



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute Nr. 52

Dieser Newsletter enthält

- Inhaltliche Erweiterung der Entgeltdatei um OTC-Geschäfte zum 01. September 2011
- Realisierung Erweiterung der FIX-Anbindung
- Bereitstellung von ZIP-Dateien im BT-Fileservice

## **1. Inhaltliche Erweiterung der Entgeltdatei um OTC-Geschäfte**

Auf Wunsch einiger Teilnehmer werden zukünftig die Platzdirektgeschäfte in den Entgeltdateien enthalten sein.

### **1) Entgeltdatei für Berlin, Düsseldorf, Hamburg, Hannover und München**

In der Entgeltdatei für die Börsenplätze Berlin, Düsseldorf, Hamburg, Hannover und München sind die Platzdirektgeschäfte mit Geschäftsnummer und `BERECHNUNGSMODELL_SNO="SNO"` und dem Preis im Feld `SNO_ENTGELT` enthalten.

### **2) Entgeltdatei für Stuttgart**

In der Entgeltdatei für den Börsenplatz Stuttgart wird die Geschäftsnummer der Platzdirektgeschäfte in das Feld `"EINGABENUMMER"` mit dem Präfix `"DWZ"` gestellt. Der Preis ist im Feld `FIX_ENTGELT` enthalten.

Die aktuellen Satzbeschreibungen finden Sie am Ende des Newsletters.

Die Änderungen unter Ziffer 1) und 2) werden zum 01. September 2011 eingesetzt.

## **2. Realisierung Erweiterung der FIX-Anbindung**

Wie bereits im Newsletter Nr. 48 vom 10. Dezember 2010 angekündigt, wurde die zweite Stufe der Funktionalitäten von OTC-Geschäften, Schlussnoten und MiFID zum 20. Juni 2011 realisiert.

XONTRO ist damit per Fix 4.2 sowie 4.4 im gleichen Umfang wie derzeit per SAKI erreichbar. Das gleiche gilt auch für die Erreichbarkeit von INVESTRO per Fix.

### **3. Bereitstellung von ZIP-Dateien im BT-Fileservice**

BrainTrade wird ab dem **05. Dezember 2011** sämtliche Dateien im BT-Fileservice als komprimierte ZIP-Dateien bereitstellen.

Zurzeit sind alle Dateien im BT-Fileservice mit der Software FLAM komprimiert. Dazu ist es erforderlich, dass Sie auf Ihrem PC die Software FLAM installiert haben. Nur so können Sie die Dateien entpacken und entschlüsseln.

Ein sicherer Zugriff zum BT-Fileservice ist bereits heute durch die Verschlüsselung mit HTTPS SSL 3.0, RC4 mit 128 Bit, RSA mit 1024 Bit vorhanden und alle Anfragen, die über http eintreffen, werden automatisch auf HTTPS umgeschrieben. So ist ausgeschlossen, dass aus Versehen oder vom Benutzer bewusst herbeigeführt, eine unverschlüsselte Kommunikation zwischen dem Client und dem Apache-Server stattfinden kann. Hiermit bietet BrainTrade eine sichere Verbindung, die dem aktuellen Sicherheitsstandard entspricht.

Daher hat sich BrainTrade entschlossen, auf eine kundenfreundliche Lösung umzustellen, die Dateien ab dem 05. Dezember 2011 als ZIP Dateien zu liefern. Somit kann auf den Einsatz der Software FLAM verzichtet werden.

#### 4. Satzbeschreibungen Entgeltdatei

Tagesdatei für Teilnehmer und Börsen Berlin, Düsseldorf, Hamburg, Hannover und München:

Feld	Beschreibung	Format
ABSCHL_DATUM	Abschlussstag	PIC 9(8)
ABSCHL_ZEIT	Abschluss-Uhrzeit	PIC 9(8)
GESCHAEFTSNUMMER	Geschäftsnummer	
GNR-BOE		PIC X(3)
GNR-BOETAG		PIC X(6)
GNR-LFD_NR		PIC X(7)
ORDER_NR	XONTRO-Ordernummer	PIC X(13)
EINGABENUMMER	Eingabenummer bei manueller Geschäftseingabe (3 Stellen Präfix „MAN“ oder „MFM“ gefolgt von 13-stelliger Nummer)	PIC X(16)
GESCHAEFTSART	BUY_SELL_FLAG	PIC X
STORNO_FLAG	Storno-Kennzeichen	PIC X
CBF_NR	CBF-Nr des Aufgebers/Ausführers	PIC 9(4)
KZ_AUSF_AUFG	A=Aufgeber, E=Ausführer	PIC X(1)
KZ_CBF_NR_ART	000 = Bank, 001 = Makler	PIC X(3)
BOE_CBF_NR	BPL des Aufgebers/Ausführers	PIC X(3)
ISIN		PIC X(12)
KURS		PIC 9(8)V9(8)
NOMINALE	Volumen	PIC 9(14)V9(3)
KURSWERT	Kurswert	PIC 9(15)V99
BERECHNUNGS_MODELL	SNO/FIX/FRC	PIC X(3)
WP_GRUPPE	00 -10 (00 = Std)	PIC X(2)
KZ_AUSF_KUMULIERT	J/N (kumulierte Teilausführung)	PIC X
KZ_DEPOT_SKM	J/N	PIC X
KZ_MFM	J/N	PIX X

Feld	Beschreibung	Format
KZ_PRIVILIGIERT	J/N	PIC X
KZ_BOERSLICH	AB, BS	PIC X(2)
SNO_ENTGELT	SNO basierter Entgeltbetrag	PIC S9(7)V9(2)
FIX_ENTGELT	FIX Entgeltbetrag	PIC S9(7)V9(2)
FRC_ENTGELT	FRC bzw. MFM Entgeltbetrag	PIC S9(7)V9(2)
TAGES_DATUM	JHJJMMTT Tagesdatum	PIC 9(8)
KZ_EIGENGESCHAEFT	Eigengeschäfts-Kennzeichen Makler/QLP	PIC X(2)
MAKLER	Makler/QLP, der das Eigengeschäft getätigt hat	PIC 9(4)

Tagesdatei für Teilnehmer und Börse Stuttgart:

Feld	Beschreibung	Format
ABSCHL_DATUM	Abschlussstag	PIC 9(8)
ABSCHL_ZEIT	Abschluss-Uhrzeit (ist '0', wenn KZ_AUSF_KUMULIERT= 'J')	PIC 9(8)
EINGABENUMMER	Eingabenummer bei manueller Geschäftseingabe (3 Stellen Präfix „MAN“ gefolgt von 6 Stellen Datum JJMMTT und 7-stelliger Nummer) oder Geschäftsnummer bei Bankdirektgeschäften (3 Stellen Präfix „DWZ“ gefolgt von 6 Stellen Datum JJMMTT und 7-stelliger Nummer)	PIC X(16)
ORDER_NO	XONTRO-Ordernummer	PIC X(13)
BUY_SELL_FLAG	Geschäftsart	PIC X
WEITERGELEITET	W oder blank/ NULL kennzeichnet, ob die Order weitergeleitet wurde	PIC X
STORNO_FLAG	Storno-Kennzeichen	PIC X
BOE_EINGEBER	BPL des Orderempfängers bzw. des Eingebers	PIC XXX

Feld	Beschreibung	Format
EINGEBER	CBF-Nr. Orderempfänger / Eingeber	PIC 9(4)
EINGEBER_KZ_EIN_ART	Kennzeichen, ob Eingeber Bank oder Makler 000 = Bank 001 = Makler	PIC 999
BOE_AUFGEBER	BPL des Orderaufgebers bzw. des SNO-Empfängers	PIC XXX
AUFGEBER	CBF-Nr. des Orderaufgebers bzw. des SNO-Empfänger	PIC 9(4)
AUFGEBER_KZ_EIN_ART	Kennzeichen, ob Empfänger Bank oder Makler 000 = Bank 001 = Makler	PIC 999
ISIN	ISIN	PIC X(12)
PREIS	Preis (bei KZ_AUSF_KUMULIERT = ‚J‘ wird hier ein gewichteter Durchschnittspreis eingestellt)	PIC 9(8)V9(8)
NR_KF	Nummer der Kursfeststellung (ist ‚0‘, wenn KZ_AUSF_KUMULIERT= ‚J‘)	PIC 9(5)
NOMINALE	Volumen (bei KZ_AUSF_KUMULIERT = ‚J‘ das kumulierte Volumen aller zusammengefassten Teilausführungen)	PIC 9(14)V9(3)
KURSWERT	Kurswert (bei KZ_AUSF_KUMULIERT = ‚J‘, der kumulierte Kurswert aller zusammengefassten Teilausführungen)	PIC 9(15)V99
FIX_ENTGELT	anfallender Fixbetrag ohne MwSt.	PIC S9(7)V9(2)
VAR_ENTGELT	errechneter variabler Entgeltbetrag ohne MwSt.	PIC S9(7)V9(2)
STAFFELENTGELT	variables Entgelt für Emittenten ohne MwSt. (nur gefüllt, wenn FIX_ENTGELT und VAR_Entgelt leer sind)	PIC S9(7)V9(2)



Feld	Beschreibung	Format
Entgelt-Kennzeichen	blank = Standard AT = abweichendes Transaktionsentgelt wurde eingetragen; der erfasste Betrag ersetzt das VAR_ENTGELT und das Fixentgelt bzw. das Staffellentgelt. Der Fixbetrag ist in diesem Fall immer leer. KT = es wurde kein Transaktionsentgelt berechnet HT = VAR_ENTGELT bzw. Staffellentgelt wurden halbiert; das FIX_ENTGELT bleibt davon unberührt.	PIC X(2)
Entgeltschlüssel	vgl. WM/WSS-Daten Entgeltschlüssel Stuttgart z. B. 3A, 3B, 3C, 3D, 3E, 3F, 3G, 39	PIC X(2)
QLP	Skontroführer zu der ISIN	PIC 9(4)
KZ_AUSF_KUMULIERT	J/N (kumulierte Teilausführung)	PIC X
KZ_EIGENGESCHAEFT	Eigengeschäfts-Kennzeichen Makler/QLP	PIC X(2)
MAKLER	Makler/QLP, der das Eigengeschäft getätigt hat	PIC 9(4)