	M	String Mit "[N/A]" belegt.
<parties>		O	M	
453	NoPartyIDs	O	M	NumInGroup Nur die Werte "1" bis "6" sind zulässig.
<customer account>		O	M	Daten, die den SNO-Empfänger beschreiben.
<executing firm>		O	O	Daten, die den Eingeber beschreiben.
<buyer seller>		O	O	Daten, die den Käufer / Verkäufer beschreiben.
<order origination trader>		O	O	Händlernummer
<clearing firm>		O	O	KVNr des Clearers

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
<clearing organization>		O	O	KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei internem Settlement. KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei bilaterale Aggregation.
end <parties>		O	M	
1	Account	O	O	String(2), Aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number. Ist jeweils das 'Kennzeichen Eigengeschäft' des Empfängers der Geschäftsbestätigung. Eine Ausnahme bilden Schlussnoten, bei denen es sich um Eigengeschäfte des Maklers handelt. Hier wird nicht das 'Kennzeichen Eigengeschäft' des Empfängers der Geschäftsbestätigung, sondern das 'Kennzeichen Eigengeschäft' des Eingebers abgebildet. Bei Bankdirektgeschäften wird dieses Kennzeichen n i c h t gefüllt. Möglicher Wertebereich: ~~EA – Eigengeschäft des Maklers aus systemseitiger Aufgabenschließung~~ EE – Eigengeschäft des Maklers P1 – Eigengeschäft der Bank A1 – Kundengeschäft der Bank
12	Commission	O	O	Float(9,2) Spesen Das Feld enthält die Angabe des Spesenbetrags. ~~Bei Finanzierungsschätzen ist die Angabe nicht erlaubt.~~
58	Text	O	O	String(3524) frei wählbarer Text. mit ggf. vorangestellten Präfix: "BOSS/" bei XONTROT7 GSE-Order-Geschäften ~~"INVESTRO/" bei INVESTRO-Geschäften~~ ~~"EUFO/" bei EUFO-Geschäften~~ "MAX/" bei Max-One-Geschäfte "FIX/" bei OTC-Geschäften, die über FIX erfasst wurden. "FIXF/" bei OTC-Geschäften, die über FIX fremd-erfasst wurden.
157	NumDaysInterest	O	C	Integer Zinstage, wenn Tag 5427 = I Diskonttag, wenn Tag 5427 = D
159	AccruedInterestAmt	O	C	Amt, Float(12,2) Zinsbetrag, wenn Tag 5427 = I Diskontbetrag, wenn Tag 5427 = D
119	SettlCurrAmt	O	O	Amt, Float(12,2) Ausmachender Betrag
120	SettlCurrency	O	O	Currency Währung des Ausmachender Betrags.
155	SettlCurrFxRate	O	C	Float(10,5) Devisenkurs des Geschäfts. Nur mit Tag 156 gemeinsam zu verwenden.
156	SettlCurrFxRateCalc	O	C	Char D=divide Nur mit Tag 155 gemeinsam zu verwenden.
381	GrossTradeAmount	O	O	Amt, Float(15,2) Kurswert
5427	IntrAttribType	O	C	Char Kennzeichen, ob Zins- oder Diskont-Felder - Tags 157 und 159 - geliefert werden. I = Interest (Zinsen) D = Discount (Diskont)

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
~~6583~~	~~SpreadPremium~~	~~O~~	~~O~~	~~Float(9,2)~~ ~~Bonifikationsbetrag~~
~~6584~~	~~SpreadPctPremium~~	~~O~~	~~O~~	~~Float(5,3)~~ ~~Bonifikationssatz~~ ~~Das Feld enthält die Prozentangabe des Bonifikationssatzes für die Bonifikationsberechnung.~~
~~6585~~	~~SpreadPctDiscount~~	~~O~~	~~O~~	~~Float(10,7)~~ ~~Wiederanlagerabatt in Prozent~~
~~6586~~	~~CashOffset~~	~~O~~	~~O~~	~~Float(9,2)~~ ~~Wiederanlagerabatt~~
~~7493~~	~~CustomRate1~~	~~O~~	~~O~~	~~Float(4,2)~~ ~~Ausgabeaufschlag~~
9596	ClientFreeField1	O	O	String Provision Das Feld ist auf Float(10,3) > 0 eingeschränkt. Nur mit Tag 9597 gemeinsam zu verwenden. ~~Falls Tag 9597 "PM" enthält, muss der Wert <= 99,999 sein~~ Falls Tag 9597 "PD" enthält, muss der Wert <= 9999999,990 sein (letzte Nachkommastelle = 0)
9597	ClientFreeField2	O	O	String(2) Schlüsselcode zur Provision. Nur mit Tag 9596 gemeinsam zu verwenden. Zulässig sind ~~"PM" = Provisionssatz~~ "PD" = Provisionsbetrag
9938	ClearingHandlingType	O	O	Char Kennzeichen des (Handels-)Schlussnote für internes Settlement oder bilaterale Aggregation. Das Geschäft wird nicht an Clearstream geliefert. "I = internes Settlement "A" = bilaterale Aggregation Kennzeichen des Abwicklungs-Geschäfts bei bilateraler Aggregation. Das Geschäft wird an Clearstream geliefert. "B" = bilaterale Aggregation
<gebühren>		O	O	
<courtage>		O	O	

<Side2>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
54	Side	M	M	Char Seite des Trades für "contra firm" 1 = Buy 2 = Sell
37	OrderID	M	M	String Mit "[N/A]" belegt.
<parties>		O	M	
453	NoPartyIDs	O	M	NumInGroup Nur die Werte "2" bis "7" sind zulässig.
<contra firm>		O	M	KVNr des Kontrahenten.
<contra firm>		O	O	LEI (Legal Entity Identifier) des Kontrahenten.

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
<buyer seller>		O	M	Daten, die den Käufer / Verkäufer beschreiben. Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann Verkäufer. Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy, dann Käufer.
<settlement location>		O	O	PSET~~, Vestima-BIC des Place of Settlement.~~
~~<agent>~~		~~O~~	~~O~~	~~DEAG / REAG, Vestima-BIC des Delivering / Receiving Agent.~~ ~~Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann DEAG.~~ ~~Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy, dann REAG.~~
~~<custodian>~~		~~O~~	~~O~~	~~DECU / RECU, Vestima-BIC des Delivering / Receiving Custodian.~~ ~~Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann DECU.~~ ~~Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy, dann RECU.~~
~~<buyer seller>~~		~~O~~	~~O~~	~~BUY / SELL, Vestima-BIC des Käufers / Verkäufers.~~ ~~Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann SELL.~~ ~~Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy, dann BUY.~~
end <parties>		O	M	

<Side 3~~ bis n~~>

Tag	Feldname	RF	R	Kommentare
54	Side	M	M	Char Seite des Trades für <entering firm> 1 = Buy 2 = Sell
37	OrderID	M	C	String(~~16~~20) Ordernummer (Ordernummer des Handelssystems) Bankinterne Ordernummer (SecondaryClOrdID) oder Bankinterne OTC-Nummer (SecondaryTradeReportID)~~ oder~~ ~~Eingabenummer ("Halbe Geschäftsnummer" beginnend mit "MAN")~~ Zusammen mit Tag 6141
119	SettlCurrAmt	O	C	Float(10,4) Anteiliger Abrechnungsbetrag
6141	TradeQty	O	C	Qty, Float(12,3) Ausgeführte Nominale Zusammen mit Tag 37 (OrderID).

7.4.5.8 Party Konzept <parties>

Der "Parties" Component Block wird zur Beschreibung sämtlicher Teilnehmer eines Vorgangs verwendet.

Der TradeCaptureReportSno für FIX 4.2 und FIX 4.4 ist eine userdefinierte Message. Sollte ein FIX 4.2 - Teilnehmer auch Trade-Nachrichten beziehen wollen, so muss dieser Teilnehmer die NoPartyIDs Repeating Group vorsehen und auch verarbeiten können.

Der Parties Component Block wird mit <parties> referenziert, die einzelnen Repeating Groups mit <executing firm>, <clearing firm>, ~~<settlement location>,~~ <order origination trader>, <contra firm>, <clearing organization>, <customer account>, <buyer seller>, <custodian>, <agent>, <report originator>, <execution venue>.

Ausgehende Nachrichten

Tag	Feldname	RF	R	XEQ7MI	Kommentare
453	NoPartyIDs	O	M		NumInGroup Anzahl der beteiligten Instanzen Nur die Werte 2 – 7 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen
448	PartyID	O	M		String **PartyRole=1** (**Executing Firm**) String(4), zugelassene KVNr des Orderaufgebers bzw. Geschäftseingebers **PartyRole=4 (Clearing Firm)** String(4), KVNr des Clearers ~~**PartyRole=10 (Settlement Location)**~~ ~~String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (PSET)~~ **PartyRole=11 (Order Origination Trader)** String(6), Händlernummer **PartyRole=17 (Contra Firm)** String(4), KVNr des Kontrahenten, wenn PartyIDSource = D String(20), LEI (Legal Entity Identifier) des Kontrahenten, PartyIDSource = N **PartyRole=21 (Clearing Organization)** String(4) KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei internem Settlement KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei bilaterale Aggregation **PartyRole=24 (Customer Account)** String(4), KVNr des SNO-Empfängers **PartyRole=27 (Buyer Seller)** String(4), KVNr des Käufers / Verkäufers, bei PartyIDSource=D ~~String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (SELL/BUY), bei PartyIDSource=B~~ ~~**PartyRole=28 (Custodian)**~~ ~~String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DECU/RECU)~~ ~~**PartyRole=30 (Agent)**~~ ~~String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DEAG/REAG)~~
447	PartyIDSource	O	M		Char muss immer = "D", bei PartyRole 1, 4, 11, 21, 24 oder = "B", bei PartyRole 10, 28, 30 oder = "D" oder "B", bei PartyRole 27 oder = „D“ oder „N“ bei PartyRole 17 sein
452	PartyRole	O	M		Integer wird mit einem der Werte 1 = "Executing Firm" 4 = "Clearing Firm" ~~10 = "Settlement Location"~~ 11 = "Order Origination Trader" 17 = "Contra Firm" 21 = "Clearing Organization" 24 = "Customer Account" 27 = "Buyer Seller" 28 = "Custodian" 30 = "Agent" belegt
PtysSubGrp		O	C		Nur für PartyRole 27, 28 und 30 zulässig

7.4.5.9 NoPartySubIDs Repeating Group <PtysSubGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEQ7MI	Kommentare
802	NoPartySubIDs	O	C		NumInGroup wird mit "1" oder "2" belegt. Nur für PartyRole 27, 28 und 30 zulässig
523	PartySubID	O	C		String(35) wird für PartyRole 27, 28 und 30 mit weiteren Identifikationsmerkmal des Safe-Accounts belegt.

Tag	Feldname	RF	R	XEQ7MI	Kommentare
803	PartySubIDType	O	C		Integer für PartyRole 27 mit "4050" (Buy/Sell Safe Account) für PartyRole 30 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell mit "4060" (DEAG-Safe-Account), für PartyRole 30 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy mit “4070” (REAG-Safe-Account) , für PartyRole 28 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy mit "4080“ (DECU-Safe-Account), für PartyRole 28 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell mit "4090" (RECU-Safe-Account).

7.4.5.10 Regulatory TradeID Repeating Group <RegulatoryTradeIDGrp>

Tag	Feldname	RF	R	XEQ7MI	Kommentare
1907	NoRegulatoryTradeID	O	O		NumInGroup Nur der Wert 1 ist zulässig.
1903	RegulatoryTradeID	O	O		String(52) TVTIC (Trading venue transaction identifier) Der T7 GSE TVTIC setzt sich zusammen aus: Envir Flag (1) + SecurityID (20) + TranTime (20) + DealType (1) + MatchStepID (10)Segment MIC (4 Stellen) + ISIN (12 Stellen) + Börsentag (8 Stellen) + Zeit Kursbestätigung (12 Stellen) MAX-ONE TVTIC: Segment MIC (4 Stellen) + ISIN (12 Stellen) + Börsentag (8 Stellen) + UTC-Zeit Kursbestätigung (12 Stellen)
1906	RegulatoryTradeIDType	O	O		Integer Art der Regulatory TradeID 5 = TVTIC (Trading venue transaction identifier)

8 Anhang A: Aktuelle Beispiele werden zu einem späteren Zeitpunkt veröffentlicht

Auf eine Berechnung der Tags 9 (Nachrichtenlänge) und 10 (Checksum) wurde in den Beispielnachrichten verzichtet. Sie stehen in der Nachricht mit 9= und 10=. <SOH> bezeichnet den Trenner (Hexadezimal X'01'). Die Werte des ReturnCodes (5555) ebenso wie die Inhalte von OrderRejectReasonTxt (9320) entsprechen den real vergebenen Werten.

Die nachfolgenden Beispiele verwenden als Zentrale 7766, als Filiale 6766, als CompIDs FS7766I7 und FSRH99I7, das Instrument DE0005810055. Die Nachrichten sind für die FIX-Version 4.4 und der Beispiel-Börsentag ist der 31.08.2011.

Erfolgreiche Anmeldung

Logon

Die Zentrale 7766 meldet sich an.

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=A <SOH> 34=13 <SOH> 49=**FS7766I9** <SOH> 52=20110831-07:00:00.000 <SOH> 56=**FSRH99I7** <SOH> 98=0 <SOH> 108=3600 <SOH> 553=**7766** <SOH> 554=11111111 <SOH> **10=** <SOH>

Erfolgreiche Einstellung einer Order

New Order Single Request

Die Zentrale 7766 gibt für die Filiale 6766 eine Kauf-Limit-Order auf, mit der Order-Nominale 2000, dem Preis 9.85 und der Ordergültigkeit Good-Till-Date 05.09.2011.

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=D <SOH> 34=1342 <SOH> 49=FS7766I7 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FSRH99I7 <SOH> 453=2<SOH> 448=**7766** <SOH> 447=D <SOH> 452=**7** <SOH> 448=**6766** <SOH> 447=D <SOH> 452=**1** <SOH> 55=[N/A] <SOH> 48=DE0005810055<SOH> 22=4 <SOH> 11=CLORDINS1 <SOH> 38=**2000** <SOH> 40=2 <SOH> 44=**9.85** <SOH> 54=**1** <SOH> 59=**6** <SOH> 60=20110831-07:00:01.000<SOH> 100=**XSTU**<SOH> 432=**20110905** <SOH> 526=SECORDID1 <SOH> **10=** <SOH>

Execution Report

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=8 <SOH> 34=2551342 <SOH> 49= FSRH99I7 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000<SOH> 56= FS7766I7 <SOH> 453=2 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=7 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=1 <SOH> 55=[N/A] <SOH> 48=DE0005810055<SOH> 22=4 <SOH> 6=0 <SOH> 11=CLORDINS1 <SOH> 14=0 <SOH> 17=20110831000040<SOH> 37=1108314990012 <SOH> 38=2000 <SOH> 39=0 <SOH> 40=2 <SOH> 44=9.85 <SOH> 54=1 <SOH> 59=6 <SOH> 60=20110831-07:00:01.341811<SOH> 100=XSTU <SOH> 150=0 <SOH> 151=2000 <SOH> 432=20110905 <SOH> 526= SECORDID1 <SOH> **10=** <SOH>

Abgelehnte Orderlöschung

OrderCancelRequest

Löschung über Tag 41 (OrigClOrdID) mit Angabe eines falschen Wertes im Tag 54 (Side):

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=F <SOH> 34=1343 <SOH> 49=FS7766I7 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000<SOH> 56=FSRH99I7 <SOH> 453=2 <SOH> 448=**7766** <SOH> 447=D <SOH> 452=7 <SOH> 448=**6766** <SOH> 447=D <SOH> 452=1 <SOH> 55=[N/A] <SOH> 48=DE0005810055<SOH> 22=4 <SOH> 11=CLORDDEL1 <SOH> 38=2000 <SOH> 41=**CLORDINS1** <SOH> 54=**2** <SOH> 60=20110831-07:00:01.000<SOH> 100=XSTU <SOH> 5253=2 <SOH>**10=** <SOH>

OrderCancelReject

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=9 <SOH> 34=49 <SOH> 49= FSRH99I7 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56= FS7766I7 <SOH> 11=CLORDDEL1 <SOH> 37=1108314990012 <SOH> 39=8 <SOH> 41=CLORDID001 <SOH> 60=20110831-07:00:01.000 <SOH> 100=XSTU <SOH> 102=99 <SOH> 434=1 <SOH> 5555=2730 <SOH> 9320=PLEASE REVISE SIDE / SIDE (BUY/SELL) <SOH> 9803=212 <SOH> 453=2 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=7 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=1 <SOH> 10= <SOH>

Ereignismitteilung

Rücknahme einer Kursaussetzung für das Instrument DE0005557508

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=B <SOH> 34=254967 <SOH> 43=Y <SOH> 49= FSRH99I7 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56= FS7766I7 <SOH> 122=20110831-07:00:01.000 <SOH>148=**FIXON** <SOH> 6517=20110831 <SOH> 33=1 <SOH> 58=Withdrawal of price fixing suspension <SOH> 146=1 <SOH> 55=[N/A] <SOH> 48=**DE0005557508** <SOH> 22=4 <SOH> 215=2 <SOH> 216=1 <SOH> 217=XON <SOH> 216=1 <SOH> 217=XSTU <SOH> 10= <SOH>

Erfolgreiche Einstellung eines OTC-Geschäfts

Die Zentrale 7766 gibt ein OTC-Kauf-Geschäft ein, mit dem Kontrahenten 6766.

TradeCaptureReport

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=AE <SOH> 34=15 <SOH> 49=FS7766I7 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FSRH99I7 <SOH> 22=4 <SOH> 30=XFRA <SOH> 31=9.5 <SOH> 32=1000 <SOH> 48=DE0005810055 <SOH> 55=DB1 <SOH> 60=20110831-07:00:00 <SOH> 75=20110831 <SOH> 487=0 <SOH> 570=N <SOH> 571=OTC_RepID_1 <SOH> 856=0 <SOH> 5179=070001 <SOH> 552=2 <SOH> 54=1 <SOH> 453=1 <SOH> 448=**7766** <SOH> 447=D <SOH> 452=7 <SOH> 37=[N/A] <SOH> 15=EUR <SOH> 54=2 <SOH> 453=1 <SOH> 448=**6766** <SOH> 447=D <SOH> 452=17 <SOH> 37=[N/A] <SOH> 10= <SOH>

TradeCaptureReportAck

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=AR <SOH> 34=24 <SOH> 49=FSRH99I7 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FS7766I7 <SOH> 22=4 <SOH> 30=XFRA <SOH> 48=DE0005810055 <SOH> 55=[N/A] <SOH> 60=20110831-07:00:01.000 <SOH> 150=0 <SOH> 487=0 <SOH> 571=OTC_RepID_1 <SOH> 856=0 <SOH> 880=EDF1108310150002 <SOH> 10= <SOH>

OTC-Geschäft als Schlussnote

Die Zentrale 7766 empfängt ein OTC-Kauf-Schlussnote, mit dem Kontrahenten 6766.

TradeCaptureReportSno

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=USN <SOH> 34=25 <SOH> 49=FSRH99I9 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=**FS7766I9** <SOH> 22=4 <SOH> 30=XFRA <SOH> 31=9.5 <SOH> 32=1000 <SOH> 48=DE0005810055 <SOH> 55=DB1 <SOH> 60=20110831-07:00:01.987 <SOH> 75=20110831 <SOH> 283=XFRA <SOH> 487=0 <SOH> 570=N <SOH> 571=0831130332945860 <SOH> 829=9012 <SOH> 856=0 <SOH> 880=EDF1108310150002 <SOH> 7017=1 <SOH> 7680=1 <SOH> 9954=N <SOH> 454=2 <SOH> 455=DEUTSCHE BOERSE NA O.N. <SOH> 456=8 <SOH> 455=581005 <SOH> 456=B <SOH> 552=2 <SOH> 54=1 <SOH> 37=[N/A] <SOH> 453=4 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=24 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=1 <SOH> 448=7766 <SOH> 447=D <SOH> 452=27 <SOH> 448=199999 <SOH> 447=D <SOH> 452=11 <SOH> 381=9500 <SOH> 119=9496.2 <SOH> 120=EUR <SOH> 58=FIX/ <SOH> 9471=1 <SOH> 9473=0 <SOH> 9476=-3.8 <SOH> 54=2 <SOH> 37=[N/A] <SOH> 453=3 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=17 <SOH> 448=529900FU4WJ2XT7BVE31 <SOH> 447=N <SOH> 452=17 <SOH> 448=6766 <SOH> 447=D <SOH> 452=27 <SOH> 768=2 <SOH> 769=20110831-07:00:01.000000 <SOH> 770=1 <SOH> 769=20110831-07:00:01.153521 <SOH> 770=2 <SOH> 10= <SOH>

9 Anhang B: Einschränkungen von Formaten und Strukturen

Legende

Sortierung: Nach Namen aufsteigend sortiert

Überschriften: E/A bedeutet eingehende/ausgehende Nachrichten – aus Sicht des BT-FIX Gateway. Die restlichen Angaben sind selbsterklärend.

Inhalte: E/A ist nur dann belegt, wenn ein Format **nicht** für beide Richtungen gilt.
Restriktionen/Werte enthält (fallweise) den Verweis auf ein optionales gemeinsames Basisformat, und eine Erläuterung der Restriktionen bzw. Abweichungen vom Standard.
Handelssystem enthält das/die System(e), für welche die Beschreibung gilt. Ist ein Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system nicht aufgeführt, dann ist die Verwendung des Tags generell in diesem Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system nicht zulässig.

Tag	Format/Struktur	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
	KVNr		Gültige Kassenvereinsnummer	nicht systemspezifisch
	Party		die Gruppe besteht außer für eine Repeating Group vom Typ "session", "Executing System", "Settlement Location", "Buyer Seller", „Execution within firm“ und „Investment Decision Maker“ nur aus den drei Feldern PartyID PartyIDSource PartyRole	nicht systemspezifisch
		A	für den Typ "session" werden zusätzlich genutzt: NoPartySubIDs (Tag 802), um "1" erhöht PartySubID (Tag 523) = Identifikationsmerkmal PartySubIDType (Tag 803) immer = "4040" für den Typ "Executing System" werden zusätzlich genutzt: NoPartySubIDs (Tag 802, um "1" erhöht) PartySubID (Tag 523) = "[N/A]" PartySubIDType (Tag 803) immer = "3" für den Typ "Settlement Location" werden zusätzlich genutzt: NoPartySubIDs (Tag 802), um "2" erhöht PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal" PartySubIDType (Tag 803) = "4060" PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal" PartySubIDType (Tag 803) = "4080" oder NoPartySubIDs (Tag 802), um "2" erhöht PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal" PartySubIDType (Tag 803) = "4070" PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal" PartySubIDType (Tag 803) = "4090" für den Typ "Buyer Seller" werden zusätzlich genutzt: NoPartySubIDs (Tag 802) um "1" erhöht PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal" PartySubIDType (Tag 803) = "4050" für den Typ „Execution within firm“ wird zusätzlich genutzt: PartyRoleQualifier (Tag 2376) = „22“ (Algorithmus) oder „24“ (Nat. Person) für den Typ „Investment Decision Maker“ wird zusätzlich genutzt:	nicht systemspezifisch

Tag	Format/Struktur	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
			PartyRoleQualifier (Tag 2376) = „22“ (Algorithmus) oder „24“ (Nat. Person) für den Typ "Client Identification Code“ wird zusätzlich genutzt: PartyRoleQualifier (Tag 2376) = „23“ (LEI) oder „24“ (Nat. Person)	
	Price		das FIX Float Format Price (15 signifikante Stellen, zusätzlich optional Dezimalpunkt und Vorzeichen) ist eingeschränkt. Siehe hierzu die Float-Format-Angabe Float (13,5) bei den jeweiligen Tags: 44 Price, 99 StopPx. Besonderheit bei Tag 31 LastPx: Float (13,5) bei den Ordernachrichten. Float (10,4) bei den Trade-Nachrichten.	nicht systemspezifisch
	Qty		das FIX Float Format Qty (15 signifikante Stellen, zusätzlich optional Dezimalpunkt und Vorzeichen) ist eingeschränkt. Das Format ist immer Float (12,3)	nicht systemspezifisch

10 Anhang C: Benutzerdefinierte Tags

Legende

Sortierung: Nach Tags aufsteigend sortiert

Überschriften: E/A bedeutet eingehende/ausgehende Nachrichten – aus Sicht des BT-FIX Gateway. Die restlichen Angaben sind selbsterklärend.

Inhalte: E/A ist nur dann belegt, wenn ein Format **nicht** für beide Richtungen gilt.
Restriktionen/Werte enthält (fallweise) den Verweis auf ein optionales gemeinsames Basisformat, und eine Erläuterung der Restriktionen bzw. Abweichungen vom Standard.
Handelssystem enthält das/die System(e), für welche die Beschreibung gilt. Ist ein Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system nicht aufgeführt, dann ist die Verwendung des Tags generell in diesem Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system nicht zulässig.

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
~~5048~~	~~OrdSubStatus~~	~~A~~	~~Belegung analog SAKI GV-Codes bei Vestima-Aufträgen~~ ~~A = Löschung von Vestima empfangen~~ ~~B = Löschung von Vestima / OHA durchgeführt~~ ~~C = Löschung von Vestima / OHA abgelehnt~~ ~~D = Provisionscheck in Vestima negativ~~ ~~E = Provisionscheck in Vestima positiv~~ ~~F = Einstellung des Auftrages wurde von Vestima Depotbank (OHA) positiv bestätigt~~ ~~G = Auftragslöschung durch Vestima Depotbank~~ ~~H = disabled~~ ~~I = Auftragseinstellung von Vestima empfangen~~	~~INVESTRO/Vestima~~
5053	TradeType2	E	1 (DVP) = FZ	~~XONTRO~~T7 GSE, für TradeCaptureReport
		A	1 (DVP) = FZ 7 (when issued) = FE	~~XONTRO~~T7 GSE, für TradeCaptureReportSno
~~5076~~	~~FundReinvestIncome~~		~~Y = Kauf zu Wiederanlage~~ ~~Space = sonstiges~~	~~INVESTRO~~
~~5078~~	~~FundSpecialDealDiscount~~		~~Y = Kauf zum Rücknahmepreis~~ ~~Space = sonstiges~~	~~INVESTRO~~
5156	UnreleasedDate		LocalMktDate Gültigkeit ab	~~XONTRO,~~ MAX-ONE~~, INVESTRO~~
5177	Source	A	<session>	nicht systemspezifisch, nur 4.2
5179	TradeTime	E	Abschlussuhrzeit (hhmmss)	~~XONTRO~~T7 GSE, für TradeCaptureReport
5253	OrdTypeExt Dieses Feld wird ausschließlich ~~im Order Cancel Request und~~ für EG-Orders verwendet		~~1 = "Market"~~ ~~2 = "Limit"~~ ~~3 = "Stop"~~ ~~4 = "Stop Limit"~~ ~~K = "Market with Leftover"~~ ~~M = "Midpoint"~~ ~~I = "Iceberg"~~ E = "EG-Order"	~~Xetra~~ MAX-ONE

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
			~~1 = "Market"~~ ~~2 = "Limit"~~ ~~3 = "Stop"~~ ~~4 = "Stop Limit"~~	~~Xetra Ffm-2~~
			~~E = "EG-Order"~~	~~XONTRO, MAX-ONE~~
5427	IntrAttribType	A	I = Interest (Zinsen) D = Discount (Diskont)	~~XONTROT7 GSE~~, für TradeCaptureReportSno
5458	MDDelayed	E	Delay-Indikator	~~XONTROT7 GSE~~, für TradeCaptureReport
~~5476~~	~~PrivateReference~~	~~A~~	~~Ergänzung zu OrdSubStatus~~	~~INVESTRO/Vestima~~
5494	LastTrader	A	Hat das Basisformat KVNr. Ist eine in ~~XONTROT7 GSE~~ zugelassene (Makler)KVNr	~~XONTROT7 GSE~~, für TradeCaptureReportSno
5555	ReturnCode	A	Fehlercode	nicht systemspezifisch
5862	UpdateReason	A	Grund der systemgenerierten Order-Änderung bzw. -Löschung	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE~~, Xetra, Xetra Ffm-2~~
~~5665~~	~~MKTXPriceDiff~~	~~A~~	~~Kursdifferenz~~	~~XONTRO für TradeCaptureReportSno~~
~~5681~~	~~ExchangeTradeType~~	~~E~~	~~Kennzeichnung Emissionsgeschäft.~~	~~XONTRO für TradeCaptureReport~~
~~5689~~	~~VersionID~~		~~Integer(18), kein Vorzeichen, nimmt dateLstUpdDat auf nur die von den Handelssystemen gelieferten Werte dürfen in Requests wieder verwendet werden~~	~~Xetra, Xetra Ffm-2~~
~~5944~~	~~InitialDisplayQty~~	~~A~~	~~Siehe Qty~~	~~Xetra~~
5946	PendingReason	A	~~1 = "buffered"~~ ~~2 = "locked stock"~~ ~~3 = "response delayed (intraday)"~~ ~~4 = "order status unknown (end of day)"~~2 = "locked stock" 4 = "order status unknown (end of day)"	~~Xetra, Xetra Ffm-2~~ MAX-ONE
		~~A~~	~~2 = "locked stock"~~ ~~4 = "order status unknown (end of day)"~~	~~MAX-ONE~~
		A	2 = "locked stock" 4 = "order status unknown (end of day)" 5 = "verification pending"	~~XONTROT7 GSE~~
		~~A~~	~~4 = "order status unknown (end of day)"~~ ~~5 = "verification pending"~~ ~~Nur für Aufträge in Vestima-Gattungen.~~	~~INVESTRO/Vestima~~
6031	EnteringFirm		<entering firm>	nicht systemspezifisch, nur 4.2
~~6034~~	~~ConcessionAmt~~	~~A~~	~~Bonifikations-Differenz-Betrag~~	~~XONTRO für TradeCaptureReportSno~~
6042	CxlReason	E	1 = Cancel durch Kill-Funktion	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE
6126	OrigLeavesQty	E	Siehe Qty	~~XONTROT7 GSE~~
6141	TradeQty	A	Siehe Qty	~~XONTROT7 GSE~~ für TradeCaptureReportSno
6255	EndTime		Ende Börsenzeit	~~XONTROT7 GSE~~

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
~~6475~~	~~ClientIndicator~~	~~A~~	~~Y = IW-Geschäft~~	~~XONTRO für TradeCaptureReportSno~~
6489	TriggerIndicator	A	A = Aktivierung einer EG-Order ~~B = Order auf EG zurückgesetzt~~ Y = Trigger Stop Order	~~XONTRO,~~ MAX-ONE ~~XONTRO~~ ~~XONTRO, MAX-ONE, Xetra, Xetra Ffm-2~~T7 GSE
6516	NewsValidUntil		Datum bis	~~XONTRO~~T7 GSE
6517	NewsEventDate		Datum bzw. Datum ab	~~XONTRO~~T7 GSE
~~6555~~	~~OrigTrdMatchID~~	~~A~~	~~Ursprüngliche Geschäftsnummer~~	~~XONTRO für TradeCaptureReportAck~~
6556	BusinessTransactionType		"1" = TradeAdvice	~~XONTRO~~T7 GSE für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportAck
~~6583~~	~~SpreadPremium~~	~~A~~	~~Bonifikationsbetrag~~	~~XONTRO für TradeCaptureReportSno~~
~~6584~~	~~SpreadPctPremium~~		~~Bonifikationssatz~~	~~INVESTRO, XONTRO bei EnterOTC~~
~~6585~~	~~SpreadPctDiscount~~	~~A~~	~~Wiederanlagerabatt in Prozent~~	~~INVESTRO, XONTRO für TradeCaptureReportSno~~
~~6586~~	~~CashOffset~~		~~Wiederanlagerabatt~~	~~XONTRO, für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno~~
6611	TotalAccruedInterestAmt	A	Akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag	~~INVESTRO, XONTRO~~T7 GSE für TradeCaptureReportSno
6732	DealerNote	A	diverse Unterfelder mit \ getrennt. Die Beschreibung folgt im Anschluss dieser Tabelle	~~INVESTRO, XONTRO~~T7 GSE für TradeCaptureReportSno
~~6893~~	~~Profit~~	~~A~~	~~Zwischengewinn~~	~~INVESTRO, XONTRO für TradeCaptureReportSno~~
7017	VolumeIndicator	E	1 =Stück 2 = Prozent 3 = Promille ~~4 = Punkte~~ 9 = Sonstige	~~XONTRO~~T7 GSE für TradeCaptureReport
		A	1 =Stück 2 = Prozent 3 = Promille	~~XONTRO~~T7 GSE für TradeCaptureReportSno
~~7491~~	~~CustomPrice1~~		~~Ausgabepreis wenn Tag 5076 oder 5078 belegt~~	~~INVESTRO, XONTRO für TradeCaptureReportSno~~
~~7493~~	~~CustomRate1~~	~~A~~	~~Ausgabeaufschlag~~	~~XONTRO~~
7566	TimezoneOffset	E	Abweichung zu UTC	~~XONTRO~~T7 GSE für TradeCaptureReport
7567	ReportedPxDiff	E	Y = Abweichender Preis Indikator	~~XONTRO~~T7 GSE für TradeCaptureReport
7568	ReportedPxReason	E	N = negotiated Trade	~~XONTRO~~T7 GSE für TradeCaptureReport
7680	OTCInd		0 = börslich 1 = außerbörslich (Default)	nicht systemspezifisch
7931	VenueID		<executing system>	nicht systemspezifisch, nur 4.2
9318	MktMkerID		~~<systematic internaliser>~~ <market maker>	nicht systemspezifisch, nur 4.2 wird ignoriert

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
9320	OrderRejectReasonTxt	A	Fehlertext des Handelssystems	nicht systemspezifisch
9471	NoTransactionCosts		<courtage>	~~XONTROT7 GSE~~ für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno
9473	TransactionCostCode		<courtage>	~~XONTROT7 GSE~~ für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno
9476	TransactionCostAmt		<courtage>	~~XONTROT7 GSE~~ für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno
~~9583~~	~~MIFIDInternalizationIndicator~~		~~1 = "Facilitation"~~ ~~4 = "No"~~	~~Xetra~~
9591	PriceCheckingFlag	A	2 = severe (PriceAlert)	~~XONTROT7 GSE~~ für TradeCaptureReportAck
9596	ClientFreeField1		String auf Float(10,3) > 0 eingeschränkt ~~Falls Tag 9597 "PM" enthält, muss der Wert <= 99,999 sein~~ Falls Tag 9597 "PD" enthält, muss der Wert <= 9999999,990 sein (letzte Nachkommastelle = 0)	~~XONTROT7 GSE~~
9597	ClientFreeField2		"PD" = Absolutbetrag ~~"PM" = Promille~~ Space = None	~~XONTROT7 GSE~~
9803	TradingSystemID	A	0 = Gateway ~~4 = Xetra~~ ~~5 = Xetra Ffm-2~~ 111 = Connector 112 = Connector 120 = XEO MAX-ONE ~~121 = XEO Xetra~~ ~~122 = XEO Xetra Ffm-2~~ 212 = ~~XONTROT7 GSE~~ 312 = MAX-ONE 313 = MAX-ONE ~~612 = INVESTRO/Vestima~~	nicht systemspezifisch
~~9807~~	~~RegFeeFlag~~	~~A~~	~~Courtage-Schlüssel~~	~~XONTRO für TradeCaptureReportSno~~
~~9893~~	~~DiscountRate~~	~~A~~	~~Diskontsatz~~	~~XONTRO für TradeCaptureReportSno~~
~~9933~~	~~CombinedOrderType~~	~~A~~	~~Z = Zeichnungsauftrag~~ ~~H = Fondsegment Hannover~~ ~~In den Fällen, in denen dieses Tag geliefert wird, wird das Gültigkeitsdatum der Order vom Handelssystem gesetzt und im Feld ExpireDate (Tag 432) geliefert.~~	~~XONTRO~~
9938	ClearingHandlingType	A	I = internes Settlement A = bilaterale Aggregation: das, Geschäft welches in die Aggregation einfließt. B = bilaterale Aggregation: das aggregierte Abwicklungs-Geschäft.	~~XONTROT7 GSE~~
9954	NextMsgFlag	A	~~Y = (weitere) Folgesätze werden geliefert~~ N = keine (weiteren) Folgesätze	~~XONTROT7 GSE~~ für TradeCaptureReportSno
20003	PartyIDClientID	E	<client identification code>	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
21103	PartyIDClientIDQualifier	E	<client identification code>	~~XONTROT~~7 GSE, MAX-ONE
21303	PartyIDClientIDSource	E	<client identification code>	~~XONTROT~~7 GSE, MAX-ONE
20122	PartyIDInvestmentDecisionMaker	E	<Investment Decision Maker>	~~XONTROT~~7 GSE, MAX-ONE
21222	PartyIDInvestmentDecisionMakerQualifier	E	<Investment Decision Maker>	~~XONTROT~~7 GSE, MAX-ONE
21422	PartyIDInvestmentDecisionMakerSource	E	<Investment Decision Maker>	~~XONTROT~~7 GSE, MAX-ONE
20012	PartyIDExecutingTrader	E	<Execution within firm>	~~XONTROT~~7 GSE, MAX-ONE
21112	PartyIDExecutingTraderQualifier	E	<Execution within firm>	~~XONTROT~~7 GSE, MAX-ONE
21312	PartyIDExecutingTraderSource	E	<Execution within firm>	~~XONTROT~~7 GSE, MAX-ONE

Beschreibung des Tags 6732 DealerNote

Das Tag 6732 ist in mehrere Unterfelder unterteilt, welche durch \ getrennt sind. Der Initwert dieser Unterfelder ist i.d.R. Spaces, bei dem Unterfeld abweichender Kontrahenten Kurs ist der Init-Wert „000000,0000“.

Tag	Feldname	Unter-Feldname	Format	Restriktionen/Werte
6732	DealerNote	Kennzeichen Lieferfreigabe	Char	J, N
		Trenner	Char	\
		abbweichender Kontrahentenkurs	String(11)	6 Vorkomma, 4 Nachkomma
		Trenner	Char	\
		Kennzeichen für Abweichender Schlusstag	String(2)	Konstante "AS“
		Trenner	Char	\
		Art des Wertpapiers	String(3)	Konstante "SHS" = Aktien, "BON" = Renten, "BCE" = zertifikatsähnl. Renten, "WTS" = Warrants, "CER" = Zertifikate, "FUN" = Fonds, "SUB" = Nebenrechte, "RTE" = Genussrechte, "UNT" = Units, "MSC" = Sonstige
		Trenner	Char	\
		~~Verwahrmöglichkeit~~Verwahrart	String(3)	Konstante “GS“ = Girosammelverwahrung “AKV“ = Clearstream Banking “NCT“ = Non-Collective Safe Custody via T2S (NCSC-T) “STR“ = Streifbandverwahrung “WPR“ = Wertpapierrechnung
		Trenner	Char	\
		Zinstermin	String(8)	~~bspw. "21.07.G~~ "GD812 + GD813 (siehe u.a. Erläuterung)
		Trenner	Char	\
		APMT-Konstante	String(4)	
		Trenner	Char	"APMT" = gegen Zahlung
		Abschlusskurs-Währung	String(3)	\
		Trenner	Char	\
		Kurswert-Währung	String(3)	
		Trenner	Char	\
		Kursdifferenz-Währung	String(3),	
		Trenner	Char	\
		Stückzins-Währung	String(3),	
		Trenner	Char	\
		Kennzeichen für Courtage	String(6),	
		Trenner	Char	Konstante /BROK/
		Kennzeichen für Spesen	String(6)	\
		Trenner	Char	Konstante /FEES/
		Kennzeichen Wiederanlagerabatt	String(6)	\

Tag	Feldname	Unter-Feldname	Format	Restriktionen/Werte
		Trenner	Char	Konstante /MISC/
		Kennzeichen für Bonifikation	String(6)	\
		Trenner	Char	Konstante /MISC/
		Kennzeichen für Boni-Differenz	String(6)	\
		Trenner	Char	Konstante /MISC/
		Kennzeichen für Provision	String(6)	\
		Trenner	Char	Konstante /COMM/
		Courtage-Währung	String(3)	\
		Trenner	Char	= Abrechnungswährung
		Spesen-Währung	String(3)	\
		Trenner	Char	= Abrechnungswährung
		Wiederanlagerabatt-Währung	String(3)	\
		Trenner	Char	= Abrechnungswährung
		Bonifikations-Währung	String(3)	\
		Trenner	Char	= Abrechnungswährung
		Boni-Differenz-Währung	String(3)	\
		Trenner	Char	= Abrechnungswährung
		Provisions-Währung	String(3)	\
		Trenner	Char	= Abrechnungswährung
		Kennzeichen Wiederanlagerabatt	String(2)	\
		Trenner	Char	Konstante "WA"
		Kennzeichen für Bonifikation	String(2)	\
		Trenner	Char	Konstante "BO"
		Boni-Schlüssel	String(2)	\
		Trenner	Char	01 = % auf Kurswert, 02 = EO pro Stück, 03 = % auf Nennwert
		Kennzeichen für Boni-Differenz	String(2)	\
		Trenner	Char	Konstante "BD"
		Kennzeichen für Order-Referenz	String(5)	\
		Trenner	Char	Konstante "MT599" (Indikator aus MT512 das ein MT599 folgt)
		Eingeber-ID	String(6)	\
		Trenner	Char	~~Sechsstelliges ID-KZ des eingebenden Maklers~~ (wird nicht mehr verwendet)
				\

Erläuterung Zinstermin:

Das 8-stellige Feld Zinstermin an der 6. Position der DealerNote wird 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**

11 Anhang D: Erweiterungen des 4.2 Sprachumfangs

Sortierung: Nach Tags aufsteigend sortiert

Tag	Feldname
447	PartyIDSource
448	PartyID
452	PartyRole
453	NoPartyIDs
454	NoSecAltID
455	SecurityAltID
456	SecurityAltIDSource
487	TradeReportTransType
523	PartySubID
526	SecondaryClOrdID
552	NoSides
553	Username
554	Password
570	PreviouslyReported
571	TradeReportID
572	TradeReportRefID
578	TradeInputSource
625	TradingSessionSubID
691	Pool
751	TradeReportRejectReason
768	NoTrdRegTimestamps
769	TrdRegTimestamp
770	TrdRegTimestampType
789	NextExpectedMsgSeqNum
802	NoPartySubIDs
803	PartySubIDType
818	SecondaryTradeReportID
820	TradeLinkID
829	TrdSubType
856	TradeReportType
880	TrdMatchID
923	UserRequestID
924	UserRequestType
925	NewPassword
926	UserStatus
927	UserStatusText
1094	PegPriceType
1125	OrigTradeDate

Tag	Feldname
1126	OrigTradeID
1138	DisplayQty
1409	SessionStatus
6042	CxlReason
20003	PartyIDClientID
21103	PartyIDClientIDQualifier
21303	PartyIDClientIDSource
20122	PartyIDInvestmentDecisionMaker
21222	PartyIDInvestmentDecisionMakerQualifier
21422	PartyIDInvestmentDecisionMakerSource
20012	PartyIDExecutingTrader
21112	PartyIDExecutingTraderQualifier
21312	PartyIDExecutingTraderSource

12 Anhang E: Erweiterungen des 4.4 Sprachumfangs

Sortierung: Nach Tags aufsteigend sortiert

Tag	Feldname
1094	PegPriceType
1125	OrigTradeDate
1126	OrigTradeID
1138	DisplayQty
1409	SessionStatus
6042	CxlReason

13 Anhang F: Abweichende Belegungen von Standardtags

Legende

Sortierung: Nach Tags aufsteigend sortiert

Überschriften: E/A bedeutet eingehende/ausgehende Nachrichten – aus Sicht des BT-FIX Gateway. Die restlichen Angaben sind selbsterklärend.

Inhalte: E/A ist nur dann belegt, wenn ein Format **nicht** für beide Richtungen gilt.
Restriktionen/Werte enthält (fallweise) den Verweis auf ein optionales gemeinsames Basisformat, und eine Erläuterung der Restriktionen bzw. Abweichungen vom Standard.
Handelssystem enthält das/die System(e), für welche die Beschreibung gilt. Ist ein Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system nicht aufgeführt, dann ist die Verwendung des Tags generell in diesem Handels~~- bzw. Abwicklungs~~system nicht zulässig.

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
1	Account		Siehe AcctTypCod und AcctTypNo	
	~~AcctTypCod~~		~~"A" = Agent~~ ~~"E" = BEST Executor~~ ~~"I" = Issuer (Quote Provider)~~ ~~"L" = Liquidity Provider~~ ~~"M" = Betreuer~~ ~~"P" = Proprietary~~ ~~"Q" = Liquidity Manager~~ ~~mandatory~~	~~Xetra, Xetra Ffm-2~~
	AcctTypCod		"A" = Agent "P" = Proprietary optional	~~XONTROT7 GSE~~ (Orderfunktionalitäten), MAX-ONE
			~~optional~~ ~~*ignoriert*~~	~~INVESTRO/Vestima~~
			"A" = Agent (Kunde) "P" = Proprietary (Banken Eigengeschäft) "E" = Proprietary (Makler Eigengeschäft) optional	~~XONTROT7 GSE~~ für Schlussnoten
	~~AcctTypNo~~		~~mandatory~~	~~Xetra, Xetra Ffm-2~~
	AcctTypNo		Nur "1" ist zulässig optional	~~XONTROT7 GSE~~-Order, MAX-ONE
			~~"A" = Geschäft des Maklers, aus systemseitiger Aufgabenschließung, nur zusammen mit AcctTypCod="E" möglich~~ ~~"E" = Geschäft des Maklers, nur zusammen mit AcctTypCod="E" möglich~~ "1" = Geschäft der Bank, nur zusammen mit AcctTypCod="A" oder "P" möglich optional	~~XONTROT7 GSE~~ für Schlussnoten
			~~optional~~ ~~*ignoriert*~~	~~INVESTRO/Vestima~~
8	BeginString		nur "FIX.4.2" und "FIX.4.4" sind zulässig	

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
11	ClOrdID		String(16), muss für die Laufzeit einer Order eindeutig sein 1. Nachricht: ClOrdID = ABC1234 2. Nachricht: ClOrdID = abc1234 -> doppelt bzw. bereits verwendet	nicht systemspezifisch
12	Commission		Das FIX Float Format "Amt" (15 signifikante Stellen, zusätzlich optional Dezimalpunkt und Vorzeichen) muss sich entsprechend der Lage des im String enthaltenen Dezimalpunkts auf das Format Snum(10,2) mit genau 2 Nachkommastellen abbilden lassen. Ist dies nicht möglich, wird die Nachricht als fehlerhaft behandelt	~~XONTROT~~T7 GSE
21	HandlInst	E	Char für "FIX.4.2" mandatory für "FIX.4.4." optional *ignoriert*	nicht systemspezifisch
22	SecurityIDSource		nur der Wert "4" ist zulässig	nicht systemspezifisch
33	LinesOfText	A	Bei Nachrichten des Sessionlevels immer mit "1" belegt. Bei Nachrichten des Applikationslevels sind die Werte "1", "2" zulässig.	nicht systemspezifisch
35	MsgType	E	nur die Werte "0", "1", "2", "4", "5", "A", "D", "F", "G", "BE", "AE" sind zulässig Für 4.2 wird "BE" durch "UBE" und "AE" durch "UAE" ersetzt.	nicht systemspezifisch
		A	nur die Werte "0", "1", "2", "3", "4", "5", "8", "9", "A", "B", "j", "BF", "AR", "USN" sind zulässig Für 4.2 wird "BF" durch "UBF" und "AR" durch "UAR" ersetzt.	nicht systemspezifisch
37	OrderID		String(~~1~~320), eindeutiger Schlüssel im jeweiligen Handelssystem	Im Feld (Tag 37 OrderID) des ExecutionReports wird zukünftig für jeden Marktplatz (XDUS, XHAM, XHAN) eine börsliche T7 Ordernummer geliefert. Die Vergabe der T7 Ordernummern entspricht dem bestehenden Verfahren, welches auch im T7 Spezialistenmodell der FWB genutzt wird.~~nicht systemspezifisch~~
38	OrderQty		Siehe Qty	nicht systemspezifisch
39	OrdStatus	A	0 = "New"" 1 = "Partially filled" 2 = "Filled" 4 = "Canceled" 6 = "Pending Cancel" 8 = "Rejected" A = "Pending New" C = "Expired" E = "Pending Replace"	~~XONTROT~~T7 GSE, ~~Xetra, Xetra Ffm-2,~~ MAX-ONE

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
		A	~~0 = "New"~~ ~~2 = "Filled"~~ ~~4 = "Canceled"~~ ~~6 = "Pending Cancel"~~ ~~8 = "Rejected"~~ ~~A = "Pending New"~~	~~INVESTRO/Vestima~~
40	OrdType		1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" ~~4 = "Stop Limit"~~ ~~K = "Market with Leftover"~~ ~~P = "Pegged"~~	T7 GSE~~Xetra~~
			1 = "Market" 2 = "Limit" 3 = "Stop" 4 = "Stop Limit"	~~Xetra Ffm-2,~~ MAX-ONE
			~~1 = "Market"~~ ~~2 = "Limit"~~ ~~3 = "Stop"~~	~~XONTRO~~
			~~1 = "Market"~~	~~INVESTRO/Vestima~~
44	Price		Siehe Price	nicht systemspezifisch
55	Symbol	E	ignoriert	nicht systemspezifisch
		A	immer auf "[N/A]" gesetzt	nicht systemspezifisch
58	Text		auf Länge 2~~5~~4 beschränkt ~~An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben~~ Im Request TradeCaptureReport sind Texteingaben mit einer Gesamtlänge von 24 Bytes zulässig (2 x 12 Byte für die Übertragung in die T7 Felder FreeText1 und FreeText2)	nicht systemspezifisch
59	TimeInForce		0 = "Day" ~~3 = "Immediate or Cancel"~~ ~~4 = "Fill or Kill"~~ 6 = "Good till Date"	T7 GSE, MAX-ONE~~Xetra~~
			~~0 = "Day"~~ ~~6 = "Good till Date"~~	~~Xetra Ffm-2, MAX-ONE, XONTRO~~
			~~*ignoriert*~~	~~INVESTRO/Vestima~~
60	TransactTime	E	*ignoriert*	nicht systemspezifisch
98	EncryptMethod		nur der Wert "0" ist zulässig	nicht systemspezifisch
99	StopPx		Siehe Price	nicht systemspezifisch
100	ExDestination		MIC Code ~~XBER,~~ XDUS, ~~XETR,~~ XHAN, XHAM, XMUN, ~~XSTU,~~ XFRA ~~XINV adressiert INVESTRO/Vestima~~	nicht systemspezifisch
~~110~~	~~MinQty~~		~~siehe **Qty**~~ ~~nur bei Midpoint Orders~~	~~Xetra~~
150	ExecType	A	0 = "New"" 4 = "Canceled" 5 = "Replace" 6 = "Pending Cancel" 8 = "Rejected" A = "Pending New" C = "Expired" E = "Pending Replace F = "Trade"	~~XONTRO~~T7 GSE, ~~Xetra, Xetra Ffm-2,~~ MAX-ONE

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
		A	~~0 = "New""~~ ~~4 = "Canceled"~~ ~~6 = "Pending Cancel"~~ ~~8 = "Rejected"~~ ~~A = "Pending New"~~ ~~D = "Restated"~~ ~~F = "Trade"~~ ~~I = "Order Status"~~	~~INVESTRO/Vestima~~
156	SettlCurrFxRateCalc		nur D = "divide" ist zulässig	~~XONTROT7 GSE~~
283	LocationID	E	*ignoriert*	
336	TradingSessionID		nur 1 = "Day" ist zulässig	nicht systemspezifisch
447	PartyIDSource		Für TradeCaptureReportSno sind die Werte "D", „N“ und "B" zulässig, ansonsten ist nur der Wert "D" und „P“ zulässig.	nicht systemspezifisch
~~448~~	~~<agent>~~ ~~PartyID~~		~~String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DEAG/REAG)~~	~~INVESTRO/Vestima~~
448	<buyer seller> PartyID		In Kombination mit PartyIDSource=D Muss das Basisformat KVNr besitzen. Muss eine in ~~XONTROT7 GSE~~ zugelassene (Käufer/Verkäufer) KVNr sein ~~In Kombination mit PartyIDSource=B~~ ~~String(11) Vestima-BIC des Kontrahenten (SELL/BUY)~~	nicht systemspezifisch ~~INVESTRO/Vestima~~
448	<clearing firm> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen. Muss eine in ~~XONTROT7 GSE~~ zugelassene (Clearer)KVNr sein	nicht systemspezifisch
448	<clearing organization> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen. Muss eine in ~~XONTROT7 GSE~~ zugelassene KVNr sein	nicht systemspezifisch
448	<contra firm> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen. Muss eine in ~~XONTROT7 GSE~~ zugelassene (Kontrahenten) KVNr sein. Ausnahme: Im TradeCaptureReportSno wird <contra firm> als KVNr und als LEI ausgegeben.	nicht systemspezifisch
~~448~~	~~<custodian>~~ ~~PartyID~~		~~String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DECU/RECU)~~	~~INVESTRO/Vestima~~
448	<customer account> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen. Muss eine in ~~XONTROT7 GSE~~ zugelassene (SNO-Empfänger)KVNr sein	nicht systemspezifisch
448	<entering firm> PartyID		Ist im Gegensatz zum FIX Standard mandatory. Muss das Basisformat KVNr besitzen. Die KVNr muss der Anschlussinhaber für die mitgelieferte SenderCompID sein. Wird nur eine "Party" geliefert, dann müssen auch alle Restriktionen des Formats ExecutingFirm erfüllt sein.	nicht systemspezifisch
448	<executing firm> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen.	
			Muss eine in ~~XONTROT7 GSE~~ zugelassene KVNr mit entsprechender userID sein.	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE
			~~Muss als zulässige KVNr, die eine MemberID repräsentiert, in Xentric definiert sein.~~	~~Xetra, Xetra Ffm-2~~

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
448	<executing system> PartyID	A	String folgende Belegung ist möglich: ~~"XETRA"~~ ~~"XETRA-2"~~ ~~"XONTROT7 GSE~~" "MAX-ONE" ~~"INVESTRO"~~	~~Xetra, Xetra Ffm-2,~~ ~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE~~, INVESTRO~~
~~448~~	~~<execution venue> PartyID~~		~~String(12), Code zur Identifizierung des gemeldeten Geschäfts.~~ ~~Folgende Belegung ist möglich:~~ ~~• Konstante "OTC" für OTC-Geschäfte~~ ~~• Konstante "SI" für systematische Internalisierer~~ ~~zur Identifizierung einer Plattform:~~ ~~• "B" plus BIC (ISO 9662, 11-stellig alphanumerisch)~~ ~~• "M" plus MIC (ISO 10383, 4-stellig alphanumerisch)~~ ~~• "I" plus IBEI (ISO 16327, 10-stellig alphanumerisch)~~	~~INVESTRO/Vestima~~
~~448~~	~~<intermediary> PartyID~~		~~String(10) numerisch, INVESTRO-Vertriebspartner~~	~~INVESTRO~~
448	<market maker> PartyID		Muss das Basisformat KVNr besitzen.	
			Muss eine in ~~XONTROT7 GSE~~ zugelassene (Makler)KVNr sein.	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE
			~~nicht erforderlich, ignoriert~~	~~INVESTRO/Vestima, Xetra, Xetra Ffm-2~~
448	<order origination trader> PartyID		String(6), Händlernummer	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE
~~448~~	~~<report originator> PartyID~~		~~String(11), Code zur Identifizierung des meldenden Instituts~~	~~INVESTRO/Vestima~~
~~448~~	~~<session> PartyID~~	~~A~~	~~String(5), Xetra MemberID~~	~~Xetra, Xetra Ffm-2~~
~~448~~	~~<session>~~ ~~PartyID~~		String(4), KVNr des Eingebers	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE~~, INVESTRO/Vestima~~
~~448~~	~~<settlement location> PartyID~~		~~String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (PSET)~~	~~INVESTRO/Vestima~~
~~448~~	~~<systematic internaliser> PartyID~~		~~String(5), Xetra MemberID~~	~~Xetra~~
448	<client identification code> PartyID		String(20), client identification code	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE
448	<Execution within firm> PartyID		String(20), Execution within firm	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE
448	<Investment Decision Maker> PartyID		String(20), Investment Decision Maker	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
452	PartyRole		Die folgenden Einträge sind zulässig 1 = “Executing Firm” 3 = „Client Identification Code“ 4 = “Clearing Firm” 7 = “Entering Firm” 10 = “SettlementLocation” 12 = “Execution within Firm” 11 = “Order Origination Trader” 16 = “Executing System” 17 = “Contra Firm” 21 = “Clearing Organization” 24 = “Customer Account” 27 = “Buyer Seller” 28 = “Custodian” 29 = “Intermediary” 30 = “Agent” 55 = “Session ID” 62 = “Report Originator” ~~63 = “Systematic Interaliser”~~ 66 = “Market Maker”; wird ignoriert 73 = “Execution Venue” 122 = „Investment Decision Maker“	
453	NoPartyIDs		Nur die Werte "1" bis "6" sind zulässig (eingehende Nachrichten) bzw. "1" bis "7" (ausgehende Nachrichten).	nicht systemspezifisch
487	TradeReportTransType		Nur d~~er~~ie Werte~~ 0~~, ~~1, 2 und 4 sind~~ ist in TradeCaptureReport und TradeCaptureReportAck zulässig. Nur der Wert 0 ist in TradeCaptureReportSno zulässig.	XONTROT7 GSE
523	PartySubID	A	String(6) letzte 6 Stellen der UserID für <session>	~~XONTROT7 GSE~~, MAX-ONE~~, INVESTRO~~
			~~String(35)~~ ~~Vestima-Safe-Account~~	~~INVESTRO/Vestima~~
			~~Subgroup + TraderID für <session>~~	~~Xetra, Xetra Ffm-2~~
			[N/A] für <executing system>	nicht systemspezifisch
526	SecondaryClOrdID		String(16)	nicht systemspezifisch
553	Username		siehe EnteringFirm (Tag 448)	nicht systemspezifisch
554	Password		~~auf die Länge 8 beschränkt~~ Wert muss mindestens eine Ziffer und ein Buchstabe enthalten. Keine Unterscheidung zwischen Groß- und Kleinbuchstaben. Sonderzeichen sind nicht zulässig.	nicht systemspezifisch
~~625~~	~~TradingSessionSubID~~		~~2 = "Opening auction only"~~ ~~3 = "Main trading"~~ ~~4 = "Closing auction only"~~ ~~6 = "Main auction"~~ ~~100 = "Auction only"~~ ~~101 = "End-of-day auction"~~ ~~102 = "Pending for next auction"~~ ~~103 = "Closing crossing"~~ ~~104 = "Accept surplus"~~ ~~105 = "Special auction"~~	~~Xetra, Xetra Ffm-2~~
625	TradingSessionSubID		~~2 = "Opening auction only" (EK - EK-Order)~~ 6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order)	~~XONTROT7 GSE~~
			6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order)	MAX-ONE
			~~Das Tag wird ignoriert~~	~~INVESTRO/Vestima~~
751	TradeReportRejectReason		Nur 99 = "Other" ist zulässig	~~XONTROT7 GSE~~

Tag	Feldname	E/A	Restriktionen/Werte	Handelssystem
768	NoTrdRegTimestamps		Nur der Wert 1 ist in TradeCaptureReport zulässig. Nur die Werte 1 und 2 sind in TradeCaptureReportSno zulässig.	nicht systemspezifisch
770	TrdRegTimestampType		Nur der Wert 1 ist in TradeCaptureReport zulässig. Nur die Werte 1 und 2 sind in TradeCaptureReportSno zulässig.	nicht systemspezifisch
802	NoPartySubIDs	A	Das Tag fehlt oder wird vom GW mit "1" belegt	nicht systemspezifisch
803	PartySubIDType	A	Das Tag wird bei PartyRole = 55 mit "4040" (User Identifier) belegt und bei PartyRole = 16 mit "3" (System)	nicht systemspezifisch
		A	~~Das Tag wird bei PartyRole = 28 mit "4080" (DECU-Safe-Account oder "4090" (RECU-Safe-Account) belegt und bei PartyRole = 30 mit "4060" (DEAG-Safe-Account) oder "4070" (REAG-Safe-Account) belegt und bei PartyRole = 27 mit "4050" (BUY/Sell--Safe-Account) belegt.~~	~~INVESTRO/Vestima~~
828	TrdType	A	OTC Post-trade indicator 9001 = ACTX (Agency cross transaction) 9002 = CANC (Cancellation) 9101 = ACTX CANC (Agency cross transaction and Cancellation)	~~XONTRO~~T7 GSE, MAX-ONE
829	TrdSubType		Siehe Kapitel 14 Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart)	~~XONTRO~~T7 GSE
923	UserRequestID		wird auf String(16) gekürzt	nicht systemspezifisch
924	UserRequestType		nur der Wert "3" ist zulässig	nicht systemspezifisch
925	NewPassword		auf die Länge 8 beschränkt	nicht systemspezifisch

14 Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart)

TrdSubType	Beschreibung
9011	Kauf - Schlussnote
9012	Kauf - Direktgeschäft
~~9013~~	~~Kauf - Aufgabe~~
~~9014~~	~~Kauf - Aufgabeschließung~~
~~9015~~	~~Kauf - Aufgabeweitergabe~~
~~9016~~	~~Kauf - Durchlieferung~~
~~9017~~	~~Kauf - INVESTRO~~
~~9019~~	~~Kauf - EUFO~~
9021	Verkauf - Schlussnote
9022	Verkauf - Direktgeschäft
~~9023~~	~~Verkauf - Aufgabe~~
~~9024~~	~~Verkauf - Aufgabeschließung~~
~~9025~~	~~Verkauf - Aufgabeweitergabe~~
~~9026~~	~~Verkauf - Durchlieferung~~
~~9027~~	~~Verkauf - INVESTRO~~
~~9029~~	~~Verkauf - EUFO~~
~~9511~~	~~Storno/Kauf - Schlussnote~~
~~9512~~	~~Storno/Kauf - Direktgeschäft~~
~~9513~~	~~Storno/Kauf - Aufgabe~~
~~9514~~	~~Storno/Kauf - Aufgabeschließung~~
~~9515~~	~~Storno/Kauf - Aufgabeweitergabe~~
~~9517~~	~~Storno/Kauf - INVESTRO~~
~~9519~~	~~Storno/Kauf - EUFO~~
~~9521~~	~~Storno/Verkauf - Schlussnote~~
~~9522~~	~~Storno/Verkauf - Direktgeschäft~~
~~9523~~	~~Storno/Verkauf - Aufgabe~~
~~9524~~	~~Storno/Verkauf - Aufgabeschließung~~
~~9525~~	~~Storno/Verkauf - Aufgabeweitergabe~~
~~9527~~	~~Storno/Verkauf - INVESTRO~~
~~9529~~	~~Storno/Verkauf - EUFO~~
9611	Tagesstorno/Kauf - Schlussnote
9612	Tagesstorno/Kauf - Direktgeschäft
~~9613~~	~~Tagesstorno/Kauf - Aufgabe~~
~~9614~~	~~Tagesstorno/Kauf - Aufgabeschließung~~
~~9617~~	~~Tagesstorno/Kauf - INVESTRO~~
9621	Tagesstorno/Verkauf - Schlussnote
9622	Tagesstorno/Verkauf - Direktgeschäft
~~9623~~	~~Tagesstorno/Verkauf - Aufgabe~~
~~9624~~	~~Tagesstorno/Verkauf - Aufgabeschließung~~

TrdSubType	Beschreibung
~~9627~~	~~Tagesstorno/Verkauf - INVESTRO~~
~~9913~~	~~Löschung/Kauf - Aufgabe~~
~~9915~~	~~Löschung/Kauf - Aufgabenweitergabe~~
~~9923~~	~~Löschung/Verkauf - Aufgabe~~
~~9925~~	~~Löschung/Verkauf - Aufgabenweitergabe~~