XONTRO®

Release 33

# Systemanschluss Makler

## Modification Announcement No. 1

Stand: 10.04.2016

Version 16.00

# Inhalt

1 Einleitung ... 3
2 Voraussetzungen für XONTRO SAM Release 33 ... 4
3 Zusammenfassung der fachlichen Änderungen und Erweiterungen ... 5
3.1 Erweiterte Requests ... 6
3.2 Erweiterte Broadcasts ... 15
3.3 Erweiterung der Bestandsinformationen ... 26
3.4 Beschreibung der neuen Felder ... 29
4 Technische Änderungen und Erweiterungen ... 32
5 Fachlicher und Technischer Support ... 33
5.1 BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH ... 33
5.2 Deutsche Börse AG ... 33

# 1 Einleitung

Das vorliegende Dokument informiert die Teilnehmer des XONTRO Systemanschluss Makler über die in XONTRO SAM Release 33 geplanten Neuerungen und Modifikationen.

Dabei werden die technischen und fachlichen Änderungen und Erweiterungen sowie die Modifikationen des VALUES API dargestellt.

In komprimierter Form soll damit dem SAM Teilnehmer die Möglichkeit gegeben werden, die Änderungen des Release zu beurteilen. Detailinformationen sind der „Release 33 XONTRO VALUES API Planning Version“ zu entnehmen, die ebenfalls im April 2017 veröffentlicht wird.

Das Dokument ist **das erste Modification Announcement zum Release 33.**

Am 05.10.2017 endet die Simulation des XONTRO SAM Release 32.

Der Einsatz des XONTRO SAM Release 33 im Simulationssystem erfolgt am 09.10.2017, der Connection Test sollte am gleichen Tag erfolgen.

Der Einsatz des XONTRO SAM Release 33 im Produktionssystem erfolgt voraussichtlich am **04.12.2017** und der **Connection Test** am Samstag, dem 02.12.2017. Der endgültige Termin wird zu einem späteren Zeitpunkt in den Release Notes bekannt gegeben.

**Wir weisen darauf hin, dass Release 33 für alle Teilnehmer ein Pflichtrelease ist. Die XONTRO Front End Software des Release 32 kann ab dem 05.10.2017 in Simulation nicht mehr genutzt werden. Die Teilnehmer müssen ab dem 09.10.2017 die Version 33 einsetzen. Sie können sich im Simulationsbetrieb durch Ihre Vendoren/Software Provider vertreten lassen.**

Das Dokument ist in die folgenden Abschnitte gegliedert:

- Voraussetzungen für XONTRO SAM Release 33
- Zusammenfassung der Änderungen und Erweiterungen
- Fachlicher und Technischer Support

# 2 Voraussetzungen für XONTRO SAM Release 33

XONTRO SAM Release 33 setzt die **Version GATE 3.5** für die Betriebssysteme **Windows Server 2008 R2, Windows 7, Solaris 10 und Oracle Solaris 11 (x86)** voraus. Die Anbindung an das XONTRO Back End erfolgt über das TCP/IP Protokoll.

XONTRO SAM Release 33 unterstützt folgende Betriebssystemversionen bzw. die folgende systemnahe Software, die zum Betrieb von XONTRO erforderlich ist:

Für eine MISS Installation:

- Solaris 10 mit Patch 118833-17 oder höher
  IBM WebSphere MQ (Server) Version 7.5 oder höher
- Oracle Solaris 11 (x86)
  IBM WebSphere MQ (Server) Version 7.5 oder höher
- Microsoft Windows Server 2008 R2 (64bit) in Englisch (US)
  IBM WebSphere MQ (Server) Version 7.5 oder höher

*Hinweis: Der IBM Support für WebSphere MQ 7.5 endet am 30.04.2018*

Für eine Workstation Installation:

- Solaris 10 mit Patch 118833-17 oder höher
- Oracle Solaris 11 (x86)
- Microsoft Windows 7 Professional (64bit) in Englisch (US)
- Microsoft Windows Server 2008 R2 (64bit) in Englisch (US)

Folgende Kombinationen von MISS und Workstation werden unterstützt:

| | | **Workstation** | | | | |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **MISS** | | Solaris 10 (x86) | Solaris 10 (SPARC) | Solaris 11 (x86) | Windows 7 (x64) | Windows 2008 (x64) |
| | Solaris 10 (x86) | possible | possible | possible | possible | possible |
| | Solaris 10 (SPARC) | possible | supported | possible | supported | possible |
| | Solaris 11 (x86) | possible | possible | supported | supported | possible |
| | Windows 2008 (x64) | possible | possible | possible | supported | supported |

# 3 Zusammenfassung der fachlichen Änderungen und Erweiterungen

Aufgrund der Anforderungen für MiFID II sind folgende fachlichen Änderungen und Erweiterungen im XONTRO SAM Release 33 enthalten:

- Neue Felder und Felderweiterungen bei Requests
  - XONTRO Enter Exchange Trade
  - XONTRO Enter Quote
  - XONTRO Enter Order SKM
  - XONTRO Enter Order FM
  - XONTRO Modify Order SKM
  - XONTRO Modify Order FM
  - XONTRO Delete Order SKM
  - XONTRO Delete Order FM
  - XONTRO Enter Broker Trade
  - XONTRO Enter Single Trade

- Neuer Request
  - ~~XONTRO Modify Broker Trade~~ *Notwendigkeit nach Abstimmung mit BAFIN zu „shortselling“ fraglich*

- Neue Felder und Felderweiterungen bei Broadcasts
  - BCBE_EXECUTION_SKM
  - BCBE_EXECUTION_SKM_TO_FM
  - BCBE_ENTER_PRICE
  - BCFE_ENTER_PRICE
  - BCBE_ENTER_PRICE_TAB
  - BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_TAB
  - BCFE_ENTER_PRICE_PLUS
  - BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE
  - BCFE_ENTER_QUOTE
  - BCFE_DEACTIVATE_QUOTE
  - BCBE_ENTER_QUOTE
  - BCBE_DEACTIVATE_QUOTE
  - BCBE_ENTER_BTRADE
  - BCBE_ENTER_BTRADE_2
  - BCFE_ENTER_BTRADE
  - BCFE_ENTER_BTRADE_2
  - ~~BCBE_MODIFY_BTRADE~~ *Notwendigkeit nach Abstimmung mit BAFIN zu „shortselling“ fraglich*
  - BCBE_BROKER_DIARY

- Neue Felder und Felderweiterungen bei Bestandstransfers
  - BCBE_BTRADE
  - BCBE_BTRADE_2
  - BCBE_DIARY

## 3.1 Erweiterte Requests

### 3.1.1 XONTRO Enter Exchange Trade

| | | |
| --- | --- | --- |
| Request ID **à** GATE | BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_RID | |
| Request Data | bc_request_headerT | inSeqNo m |
| | bc_request_header_moT | inSeqNoRef o |
| | bc_request_enter_exchange_tradeT | isinCod m<br>tradMtchPrc m<br>bkrNo m<br>tradMtchQty m<br>tradBegDat o<br>tradContTim m<br>**tradContTimFraction m**<br>tradContDat o<br>currExcRat o<br>acrIntDay o<br>acrIntDayCod o<br>bonusRat o<br>valueDatCod o<br>valueDat o<br>trdTypXontro o<br>**tvTic m**<br>otcPostTradInd o<br>**shortSellInd m**<br><br>ctpyNoAsk m<br>btradeNoAsk o<br>matchFlagAsk o<br>acctTypCodXontroAsk o<br>iwOrdCodAsk o<br>tradMtchPrcAsk o<br>feeFlagAsk o<br>feeAsk o<br>repExchangeIdAsk o<br>textTradAsk o<br>onBehalfCtpyNoAsk r |

| | | |
| --- | --- | --- |
| | | comCodAsk r |
| | | comAmtAsk r |
| | | comRateAsk r |
| | | chargesAsk r |
| | | ctpyNoBid m |
| | | btradeNoBid o |
| | | matchFlagBid o |
| | | acctTypCodXontroBid o |
| | | iwOrdCodBid o |
| | | tradMtchPrcBid o |
| | | feeFlagBid o |
| | | feeBid o |
| | | repExchangeIdBid o |
| | | textTradBid o |
| | | onBehalfCtpyNoBid r |
| | | comCodBid r |
| | | comAmtBid r |
| | | comRateBid r |
| | | chargesBid r |

### 3.1.2 XONTRO Enter Quote

| | | |
| --- | --- | --- |
| Request ID **à** GATE | BC_ENTER_QUOTE_RID | |
| Request Data | bc_request_headerT | inSeqNo m |
| | bc_request_ent_quoteT | isinCod m<br>ordrExePrcAsk m<br>ordrQtyAsk m<br>ordrExePrcBid m<br>ordrQtyBid m<br>confirmTim m |
| | *entfällt* | ~~requestTimFE~~ o<br>**quoteTimeStamp o** |

### 3.1.3 XONTRO Enter Order SKM

| | | |
| --- | --- | --- |
| Request ID **à** GATE | BC_ENTER_ORDER_SKM_RID | |
| Request Data | bc_request_headerT | inSeqNo m |
| | bc_request_ent_ord_skmT | acctTypCodXontro r<br>bkrNo o<br>buyCod m<br>ctpyNo m<br>isinCod m<br>isinCodSrs o<br>ordrExePrc o<br>ordrExpDat m<br>ordrQty m<br>ordrResCod o<br>ordrStopLim r<br>text o<br>trdResTypCod o<br>userOrdNum o<br>fwdOrdrCod o<br>netTypCodXontro r<br>ticket o |
| | *entfällt* | ~~regulatoryID o~~<br>**clientInd o**<br>**clientCod o**<br>**investmentInd o**<br>**investmentCod o**<br>**executionInd m**<br>**executionCod m**<br>**deaFlag o**<br>**tradCapacityCod o**<br>**optOutFlag o**<br>**liquidityProvFlag o** |

### 3.1.4 XONTRO Enter Order FM

| | | |
| --- | --- | --- |
| Request ID **à** GATE | BC_ENTER_ORDER_FM_RID | |
| Request Data | bc_request_headerT | inSeqNo m |
| | bc_request_ent_ordT | acctTypCodXontro r<br>bkrNo o<br>buyCod m<br>ctpyNo m<br>isinCod m<br>isinCodSrs o<br>ordrExePrc o<br>ordrExpDat m<br>ordrQty m<br>ordrResCod o<br>ordrStopLim r<br>text o<br>trdResTypCod o<br>userOrdNum o<br>fwdOrdrCod o<br>netTypCodXontro r |
| | *entfällt* | ~~regulatoryID o~~<br>**clientInd o**<br>**clientCod o**<br>**investmentInd o**<br>**investmentCod o**<br>**executionInd m**<br>**executionCod m**<br>**deaFlag o**<br>**tradCapacityCod o**<br>**optOutFlag o**<br>**liquidityProvFlag o** |

### 3.1.5 XONTRO Modify Order SKM

| | | |
| --- | --- | --- |
| Request ID **à** GATE | BC_MODIFY_ORDER_SKM_RID | |
| Request Data | bc_request_headerT | inSeqNo [m] |
| | bc_request_mod_ordT | isinCod [m]<br>ordrExePrc [o]<br>ordrExpDat [o]<br>ordrNo [m]<br>ordrQty [r]<br>ordrStopLim [r]<br>text [o]<br>ordrStatCod [o] |
| | *entfällt* | ~~regulatoryID [o]~~<br>**clientInd [o]**<br>**clientCod [o]**<br>**investmentInd [o]**<br>**investmentCod [o]**<br>**executionInd [m]**<br>**executionCod [m]**<br>**deaFlag [o]**<br>**optOutFlag [o]** |

### 3.1.6 XONTRO Modify Order FM

Der Request benutzt die Struktur **bc_request_mod_ordT** (siehe Kapitel 3.1.5).

### 3.1.7 XONTRO Delete Order SKM

| | | |
| --- | --- | --- |
| Request ID **à** GATE | BC_DELETE_ORDER_SKM_RID | |
| Request Data | bc_request_headerT | inSeqNo m |
| | bc_request_del_ord_skmT | isinCod m<br>ordrNo m<br>ticket o<br>ordrStatCod o |
| | *entfällt* | ~~regulatoryID o~~<br>**clientInd o**<br>**clientCod o**<br>**investmentInd o**<br>**investmentCod o**<br>**executionInd m**<br>**executionCod m**<br>**killFlag o** |

### 3.1.8 XONTRO Delete Order FM

| | | |
| --- | --- | --- |
| Request ID **à** GATE | BC_DELETE_ORDER_FM_RID | |
| Request Data | bc_request_headerT | inSeqNo m |
| | bc_request_del_ordT | isinCod m<br>ordrNo m |
| | *entfällt* | ~~regulatoryID o~~<br>**clientInd o**<br>**clientCod o**<br>**investmentInd o**<br>**investmentCod o**<br>**executionInd m**<br>**executionCod m**<br>**killFlag o** |

### 3.1.9 XONTRO Enter Broker Trade

| | | |
| --- | --- | --- |
| Request ID **à** GATE | BC_ENTER_BROKER_TRADE_RID | |
| Request Data | bc_request_headerT | inSeqNo m |
| | bc_request_ent_btradeT | bkrNo m<br>buyCod m<br>ctpyNo m<br>tradMtchPrc m<br>tradMtchQty m<br>currExcRat o<br>valueDatCod o<br>valueDat o<br>acrIntDay o<br>acrIntDayCod o<br>bonusRat o<br>acctTypCodXontro o<br>matchFlag o<br>iwOrdCod o<br>isinCod m<br>feeFlag o<br>fee o<br>textTrad o<br>tradBegDat o<br>tradContTim m<br>tradContDat r<br>trdTypXontro o<br>repExchangeId o<br>**shortSellInd m** |

### 3.1.10 XONTRO Enter Single Trade

| | | |
| --- | --- | --- |
| Request ID **à** GATE | BC_ENTER_SINGLE_TRADE_RID | |
| Request Data | bc_request_headerT | inSeqNo m |
| | bc_request_enter_single_tradeT | isinCod m<br>tradMtchPrc m<br>bkrNo m<br>tradMtchQty m<br>tradBegDat o<br>tradContTim m<br>tradContDat o<br>currExcRat o<br>acrIntDay o<br>acrIntDayCod o<br>bonusRat o<br>valueDatCod o<br>valueDat o<br>trdTypXontro o<br>settlementFlag o<br>**shortSellInd m**<br><br>ctpyNoAsk m<br>btradeNoAsk o<br>matchFlagAsk o<br>acctTypCodXontroAsk o<br>iwOrdCodAsk o<br>tradMtchPrcAsk o<br>feeFlagAsk o<br>feeAsk o<br>tranFeeFlagAsk o<br>tranFeeAsk o<br>repExchangeIdAsk o<br>textTradAsk o<br>ctpyNoBid m<br>btradeNoBid o<br>matchFlagBid o<br>acctTypCodXontroBid o<br>iwOrdCodBid o<br>tradMtchPrcBid o<br>feeFlagBid o<br>feeBid o |

tranFeeFlagBid o
tranFeeBid o
repExchangeIdBid o
textTradBid o

## 3.2 Erweiterte Broadcasts

Die Struktur des Headers **bc_broadcast_headerT** bleibt unverändert und ist in den nachfolgenden Broadcasts nicht angegeben.

### 3.2.1 BCBE_EXECUTION _SKM

| | |
| --- | --- |
| bc_brd_exec_confT | execConfType<br>ordrNo<br>userOrdNum<br>tradMtchCod<br>tradMtchPrc<br>tradMtchPrcNo<br>tradMtchQty<br>tradMtchPrcTim<br>**tradMtchPrcTimFraction**<br>tradMtchPrcDat<br>trdResTypCod<br>userNo<br>**tvTic**<br>**algoFlag** |

### 3.2.2 BCBE_EXECUTION _SKM_TO_FM

Der Broadcast benutzt die Struktur **bc_brd_exec_confT** (siehe Kapitel 3.2.1).

### 3.2.3 BCBE_ENTER_PRICE

| | |
| --- | --- |
| bc_brd_ent_priceT | tradMtchCod<br>tradMtchPrc<br>tradMtchPrcNo<br>trdResTypCod<br>lockTim<br>confirmTim<br>ordrBkExeQty<br>postProcFlag<br>tradMtchPrcTim<br>**tradMtchPrcTimFraction**<br>tradMtchPrcDat<br>**venueMic** |

### 3.2.4 BCFE_ENTER_PRICE

Der Broadcast benutzt die Struktur **bc_brd_ent_priceT** (siehe Kapitel 3.2.3).

### 3.2.5 BCBE_ENTER_PRICE_TAB

Der Broadcast benutzt die Struktur **bc_brd_ent_priceT** (siehe Kapitel 3.2.3).

### 3.2.6 BCBE_ENTER_PRICE_MODIFICATION_TAB

Der Broadcast benutzt die Struktur **bc_brd_ent_priceT** (siehe Kapitel 3.2.3).

### 3.2.7 BCFE_ENTER_PRICE_PLUS

| | |
| --- | --- |
| bc_brd_ent_price_plusT | userNo |
| | ticket |
| | lockTim |
| | confirmTim |
| | trdResTypCod |
| | tradMtchCod |
| | tradMtchPrc |
| | tradMtchPrcNo |
| | tradMtchPrcTim |
| | **tradMtchPrcTimFraction** |
| | tradMtchPrcDat |
| | ordrBkExeQty |
| | postProcFlag |
| | ctpyNoBid |
| | ctpyNoAsk |
| | tradMtchQty |
| | feeFlag |
| | fee |
| | tranFeeFlag |
| | tranFee |
| | currExcRat |
| | inSeqNoRef |
| | **venueMic** |

### 3.2.8 BCFE_ENTER_BLOCK_PRICE

| | |
| --- | --- |
| bc_brd_confirm_tim_bypassT | confirmTimBypass |
| bc_counterT | counter |
| | |
| *bis zu 30 Einträge* | |
| bc_brd_ent_block_priceT | isinCod* |
| | tradMtchCod* |
| | tradMtchPrc* |
| | tradMtchPrcNo* |
| | trdResTypCod* |
| | lockTim* |
| | tradMtchPrcTim* |
| | **tradMtchPrcTimFraction*** |
| | tradMtchPrcDat* |
| | **venueMic*** |

### 3.2.9 BCFE_ENTER_QUOTE

| | |
| --- | --- |
| bc_brd_ent_quote_feT | ordrExePrcAsk<br>ordrQtyAsk<br>ordrExePrcBid<br>ordrQtyBid<br>inSeqNo |
| *entfällt* | ~~requestTimFE~~<br>**quoteTimeStamp** |

### 3.2.10 BCFE_DEACTIVATE_QUOTE

| | |
| --- | --- |
| bc_brd_deact_quote_feT | inSeqNo |
| *entfällt* | ~~requestTimFE~~<br>**quoteTimeStamp** |

### 3.2.11 BCBE_ENTER_QUOTE

| | |
| --- | --- |
| bc_brd_ent_quoteT | quoteType<br>quoteStatus<br>ordrExePrcAsk<br>ordrQtyAsk<br>ordrVolAsk<br>ordrExePrcBid<br>ordrQtyBid<br>ordrVolBid<br>confirmTim<br>**quoteTimeStamp** |

### 3.2.12 BCBE_DEACTIVATE_QUOTE

| | |
| --- | --- |
| bc_brd_deact_quoteT | confirmTim<br>**quoteTimeStamp** |

### 3.2.13 BCBE_ENTER_BTRADE

| | |
| --- | --- |
| bc_brd_ent_btradeT | btradeNo<br>bkrNo<br>bkrSubNo<br>exchangeId |

buyCod
ctpyNo
ctpySubNo
ctpyExchangeId
**ctpyLei**
tranExchangeId
btradeCod
tradMtchPrc
tradMtchQty
ordrQty
clearingCurrTypCod
currExcRat
valueDatCod
valueDat
acrIntDay
acrIntDayCod
bonusRat
tradMtchPrcNo
acctTypCodXontro
iwOrdCod
isinCod
isinCodSrs
tradBegDat
tradContTim
**tradContTimFraction**
tradContDat
repExchangeId
trdTypXontro
**tvTic**
**venueMic**
**shortSellInd**
**otcPostTradInd**

### 3.2.14 BCBE_ENTER_BTRADE_2

bc_brd_ent_btrade_2T

btradeNo
bkrNo
bkrSubNo
exchangeId
buyCod
ctpyNo
ctpySubNo
ctpyExchangeId
**ctpyLei**
tranExchangeId
btradeCod
tradMtchPrc
tradMtchQty
ordrQty
clearingCurrTypCod
currExcRat
valueDatCod
valueDat
acrIntDay
acrIntDayCod
bonusRat
tradMtchPrcNo
acctTypCodXontro
iwOrdCod
isinCod
isinCodSrs
tradBegDat
tradContTim
**tradContTimFraction**
tradContDat
repExchangeId
feeFlag
fee
textTrad
ctpyTradMtchPrc
trdTypXontro
**tvTic**
**venueMic**
**shortSellInd**
**otcPostTradInd**

### 3.2.15 BCFE_ENTER_BTRADE

| | |
|---|---|
| bc_brd_ent_btrade_feT | btradeNo<br>bkrNo<br>bkrSubNo<br>exchangeId<br>buyCod<br>ctpyNo<br>ctpySubNo<br>ctpyExchangeId<br>**ctpyLei**<br>tranExchangeId<br>btradeCod<br>tradMtchPrc<br>tradMtchQty<br>ordrQty<br>clearingCurrTypCod<br>currExcRat<br>valueDatCod<br>valueDat<br>acrIntDay<br>acrIntDayCod<br>bonusRat<br>tradMtchPrcNo<br>acctTypCodXontro<br>iwOrdCod<br>isinCod<br>isinCodSrs<br>tradBegDat<br>tradContTim<br>**tradContTimFraction**<br>tradContDat<br>repExchangeId<br>inSeqNoRef<br>trdTypXontro<br>**tvTic**<br>**venueMic**<br>**shortSellInd**<br>**otcPostTradInd** |

### 3.2.16 BCFE_ENTER_BTRADE_2

bc_brd_ent_btrade_fe_2T

btradeNo
bkrNo
bkrSubNo
exchangeId
buyCod
ctpyNo
ctpySubNo
ctpyExchangeId
**ctpyLei**
tranExchangeId
btradeCod
tradMtchPrc
tradMtchQty
ordrQty
clearingCurrTypCod
currExcRat
valueDatCod
valueDat
acrIntDay
acrIntDayCod
bonusRat
tradMtchPrcNo
acctTypCodXontro
iwOrdCod
isinCod
isinCodSrs
tradBegDat
tradContTim
**tradContTimFraction**
tradContDat
repExchangeId
feeFlag
fee
textTrad
inSeqNoRef
ctpyTradMtchPrc
trdTypXontro
**tvTic**
**venueMic**
**shortSellInd**
**otcPostTradInd**

### 3.2.17 BCBE_BROKER_DIARY

| | |
|---|---|
| bc_diaryT | acctTypCodXontroAsk |
| | acctTypCodXontroBid |
| | acrIntDay |
| | acrIntDayCod |
| | bkrDiaryNo |
| | bkrSubNo |
| | bkrUserNo |
| | bonusDifAmtAsk |
| | bonusDifAmtBid |
| | bonusRat |
| | bonusRatAsk |
| | bonusRatBid |
| | btradeCodAsk |
| | btradeCodBid |
| | btradeEnfCod |
| | btradeTextAsk |
| | btradeTextBid |
| | busDat |
| | clearingCurrTypCod |
| | ctpyNoAsk |
| | **ctpyLeiAsk** |
| | ctpyNoBid |
| | **ctpyLeiBid** |
| | currExcRat |
| | currExcRatAsk |
| | currExcRatBid |
| | eccpCod |
| | exchangeIdAsk |
| | exchangeIdBid |
| | feeAsk |
| | feeBid |
| | feeFlagAsk |
| | feeFlagBid |
| | tranFeeAsk |
| | tranFeeBid |
| | tranFeeFlagAsk |
| | tranFeeFlagBid |
| | humNo |
| | isinCod |
| | iwOrdCodAsk |
| | iwOrdCodBid |
| | textTradAsk |

| | | |
|---|---|---|
| | | textTradBid |
| | | tradBegDat |
| | | tradClCod |
| | | tradClearingPrc |
| | | tradDifAmtAsk |
| | | tradDifAmtBid |
| | | tradMtchPrc |
| | | tradMtchPrcAsk |
| | | tradMtchPrcBid |
| *Datum ist enthalten in* | *tranContDatAsk / tranContDatBid* | ~~tradMtchPrcDat~~ |
| *Nummer enthalten in* | *tradMtchPrcNoAsk / tradMtchPrcNoBid* | ~~tradMtchPrcNo~~ |
| *Zeit ist enthalten in* | *tranContTimAsk / tranContTimBid* | ~~tradMtchPrcTim~~ |
| | | **tradMtchPrcNoAsk** |
| | | **tradMtchPrcNoBid** |
| | | tradMtchPrcType |
| | | tradMtchQty |
| | | tradNo |
| | | tradNoAsk |
| | | tradNoBid |
| | | tradNoOld |
| | | tradTim |
| | | tranContDatAsk |
| | | tranContDatBid |
| | | tranContTimAsk |
| | | **tranContTimFractionAsk** |
| | | tranContTimBid |
| | | **tranContTimFractionBid** |
| | | tranExchangeId |
| | | trdTypXontroAsk |
| | | trdTypXontroBid |
| | | userNo |
| | | valueDat |
| | | valueDatCod |
| | | xontroOdrCodAsk |
| | | xontroOdrCodBid |
| | | repExchangeIdAsk |
| | | repExchangeIdBid |
| | | customerIdClassAsk |
| | | customerIdClassBid |
| | | customerIdAsk |
| | | customerIdBid |
| | | commissionAgentFlagAsk |
| | | commissionAgentFlagBid |
| | | settlementFlag |

**tvTicAsk**
**tvTicBid**
**venueMic**
**shortSellInd**
**otcPostTradIndAsk**
**otcPostTradIndBid**

## 3.3 Erweiterung der Bestandsinformationen

### 3.3.1 Bestand BCBE_BTRADE

| **mehrfach** | |
| --- | --- |
| bc_subTypeT | subType* |
| | |
| bc_btradeT | btradeNo* |
| | bkrNo* |
| | bkrSubNo* |
| | exchangeId* |
| | buyCod* |
| | ctpyNo* |
| | ctpySubNo* |
| | ctpyExchangeId* |
| | **ctpyLei*** |
| | tranExchangeId* |
| | btradeCod* |
| | tradMtchPrc* |
| | tradMtchQty* |
| | ordrQty* |
| | clearingCurrTypCod* |
| | currExcRat* |
| | valueDatCod* |
| | valueDat* |
| | acrIntDay* |
| | acrIntDayCod* |
| | bonusRat* |
| | tradMtchPrcNo* |
| | acctTypCodXontro * |
| | iwOrdCod* |
| | isinCod* |
| | isinCodSrs* |
| | tradBegDat* |
| | tradContTim* |
| | **tradContTimFraction*** |
| | tradContDat* |
| | repExchangeId* |
| | trdTypXontro* |
| | **tvTic*** |
| | **venueMic*** |
| | **shortSellInd*** |
| | **otcPostTradInd*** |

### 3.3.2 Bestand BCBE_BTRADE_2

| | |
|---|---|
| **mehrfach** | |
| bc_subTypeT | subType* |
| | |
| bc_btrade_2T | btradeNo* |
| | bkrNo* |
| | bkrSubNo* |
| | exchangeId* |
| | buyCod* |
| | ctpyNo* |
| | ctpySubNo* |
| | ctpyExchangeId* |
| | **ctpyLei*** |
| | tranExchangeId* |
| | btradeCod* |
| | tradMtchPrc* |
| | tradMtchQty* |
| | ordrQty* |
| | clearingCurrTypCod* |
| | currExcRat* |
| | valueDatCod* |
| | valueDat* |
| | acrIntDay* |
| | acrIntDayCod* |
| | bonusRat* |
| | tradMtchPrcNo* |
| | acctTypCodXontro * |
| | iwOrdCod* |
| | isinCod* |
| | isinCodSrs* |
| | tradBegDat* |
| | tradContTim* |
| | **tradContTimFraction*** |
| | tradContDat* |
| | repExchangeId* |
| | feeFlag* |
| | fee* |
| | textTrad* |
| | ctpyTradMtchPrc* |
| | trdTypXontro* |
| | **tvTic*** |
| | **venueMic*** |
| | **shortSellInd*** |
| | **otcPostTradInd*** |

### 3.3.3 Bestand BCBE_DIARY

Der Bestand benutzt die Struktur **bc_diaryT** (siehe Kapitel 3.2.17)

## 3.4 Beschreibung der neuen Felder

| Feldname | Definition | Bemerkung |
| --- | --- | --- |
| algoFlag | char[1] | Erläuterung:<br>Kennzeichen „Algorithmic Order“<br>**Feldinhalt:**<br>'blank' = keine Algo-Order<br>J = Algo-Order |
| clientCod | char[20] | Erläuterung:<br>Client Identification Code (MiFID II) |
| clientInd | char[1] | Erläuterung:<br>Indikator für den Inhalt des Feldes „clientCod“<br>**Feldinhalt:**<br>'blank' = keine Angabe<br>1 = Shortcode<br>4 = User-Shortcode (User-Identifikation in Xontro)<br>A = AGGR<br>P = PNAL |
| ctpyLei | char[20] | Erläuterung:<br>LEI (Legal Entity Identifier) des Börsenteilnehmers, der als Kontrahent bei Aufgaben/halben Geschäften/Geschäften benannt wird. |
| ctpyLeiAsk | char[20] | Erläuterung:<br>LEI des Kontrahenten auf der Verkaufseite |
| ctpyLeiBid | char[20] | Erläuterung:<br>LEI des Kontrahenten auf der Kaufseite |
| deaFlag | char[1] | Erläuterung:<br>Kennzeichen für die Übermittlung als „Direct Electronic Access” (MiFID II)<br>**Feldinhalt:**<br>'blank' = kein DEA<br>J = DEA |
| executionCod | char[20] | Erläuterung:<br>Execution Within Firm (MiFID II) |
| executionInd | char[1] | Erläuterung:<br>Indikator für den Inhalt des Feldes “executionCod”<br>**Feldinhalt:**<br>1 = Shortcode<br>2 = Algo<br>3 = CLIENT<br>4 = User-Shortcode (User-Identifikation in Xontro) |
| investmentCod | char[20] | Erläuterung:<br>Investment Decision Within Firm (MiFID II) |
| investmentInd | char[1] | Erläuterung:<br>Indikator für den Inhalt des Feldes „investmentCod“<br>**Feldinhalt:**<br>'blank' = keine Angabe<br>1 = Shortcode<br>2 = Algo<br>4 = User-Shortcode (User-Identifikation in Xontro) |
| killFlag | char[1] | Erläuterung:<br>Kennzeichnung einer Orderlöschung durch „Kill“-Funktionalität. Eine so gekennzeichnete Löschung wird bei Auswertungen für RTS 9 (MiFID II) nicht gezählt.<br>**Feldinhalt:**<br>'blank' = normale Löschung<br>J = Löschung durch „Kill“-Funktionalität |

| Feldname | Definition | Bemerkung |
| --- | --- | --- |
| liquidityProvFlag | char[1] | Erläuterung:<br>Kennzeichnung einer Order mit der Liquidität bereitgestellt wird (MiFID II)<br>**Feldinhalt:**<br>'blank' = keine Bereitstellung von Liquidität<br>J = Bereitstellung von Liquidität |
| optOutFlag | char[1] | Erläuterung:<br>Kennzeichen für die Prüfung auf den maximal zulässigen Kurswert des jeweiligen Börsenplatzes<br>**Feldinhalt:**<br>'blank' = Kurswertprüfung (default)<br>N = keine Kurswertprüfung |
| otcPostTradInd | char[3] | Erläuterung:<br>Kennzeichen „OTC-post-trade Indicator“ (MiFID II)<br>**Feldinhalt:**<br>'blank' = keine Angabe<br>001 = ACTX (Kompensation)<br>002 = CANC (Storno)<br>101 = ACTX CANC (Kompensation und Storno) |
| otcPostTradIndAsk | char[3] | Erläuterung:<br>Kennzeichen „OTC post-trade Indicator” (MiFID II) auf der Verkaufseite |
| otcPostTradIndBid | char[3] | Erläuterung:<br>Kennzeichen „OTC post-trade Indicator” (MiFID II) auf der Kaufseite |
| quoteTimeStamp | num[12]<br>[HHMMSSCCnnnn] | Erläuterung:<br>Zeitstempel der Einstellung bzw. Löschung einer Quote |
| shortSellInd | num[1] | Erläuterung:<br>Indikator für die Kennzeichnung von „Short Selling” (MiFID II)<br>**Feldinhalt:**<br>0 = no short sell<br>1 = info not available<br>2 = short sell with Exemption<br>3 = short sell without Exemption<br>~~9 = undecided (vorläufige Aufgaben aus der Xontro Kursfeststellung)~~<br>*Notwendigkeit nach Abstimmungen mit BAFIN fraglich* |
| tradCapacityCod | char[1] | Erläuterung:<br>Kennzeichen „Trading Capacity“ (MiFID II)<br>**Feldinhalt:**<br>A, 'blank' = AOTC (default)<br>D = DEAL<br>M = MTCH |
| tradContTimFraction | num[4] | Erläuterung:<br>Mikrosekunden zur Abschlusszeit einer Aufgabe/eines Geschäfts (Ergänzung zu tradContTim) |
| tradMtchPrcNoAsk | num[5] | Erläuterung:<br>Nummer der Kursfeststellung auf der Verkaufseite |
| tradMtchPrcNoBid | num[5] | Erläuterung:<br>Nummer der Kursfeststellung auf der Kaufseite |
| tradMtchPrcTimFraction | num[4] | Erläuterung:<br>Mikrosekunden zum Zeitpunkt der Kursfeststellung (Ergänzung zu tradMtchPrcTim) |
| tranContTimFractionAsk | num[4] | Erläuterung:<br>Mikrosekunden zur Abschlusszeit auf der Verkaufsseite |

| Feldname | Definition | Bemerkung |
|---|---|---|
| | | (Ergänzung zu tranContTimAsk) |
| tranContTimFractionBid | num[4] | Erläuterung:<br>Mikrosekunden zur Abschlusszeit auf der Kaufseite<br>(Ergänzung zu tranContTimBid) |
| tvTic | char[52] | Erläuterung:<br>Trading Venue Transaction Identification Code (MiFID II)<br>Der Schlüsselwert wird für jede Kursfeststellung eindeutig vergeben |
| tvTicAsk | char[52] | Erläuterung:<br>Trading Venue Transaction Identification Code (MiFID II) auf der Verkaufseite |
| tvTicBid | char[52] | Erläuterung:<br>Trading Venue Transaction Identification Code (MiFID II) auf der Kaufseite |
| venueMic | char[4] | Erläuterung:<br>MIC (Market Identifier Code) des Handelsplatzes bzw. des Handelssegmentes |

# 4 Technische Änderungen und Erweiterungen

Das XONTRO SAM Release 33 enthält folgende technischen Änderungen oder Erweiterungen:

- Oracle Solaris 11 (x86)

  Das Betriebssystem Oracle Solaris 11 (x86) wird ab R33 unterstützt.

  Eine R33 Installation auf einem SPARC-Rechner mit Oracle Solaris 11 wird nicht unterstützt.

  Bestehende SPARC-Rechner können weiterhin mit Solaris 10 genutzt werden.

# 5 Fachlicher und Technischer Support

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

## 5.1 BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH

| | |
|---|---|
| Aufgaben: | Beratung und Support der Teilnehmer in allen **fachlichen** Fragestellungen.<br>First Level Support bei technischen Fragestellungen zu den MISSen und zum Back End Betrieb.<br>Fachliche Betreuung der Neuanmeldungen, der Connection Tests, der Simulationen und des Produktionsbetriebes.<br>Bereitstellung von Dokumentationen.<br>Durchführung von Schulungen. |
| Telefon: | ++49 (69) – 58 99 78 – 170 |
| Mail: | sam@xontro.de |
| Internet: | www.xontro.de **->** Finanzdienstleister **->** Systemanschluss - SAM |
| Erreichbarkeit: | 07.30 bis 20.40 Uhr (börsentäglich) |

## 5.2 Deutsche Börse AG

| | |
|---|---|
| Aufgaben: | Technische Betreuung bei Fragen des Netzwerkes. |
| Telefon: | ++49 (69) – 211 – 11281 |
| Mail: | tmr-zos@deutsche-boerse.com |
| Erreichbarkeit: | 06.00 bis 22.00 Uhr (börsentäglich) |