

Funktionsbeschreibung



Bereitstellung von Funktionalitäten zur Order-Erfassung, -Änderung und -Löschung.

Menü Ordererfassung und Orderbearbeitung

```
TRAN: BREB FC:      SB:
XONTRO / ORDERERFASSUNG U. ORDERBEARBEITUNG          1123/99 TEST BANK

EE ORDER-EINZELERFASSUNG
EG ORDER-SAMMELERFASSUNG (PRO GATTUNG) EMPFAENGER ==> ....

OB ORDER-BEARBEITUNG          BI-ORDERNR. ==> .....
                              ODER DWZ-ORDERNR. ==> .....

OL ORDERBLOCK-LOESCHUNG      GATTUNG ==> .....
                              GESCHAFTSART ==> .
                              LIMIT ==> .....

-- ID-KZ: 1123192799 -- PW:          ----- B7999ADB -- 08/02/18 -- 15:34:39 --
BC0140I BITTE FUNKTIONSCODE AUSWAEHLLEN
```

Hinweise zum Aufruf und zur Anzeige



Keine

Suchbegriffe



keine

Eingaben



FC

Eingabe des Funktionscodes

EMPFAENGER

Kassenvereinsnummer des Orderempfängers. In der Funktion BREB EG kann abweichend von dem systemseitig vorgegebenen skontroführenden Makler ein Freimakler als Empfänger der Orders voreingestellt werden.

BI-ORDERNR

Eingabe der bankinternen Ordernummer zur gezielten Orderselektion.

DWZ- ORDERNR.

Eingabe der DWZ-Ordernummer zur gezielten Orderselektion.

GATTUNG

Betroffene Gattung der Orderblocklöschung (Mussfeld).

GESCHAEFTS- ART

Kauf oder Verkauf
Die Eingabe ist nur relevant für die Orderblocklöschung.

LIMIT

Limit oder billigst/bestens.
Die Eingabe ist nur relevant für die Orderblocklöschung.

Prüfungen



keine

Verarbeitung



ENTER

Aufruf der gewählten Funktion

F3 / F4 / F6

Rücksprung in das Basismenü

Ausgabe



keine

Funktionsbeschreibung



Erfassung einer Einzelorder.

Einzelordererfassung

```
TRAN: BREB FC: EE SB:
XONTRO / EINZELERFASSUNG                                4001/99 DEUTSCHE BAN
GESCHAFTSART: .
EIGENGESCH. : A (A/P)          KUNDENGESCHAFT
STCK/NOM    : .....
GATTUNG     : .....
LIMIT      : .....
ZUSATZ     : ...
GUELTIGKEIT : .....
HHW        : ..
BI-ORDERNR. : .....
EMPFAENGER  : ....
TEXT        : .....
AB FOLGETAG : N (J/N)
CLIENT-ID   : ..... USER/SHCO/PNAL/AGGR
EXECUTION-ID : ..... USER/SHCO/VWHD
INVESTMENT-ID : ..... USER/SHCO

-- ID-KZ: 4001199999 -- PW:          ----- B9998162 -- 02/10/17 -- 16:18:34 --

BC0080I BITTE DATEN EINGEBEN
```

Hinweise zum Aufruf und zur Anzeige



Die XONTRO-Ordereingabemaske „BREB EE“ wird um die Datenfelder Client-ID, Execution-ID und Investment-ID erweitert. Hinsichtlich der Feldbelegungen durch die Teilnehmer sind die Anforderungen und Regelwerke der ESMA bezüglich der MiFID II Umsetzung zu beachten.

Pro neuem Datenfeld gibt es einen 4-stelligen Definitionsteil (z.B. USER, PNAL, ...) ggfs. gefolgt von einem bis zu 18-stelligen Datenteil.

Suchbegriffe



keine

Eingaben



GESCHAEFTSART Kauf oder Verkauf

EIGENGESCH. Kennzeichnung des Auftrags als Kundengeschäft („A“ für agent) bzw. Eigengeschäft („P“ für proprietary) der Bank.

Wird kein Kennzeichen gesetzt, wird der Auftrag automatisch als Kundengeschäft gekennzeichnet.

STCK/NOM Stückzahl bzw. Nominale

GATTUNG Wertpapierkennnummer, Börsenkürzel oder die 12-stellige ISIN.

LIMIT Das Limit kann in der Verarbeitungssteuerung als Mussfeld definiert werden. Ist dies nicht der Fall, wird bei Nichteingabe in das Feld billigst / bestens eingestellt.

ZUSATZ Limitzusatz 'SB' stop-buy (Kauf) oder 'SL' stop-loss (Verkauf)

GUELTIGKEIT Erfolgt kein Eintrag, so ist die Order ultimogültig.

HHW Die Order kann zum ersten Kurs (EK) oder zum Kassakurs (KS) aufgegeben werden.
Wird keine Eingabe gemacht, wird die Order in Abhängigkeit von der (Höhe der) Nominalen als Kassaorder oder als variable Order eingestellt.

BI-ORDERNUMMER Bankinterne Ordernummer
In der Verarbeitungssteuerung (BUXK BV) kann die Eindeutigkeit und das Eingabeverhalten (Kannfeld, Mussfeld) definiert werden.

EMPFAENGER Empfänger der Order kann ein Freimakler oder der skontroführende Makler dieser Gattung sein.
Erfolgt bei Aufruf der Funktion keine Belegung durch eine Freimakler-KV, wird vom System automatisch die Kassenvereinsnummer des skontroführenden Maklers eingestellt.

TEXT Hier kann ein beliebiger Text erfasst werden.

AB FOLGETAG Vorbelegung ist 'N', d.h. dass die Order sofort gültig ist.
'J' bedeutet, dass die Order erst am Folgetag gültig wird.

CLIENT-ID	Mögliche Feldinhalte:	optional
(client identification code)	„USER“ + 10-stellige XONTRO User-ID (mit hinterlegter gültiger Legitimation im Berechtigungsdialog BRMI LM) „SHCO“ + max. 18-stelligem Shortcode (nur für Teilnehmer mit anschließender Shortcode Übermittlung) ESMA-Variable „PNAL“ (Zuweisung noch ausstehend) (Wenn ein Teilnehmer oder Kunde des Handelsplatzes berechtigt ist, einen Auftrag nach Eingang beim Handelsplatz einem Kunden zuzuweisen, dies aber zum Zeitpunkt des Eingangs noch nicht getan hat, ist der Client-ID mit „PNAL“ zu kennzeichnen) ESMA-Variable „AGGR“ (Sammelauftrag) (Wenn mehrere Aufträge als Sammelauftrag beim Handelsplatz eingereicht werden, ist der Client-ID mit „AGGR“ zu kennzeichnen)	
EXECUTION-ID	Mögliche Feldinhalte:	verpflichtend
(execution within firm)	„USER“ + 10-stellige XONTRO User-ID (mit hinterlegter gültiger Legitimation im Berechtigungsdialog BRMI LM) „SHCO“ + max. 18-stelligem Shortcode (nur für Teilnehmer mit anschließender Shortcode Übermittlung) „VWHD“ + 10-stellige XONTRO User-ID (Vorbelegung mit hinterlegter XONTRO-User-ID des verantwortlichen Händlers)	
INVESTMENT-ID	Mögliche Feldinhalte:	optional
(investment decision within firm)	„USER“ + 10-stellige XONTRO User-ID (mit hinterlegter gültiger Legitimation im Berechtigungsdialog BRMI LM) „SHCO“ + max. 18-stelligem Shortcode (nur für Teilnehmer mit anschließender Shortcode Übermittlung)	

Anzeige nach Bestätigung der Eingaben mit Datenfreigabe

```
TRAN: BREB FC: EE SB:
XONTRO / EINZELERFASSUNG                                4001/99 DEUTSCHE BAN
GESCHAEFTSART: K                                KAUF                                STUECK-NOT
EIGENGESCH. : A (A/P)                            KUNDENGESCHAEFT
STCK/NOM    : 100,000
GATTUNG     : BAS                                BASF SE NA O.N.
LIMIT      : BILLIGST
ZUSATZ     : ...
GUELTIGKEIT : 31.12.17
HHW        : ..                                VAR. KURS
BI-ORDERNR. : 4711
EMPFAENGER  : 4270
TEXT        : .....
AB FOLGETAG : N (J/N)
CLIENT-ID   : PNAL ..... USER/SHCO/PNAL/AGGR
EXECUTION-ID : USER 4001199999 USER/SHCO/VWHD
INVESTMENT-ID : SHCO 1001 USER/SHCO
                                           FREIGABE (K/V) : k
-- ID-KZ: 4001199999 -- PW:          ----- B9998162 -- 02/10/17 -- 17:31:12 --
BC0120I BITTE ORDEREINSTELLUNG MIT PF3 FREIGEBEN
```

Eingaben



FREIGABE (K/V)

Nach der wiederholten Eingabe der Geschäftsart (**K**auf oder **V**erkauf) wird die Order vom System übernommen.

Prüfungen



LIMIT

Das Limit oder die Kurswertgrenze wird mit den Einstellungen der maximalen Abweichung zum vorausgegangenen Kurs (BUXK BV Seite 1) verglichen. Überschreitet eine Limiteingabe diese Vorgaben, ist eine zusätzliche Ratifizierung per Datenfreigabe erforderlich.

GUELTIGKEIT und HHW

Die maximale Ordergültigkeit beträgt 360 Kalendertage.
Die Orderaufgabe zum ersten Kurs ist nur tagesgültig möglich.



Verarbeitungsschritt 1

ENTER

Prüfung und Aufbereitung (Langanzeige) der Eingaben.

Zusätzlich eingeblendet wird die Geschäftsart im Langtext (z. B. KAUF), Gegenwert und letzter Kurs der Gattung (Gegenwert = Kurs x Stückzahl bzw. Nominale), Langtext der Gattung und das Feld Freigabe.

F3 im ersten Verarbeitungsschritt bewirkt einen Abbruch der Verarbeitung; eingegebene Orderdaten bleiben nicht erhalten.

Verarbeitungsschritt 2

F3

Verarbeitung der Order:

Bevor die Order verarbeitet werden kann muss das Freigabekennzeichen (= Geschäftsart) im Feld FREIGABE eingegeben werden.

- Einstellung der Order in den Orderbestand. Die Order erhält eine eindeutige DWZ-Ordernummer, welche in der Hinweiszeile oder per Terminaldruck ausgegeben wird.
- Ist das Orderbuch der Gattung während der Ordereingabe gesperrt, werden die Orders in den so genannten „Vorhaltebestand“ eingestellt. Eine entsprechende Meldung erfolgt in der Hinweiszeile.

**Sperre
Orderbuch**

Nach Aufhebung der Orderbuchsperre (Kursfeststellung oder manuelles Entsperrern durch den Makler) werden diese Orders entweder in den Orderbestand eingestellt, oder die Einstellung wird abgelehnt, weil der Kurs (z.B. Kassakurs), zu dem die Order aufgegeben wurde, bereits festgestellt und die Order tagesgültig aufgegeben wurde.

- Orders mit dem manuell eingegebenen Kennzeichen gültig ab Folgetag werden für den nächsten Börsentag vorgetragen.

**Gültig ab
Folgetag
(manuelle
Eingabe)**

Für diese Orders werden *keine* Nebenrechtsverarbeitungen durchgeführt, die Orders sind entsprechend manuell anzupassen. Ausnahmen: Kursaussetzungen (Orderlöschung) und ISIN-Änderungen werden durchgeführt.

F3 Fortsetzung	<p>Gültigkeit ab Folgetag wird vom System automatisch eingestellt, wenn die Ordergültigkeit länger als tagesgültig ist und</p> <ul style="list-style-type: none">- die Ordereingabe zum Kassakurs, jedoch nach der Kassakursfeststellung erfolgt, oder- eine variable Order nach Schlusskursfeststellung erfasst wird, oder- der Zeitpunkt der Ordereingabe nach Orderannahmeschluss liegt. <p>In der Hinweiszeile wird angezeigt, dass der Schluss- oder Kassakurs bereits festgestellt wurde bzw. der Orderannahmeschluss erreicht ist.</p> <p>Solche automatischen Folgetagorders werden in die Nebenrechtsverarbeitung einbezogen (anders als die explizit zum Folgetag eingestellten Orders).</p>	<p>Gültig ab Folgetag (automatische Einstellung)</p> <p>Wichtiger Hinweis</p>
F4	Abbruch der Verarbeitung Rücksprung ins XONTRO-ORDER Auswahlmenü	
F6	Rücksprung ins Basismenü	
F11	Abmelden vom System	

Ausgabe



Orderbestand	Aktualisierung des Orderbuchs des Orderempfängers. Wenn das Orderbuch gesperrt ist, erfolgt die Aktualisierung mit Entsperrern.
Orderhistorie	Erfasste Orders werden in der Orderhistorie der Banken BRHI OH dokumentiert.
Terminaldruck	Druck Protokoll der Order-Einzelerfassung, sofern ein Terminaldrucker in der Verarbeitungssteuerung (BUXK BV) zugeordnet wurde.

Funktionsbeschreibung



In der Funktion Orderauswahl kann unter Angabe von Suchkriterien die entsprechende Order aus dem aktuellen Orderbestand zur Bearbeitung ausgewählt werden.

Orderauswahl

```
TRAN: BREB FC: OB SB: #  
  
XONTRO / ORDERAUSWAHL                                4123/99 STADTBANK  
  
GATTUNG          ==> .....  
GESCHAEFTSART   ==> . (K/V)  
LIMIT-VON       ==> ..... BIS ==> ..... ZUS ==> ...  
  
EMPFAENGER      ==> .... ODER STCK/NOM           ==> .....  
  
DATUM-VON       ==> ..... BIS ==> .....  
ZEIT-VON        ==> ..... BIS ==> .....  
  
-- ID-KZ: 4123456789 -- PW:          ----- B99980GL -- 22/12/09 -- 12:53:41 --  
BC0180I BITTE AUSWAHLKRITERIEN EINGEBEN
```

Hinweise zum Aufruf und zur Anzeige



Keine

Suchbegriffe



keine

Eingaben



Folgende vier Suchkombinationen (Zugriffspfade) sind möglich:

	1	2	3	4
Gattung	x	x	x	x
Geschäftsart	x	x	x	x
Empfänger		x		
Limit-von-bis	x	x		
Limit-zus	x	x		
Stück / Nominale			x	
Datum-von-bis				x
Zeit-von-bis				x

Für die aufgezeigten Zugriffspfade müssen nicht alle angekreuzten Suchbegriffe eingegeben werden. Es kann sukzessive auf die Eingabe des jeweils zuletzt aufgeführten Suchbegriffs innerhalb eines Pfades verzichtet werden. Dabei ist aber zu beachten, dass mindestens GATTUNG und GESCHÄFTSART als Suchbegriff erhalten bleiben.

Prüfungen

Keine



Verarbeitung



- ENTER** Durchsuchen des aktuellen Orderbestands. Sprung in die Vollanzeige bzw. Kurzanzeige oder Anzeige einer Fehlermeldung, dass eine Order mit den eingegebenen Suchkriterien nicht existiert.
- F3** Keine Verarbeitung, sondern Rücksprung ins allgemeine BREB-Auswahlmenü.

Ausgabe



keine

Funktionsbeschreibung



Kurzanzeige der Orders, die den Suchkriterien entsprechen, mit der Möglichkeit der Weiterverzweigung in die Vollanzeige

Kurzanzeige

```
TRAN: BREB FC: OB SB: #
XONTRO / KURZANZEIGE                                1123/99 KUSELER BANK

POS GA      STCK/NOM GATTUNG                                LIMIT ZUS
01  K          300 DE0007664005 VOLKSWAGEN AG ST O.N.          100,00
      DWZ-ORDERNR.: 1101175300002   GUE: 31.01.11
02  K          100 DE0007664005 VOLKSWAGEN AG ST O.N.          BILLIGST
      DWZ-ORDERNR.: 1101175300000   GUE: 31.01.11
03  V          200 DE0007664005 VOLKSWAGEN AG ST O.N.          BESTENS
      DWZ-ORDERNR.: 1101175300001   GUE: 31.01.11

EINGABE: ..

-- ID-KZ: 1123456789 -- PW:          ----- B9998140 -- 17/01/11 -- 15:22:04 --
BC0250I BITTE ORDER AUSWAEGHLEN
BC0030I KEINE WEITEREN DATEN VORHANDEN
```

Die Kurzanzeige wird nur dann aufgerufen, wenn mehr als eine Order zu den entsprechenden Suchkriterien vorhanden ist.

Je Seite werden max. vier Orders angezeigt. Sind weitere Orders vorhanden, wird in der letzten Zeile ein entsprechender Hinweis ausgegeben.

In der ersten Spalte unter POS werden die einzelnen Orders nummeriert.

Suchbegriffe



Keine

Eingaben



EINGABE

Eingabe der Positionsnummer der gesuchten Order. Pro Bildschirmseite kann nur eine Position ausgewählt werden.

Prüfungen



keine

Verarbeitung



ENTER

Wurde das Feld EINGABE mit der Positionsnummer gefüllt, wird in die Vollanzeige der entsprechenden Order verzweigt.

F3

Rücksprung in die Auswahlmaske der Orderbearbeitung.

F4

Rücksprung in das Zwischenmenü ORDERERFASSUNG UND ORDERBEARBEITUNG

F7 / F8

Blättern, wenn mehr als vier Orders angezeigt werden.

Ausgabe



Keine

Funktionsbeschreibung



Orderbearbeitung Vollanzeige

```

TRAN: BREB FC: OB SB: #

KONTRO / ORDERBEARBEITUNG - VOLLANZEIGE                                4091/99 TEST BAN

GATTUNG      : DE000BASF111          BASF SE NA O.N.

GESCHAEFTSART: KAUF                  DWZ-ORDERNR : 171002650000
STCK/NOM     : 100
LIMIT        : BILLIGST
ZUSATZ       :
GUELTIGKEIT : 31.12.17              STATUS      : AUSFUEHRBAR
HHW          : ..                   EINST.-TAG  : 02.10.17
BI-ORDERNR.  : 4711                 BEARB.-TAG  :
EMPFAENGER   : 4270               BEARB.-ZEIT :
                                           BEARB.-ID  : 4001199999

TEXT         : .....
CLIENT-ID   : ..... USER/SHCO/PNAL/AGGR
EXECUTION-ID : ..... USER/SHCO/VWHD
INVESTMENT-ID : ..... USER/SHCO
                                           LOESCHUNG (L) : .

-- ID-KZ: 4091199999 -- PW:          ----- B9998162 -- 02/10/17 -- 19:24:56 --

BC0080I BITTE DATEN EINGEBEN

```

Hinweise zum Aufruf und zur Anzeige

Die XONTRO-Orderänderungsmaske „BREB OB“ wird um die Datenfelder Client-ID, Execution-ID und Investment-ID erweitert. Hinsichtlich der Feldbelegungen durch die Teilnehmer sind die Anforderungen und Regelwerke der ESMA bezüglich der MiFID II Umsetzung, sowie die im vorhergehenden Abschnitt „Ordereingabe BREB EE“ beschriebenen Eingabemöglichkeiten zu beachten. Die bei der Ordereingabe verwendeten Feldinhalte bleiben nicht erhalten, werden bei der Änderung/Löschung nicht übernommen und können bzw. sollten daher neu eingegeben werden.

Die Vollanzeige kann auf folgenden Wegen aufgerufen werden:

- Selektion vorgeschlagener Orders in der Kurzanzeige.
- Eingabe von BI- oder DWZ-Ordernummer als Suchbegriff in BREB.
- Eingabe von eindeutigen Suchkriterien in der Auswahlmaske zu BREB OB.

Suchbegriffe

BI-Ordernummer Nur möglich, wenn die BI-Ordernummer in der Verarbeitungssteuerung als eindeutig definiert wurde.

DWZ-Ordernummer Eingabe der betreffenden DWZ-Ordernummer.

Eingaben

Orderänderungen erfolgen durch Überschreiben der zu berichtigenden Felder.

**Order-
bearbeitung**

Folgende Felder sind änderbar:

**Änderbare
Felder**

LIMIT, GUELTIGKEIT, BI-ORDERNR., EMPFAENGER, TEXT,
CLIENT-ID, EXECUTION-ID, INVESTMENT-ID

Alle anderen Felder sind nicht änderbar.

**Nicht
änderbare
Felder**

LOESCHUNG 'L', wenn die Order gelöscht werden soll.

**Order-
löschung**

FREIGABE Im zweiten Verarbeitungsschritt nach Eingabe von ENTER:

'L', wenn eine Orderlöschung endgültig verarbeitet werden soll.

'A', wenn eine Orderänderung endgültig verarbeitet werden soll.

Prüfungen



LIMIT Das Limit oder die Kurswertgrenze wird mit den Vorgaben der maximalen Abweichung zum vorausgegangenen Kurs verglichen. Die Vorgabe wird in der Verarbeitungssteuerung BUXK BV eingetragen. Überschreitet die Limiteingabe diese Vorgabe, so muss diese zusätzlich mit der Datenfreigabetaste ratifiziert werden.

Verarbeitung



ENTER Die Maske erscheint in aufbereiteter Form. Es besteht nochmals die Möglichkeit, die Änderung bzw. Löschung zu überprüfen.

Bevor eine Orderänderung endgültig durchgeführt wird, muss das Freigabekennzeichen 'A' im Feld Freigabe eingegeben werden.

Bevor eine Orderlöschung endgültig durchgeführt wird, muss das Freigabekennzeichen 'L' im Feld Freigabe eingegeben werden.

ENTER
Fortsetzung

Orderbearbeitung während Sperre Orderbuch oder Kurskorrekturzeit:

Änderungen/Löschungen werden in einen Vorhaltebestand eingestellt. Ein Hinweis auf Einstellung in den Vorhaltebestand wird angezeigt.

- Ist das betreffende Orderbuch gesperrt und die Sperre liegt nicht in der Kurskorrekturzeit einer vorangegangenen Kursfeststellung, so wird im Falle eines Entsperrens ohne Kursfeststellung die Orderbearbeitung durchgeführt. Wurde die Order bei Kursfeststellung ausgezeichnet, so ist die Orderbearbeitung nicht wirksam.
- Ist das betreffende Orderbuch gesperrt und die Sperre liegt in der Kurskorrekturzeit einer vorangegangenen Kursfeststellung, so erfolgt im Falle eines Entsperrens ohne Kursfeststellung keinerlei Aktion. Wurde die Order bei Kursfeststellung ausgezeichnet, so ist die Orderbearbeitung nicht wirksam. Durchgeführt wird die Orderbearbeitung nur dann, wenn bei der Kursfeststellung die Order nicht erfasst wurde.
- Liegt der Eingang der Bearbeitung während der Kurskorrekturzeit und ist das Orderbuch nicht gesperrt, so erfolgt eine Ablehnung, wenn die Order bei der vorangegangenen Kursfeststellung ausgeführt wurde. Sie erscheint dann nicht in der Kurz- oder Vollanzeige.

F3 Rücksprung in die KURZANZEIGE

F4 Rücksprung in den Auswahlbildschirm:
ORDERERFASSUNG UND ORDERBEARBEITUNG

F7 / F8 Zurück- bzw. Vorwärts-Blättern (...)

F11 Abmelden vom System

Ausgabe



Orderbestand Aktualisierung des Orderbuchs des Orderempfängers. Wenn das Orderbuch gesperrt ist, erfolgt die Aktualisierung mit dem Entsperrern.

Orderhistorie Das Ereignis Order-Änderung/-Löschung wird in der Orderhistorie der Banken BRHI OH dokumentiert.

Terminaldruck Druck Protokoll der Order-Einzelerfassung, sofern ein Terminaldrucker in der Verarbeitungssteuerung (BUXK BV) zugeordnet wurde.