

## **FAGSE BT-FIX Gateway**

### **Rules of Engagement**

Dokument: v236\_RoE BT-FIX Gateway.docx

Version: 2.3.6

Letzte Änderung: 13.03.2018

Produktiv ab: 16. April 2018

Test ab: 26. März 2018

---

**FAGSE**

**BT-FIX Gateway**

---

13.03.2018

**Rules of Engagement**

---

---

Seite 2 von 137

---

**Verwandte Dokumente**

**XONTRO**

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

**FIX**

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

**Webseiten**

[www.xontro.de](http://www.xontro.de)

[www.deutsche-boerse.com](http://www.deutsche-boerse.com)

[www.fixprotocol.org](http://www.fixprotocol.org)

---

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 3 von 137

**Inhaltsverzeichnis**

|          |  |           |
|----------|--|-----------|
| <b>1</b> | <b>Einleitung.....</b>   | <b>5</b>  |
| 1.1      | Abkürzungen und Definitionen.....                                  | 6         |
| <b>2</b> | <b>Randbedingungen .....</b>                                       | <b>7</b>  |
| 2.1      | Protokollversionen.....  | 7         |
| 2.2      | Clients und OMS .....  | 7         |
| 2.3      | Security.....  | 8         |
| 2.4      | Zielsysteme.....   | 8         |
| 2.5      | Instrumente .....  | 9         |
| 2.6      | Konkurrenzen mit anderen Interfaces der Zielsysteme.....           | 9         |
| 2.7      | Umsetzung der MiFID II Anforderungen.....                          | 10        |
| 2.7.1    | Versorgung der MiFID II Datenfelder .....                          | 10        |
| 2.7.2    | Shortcode-Verfahren .....  | 10        |
| 2.8      | Order- bzw. Auftrags-Funktionalität .....                          | 11        |
| 2.8.1    | Orderidentifikation .....  | 11        |
| 2.8.2    | Empfehlungen .....   | 11        |
| 2.8.3    | INVESTRO / Vestima .....   | 12        |
| 2.8.4    | Besonderheiten bei der Behandlung bestimmter Requests .....        | 12        |
| 2.9      | Trade-Funktionalität .....   | 13        |
| 2.9.1    | Unterstützte Nachrichten .....                                     | 13        |
| 2.9.2    | Tradeidentifikation.....   | 13        |
| 2.10     | Reject Verhalten.....  | 14        |
| 2.11     | Verhalten bei ResendRequest .....                                  | 14        |
| 2.12     | Inbetriebnahme .....   | 14        |
| <b>3</b> | <b>Leistungsmerkmale.....</b>                                      | <b>15</b> |
| 3.1      | Eingehende und Ausgehende Nachrichten .....                        | 15        |
| 3.2      | Szenarien und Nachrichten des Sessionlevels.....                   | 16        |
| 3.2.1    | Verarbeitung FIX-Requests .....                                    | 16        |
| 3.2.2    | Systemgenerierte Nachrichten.....                                  | 16        |
| 3.3      | Szenarien und Nachrichten des Applikationslevels .....             | 17        |
| 3.3.1    | Verarbeitung FIX-Requests .....                                    | 17        |
| 3.3.2    | Externe Eingaben / systemgenerierte Nachrichten.....               | 18        |
| 3.4      | Unterschiede zwischen FIX 4.2 und FIX 4.4 .....                    | 19        |
| 3.4.1    | Orderrouting.....  | 19        |
| 3.4.2    | Passwortänderung .....   | 20        |
| 3.4.3    | Trade-Nachrichten.....   | 20        |
| <b>4</b> | <b>FIX-Nachrichten, Detailbeschreibung zu Header/Trailer .....</b> | <b>21</b> |
| 4.1      | Erläuterungen FIX Header/Trailer .....                             | 21        |
| 4.2      | FIX Header <standard message header> .....                         | 22        |
| 4.3      | FIX Trailer <standard message trailer> .....                       | 23        |
| <b>5</b> | <b>FIX-Nachrichten des Sessionlevels.....</b>                      | <b>24</b> |
| 5.1      | Erläuterungen FIX Datenteil .....                                  | 24        |
| 5.2      | Logon / Logon mit gleichzeitiger Passwortänderung .....            | 25        |
| 5.3      | Passwortänderung .....   | 27        |
| 5.4      | Logout.....  | 28        |
| 5.5      | System Shutdown .....  | 29        |

---

**FAGSE**

**BT-FIX Gateway**

---

13.03.2018

**Rules of Engagement**

---

---

Seite 4 von 137

---

|           |  |            |
|-----------|--|------------|
| <b>6</b>  | <b>FIX-Nachrichten vom Typ Reject und Business Message Reject.....</b> | <b>30</b>  |
| <b>7</b>  | <b>FIX-Nachrichten des Applicationlevels .....</b>                     | <b>31</b>  |
| 7.1       | Erläuterungen FIX Datenteil .....                                      | 31         |
| 7.2       | Orderfunktionalität.....   | 32         |
| 7.2.1     | Order- bzw. Auftragseinstellung.....                                   | 32         |
| 7.2.2     | Order- bzw. Auftragslöschung .....                                     | 48         |
| 7.2.3     | Order- bzw. Auftragsänderung.....                                      | 59         |
| 7.2.4     | Order- bzw. Auftragsausführung.....                                    | 68         |
| 7.2.5     | Auslösung einer Aktion über ein anderes Interface .....                | 73         |
| 7.2.6     | Systemgenerierte Orderänderungen und Löschungen .....                  | 77         |
| 7.2.7     | Componenten Blocks und Repeating Groups.....                           | 79         |
| 7.2.8     | Besonderheiten der Tag Behandlung.....                                 | 85         |
| 7.3       | Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima) - Besonderheiten.....             | 86         |
| 7.3.1     | Nachrichten an den Auftragsempfänger (INVESTRO "classic").....         | 86         |
| 7.3.2     | Auftragsrouting an INVESTRO mit Vestima-Gattungen.....                 | 87         |
| 7.4       | Ereignisse .....   | 88         |
| 7.4.1     | Abläufe.....   | 88         |
| 7.4.2     | Ereignismitteilung "News" .....  | 88         |
| 7.4.3     | NoLinesOfText Repeating Group <LinesOfTextGrp> .....                   | 89         |
| 7.4.4     | NoRelatedSym Repeating Group <InstrmtGrp> .....                        | 89         |
| 7.4.5     | NoRoutingIDs Repeating Group <RoutingGrp>.....                         | 89         |
| 7.5       | Tradefunktionalität.....   | 90         |
| 7.5.1     | Unterstützte Vorfälle.....   | 90         |
| 7.5.2     | Abläufe.....   | 91         |
| 7.5.3     | OTC-Geschäfte und MiFID-Reports - Requests .....                       | 92         |
| 7.5.4     | OTC-Geschäfte und MiFID-Reports - Responses .....                      | 101        |
| 7.5.5     | Schlussnoten-Realtime.....   | 104        |
| <b>8</b>  | <b>Anhang A: Beispiele.....</b>  | <b>116</b> |
| <b>9</b>  | <b>Anhang B: Einschränkungen von Formaten und Strukturen .....</b>     | <b>118</b> |
| <b>10</b> | <b>Anhang C: Benutzerdefinierte Tags .....</b>                         | <b>120</b> |
| <b>11</b> | <b>Anhang D: Erweiterungen des 4.2 Sprachumfangs .....</b>             | <b>127</b> |
| <b>12</b> | <b>Anhang E: Erweiterungen des 4.4 Sprachumfangs .....</b>             | <b>129</b> |
| <b>13</b> | <b>Anhang F: Abweichende Belegungen von Standardtags .....</b>         | <b>130</b> |
| <b>14</b> | <b>Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart).....</b>        | <b>136</b> |

---

## 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 XONTRO, MAX-ONE, Xetra und Xetra Ffm-2,
- die Auftragsverarbeitung in den Fonds-Abwicklungssystemen INVESTRO und Vestima,
- die Tradeverarbeitung in dem Handelssystem XONTRO.

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

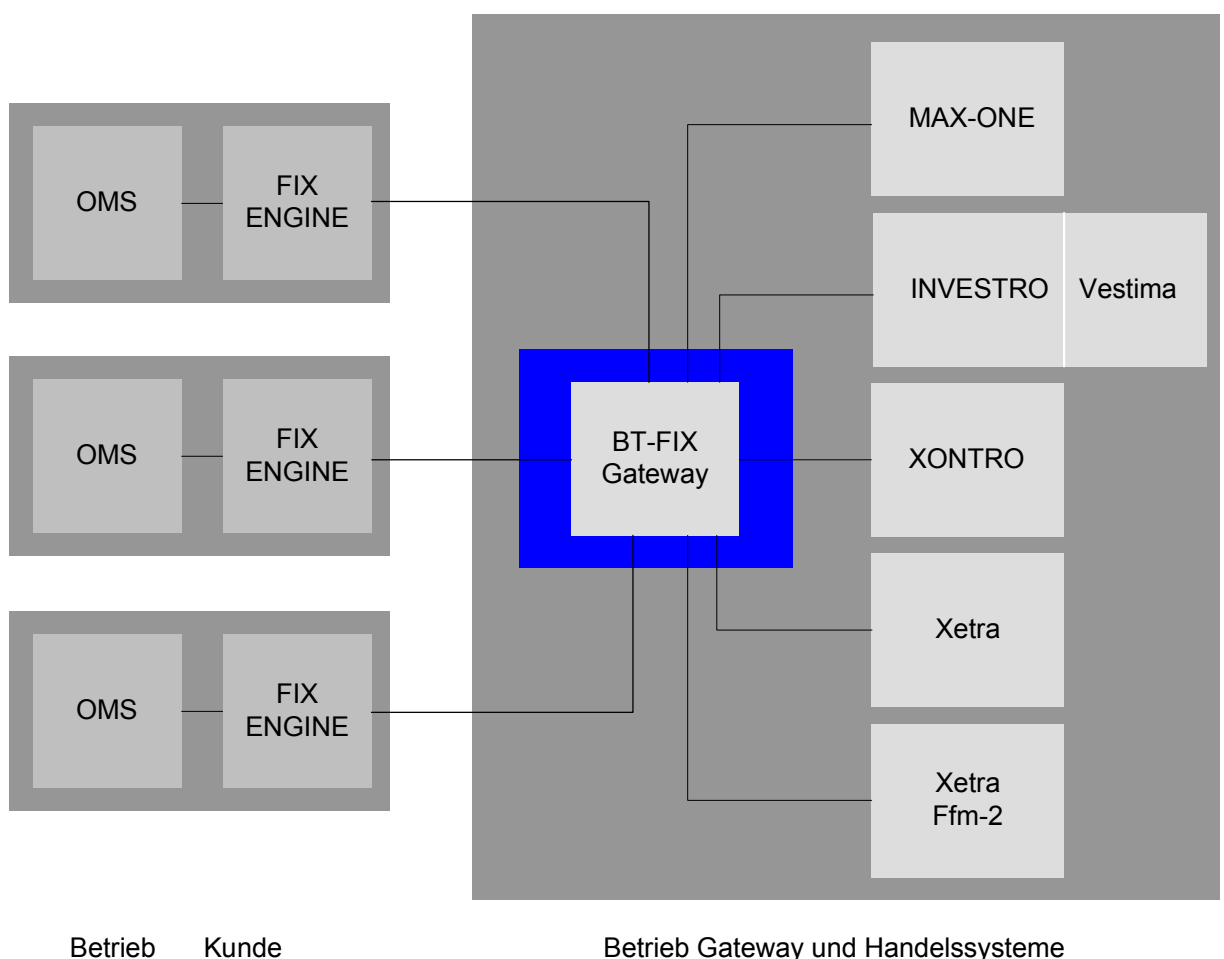


Abbildung 1-1: Systemüberblick

## 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 <b>F</b> inancial <b>I</b> nformation <b>eX</b> 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).  |

## **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<sup>1</sup>. Ist dies nicht möglich, werden registrierte, benutzerdefinierte Tags herangezogen. Individuelle Tag Definitionen (Tags > 10000) werden nicht verwendet.

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.

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

Die Anbindung erfolgt über eine oder zwei Standleitungen, das Protokoll ist TCP/IP<sup>2</sup>.

---

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> Es ist zunächst keine Unterstützung von Version 5.0 und damit auch keine Unterstützung von FIXT vorgesehen.

---

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 Verschlüsselung 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
- MAX-ONE
- XETRA (XETR)\*\*
- Xetra Ffm-2 (XFRA)\*\*

\*\* 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. Abwicklungssystems.

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) bieten 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-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 Interfaces (z.Bsp: Dialogeingabe XONTRO, 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 nur für die Teilnehmer des FIX-Order routings 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.

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 Überschriftenzeile aus.

Die übermittelten Files werden periodisch per Batch-Verarbeitung in die XONTRO Geschäftsvorfalldokumentation 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 Schlüsselssystematik 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 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 „7.5 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 eine eindeutige TradeReportID generiert.

Als Schlüsselfelder für die Identifikation der Trade-Nachrichten werden im BT-FIX Gateway ausschließlich die in XONTRO 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. Abwicklungssystem 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. Abwicklungssystem erkennt, werden über einen Execution Report, Cancel Reject oder einen Business Message Reject mitgeteilt.

Ist ein Handels- bzw. Abwicklungssystem 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. Abwicklungssystem verwendet. Diese Festlegung wird auch für Nachrichten verwendet, bei welchen nicht die gesamte Übertragungstrecke durchlaufen wird.

Übertragungstrecke für eingehende Nachrichten:

OMS → FIX Engine (Kunde) → BT-FIX Gateway → Handels- bzw. Abwicklungssystem

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

Übertragungstrecke für ausgehende Nachrichten:

Handels- bzw. Abwicklungssystem → 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  |
|--|---|---|
| <b>Technische Requests</b>   |   |   |
| Anmeldung  | Logon   | Logon (positiv)<br>Logon + Logout (negativ)                   |
| Anmeldung mit gleichzeitiger<br>Passwortänderung   | Logon   | Logon (positiv)<br>Logon + Logout (negativ)                   |
| Abmeldung  | Logout  | Logout  |
| Passwortänderung   | User Request (4.4)<br>Benutzerdefinierter User<br>Request (4.2) | User Response (4.4)<br>Benutzerdefinierte User Response (4.2) |
| <b>Allgemeine Ablehnungen (möglich für jeden Request)</b>  |   |   |
| Session Level Reject   | jede Request-Nachricht  | Reject  |
| Allgemeine Ablehnung durch ein<br>Handels- bzw.<br>Abwicklungssystem oder das BT-<br>FIX Gateway | jede Request-Nachricht  | Business Message Reject                                       |

### 3.2.2 Systemgenerierte Nachrichten

| Szenario                            | Eingehende Nachrichten | Ausgehende Nachrichten                                  |
|-------------------------------------|------------------------|---|
| <b>System Shutdown</b>              |                        |   |
| Abmeldung                           | -                      | Logout  |
| Statusnachrichten                   | -                      | News<br>"End-of-Day Processing"<br>"End-of-Day Cut-off" |
| <b>Technische Nachrichten</b>       |                        |   |
| Prüfen der physischen<br>Verbindung | -                      | Heartbeat   |
| Anforderung eines Heartbeats        | -                      | TestRequest   |
| Anforderung von Nachrichten         | -                      | Resend Request  |



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 17 von 137

**3.3 Szenarien und Nachrichten des Applikationslevels****3.3.1 Verarbeitung FIX-Requests**

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 18 von 137

**3.3.2 Externe Eingaben / systemgenerierte Nachrichten**

| Szenario   | Eingehende Nachrichten | Ausgehende Nachrichten  |
|--|------------------------|---|
| <b>Orderfunktionalität, Auftragsverarbeitung</b> |                        |   |
| Ordereingang                                     | -                      | Execution Report  |
| Orderlöschung                                    | -                      | Execution Report (positiv, vorläufig)<br>Order Cancel Reject (negativ)  |
| Orderänderung                                    | -                      | Execution Report (positiv, vorläufig)<br>Order Cancel Reject (negativ)  |
| Orderausführung                                  | -                      | Execution Report  |
| Auftragseingang                                  | -                      | Execution Report  |
| Auftragslöschung                                 | -                      | Execution Report (positive, vorläufig)<br>Order Cancel Reject (negativ) |
| Auftragsausführung                               | -                      | Execution Report  |
| Nachrichten an den Auftragsempfänger             | -                      | Execution Report  |
| Statusänderungen eines Auftrags (nur Vestima)    | -                      | Execution Report  |
| Storno einer Auftragsausführung (nur Vestima)    | -                      | Execution Report  |
| <b>Tradefunktionalität</b>                       |                        |   |
| Geschäftsinformationen (Schlussnoten-Realtime)   | -                      | TradeCaptureReportSno   |
| <b>Ereignisse</b>                                |                        |   |
| Ereignismitteilung                               | -                      | News  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 19 von 137

**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<sup>3</sup>:

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

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 20 von 137

| <parties>               | Tag 4.2 | Feldname                                | Kommentare  |
|-------------------------|---------|---|---|
|                         | 21222   | PartyIDInvestmentDecisionMakerQualifier | Integer<br>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.<br>22 = Algorithmus<br>24 = Shortcode für nat. Person<br>Fehlt Tag 21222, wird von einem Shortcode ausgegangen. |
|                         | 21422   | PartyIDInvestmentDecisionMakerSource    | Char<br>Klassifizierung des Tag 20122.<br>P = Shortcode, oder in Verbindung mit Tag 21222 auch Algorithmus.<br>Die Angabe von Tag 21422 ist nicht notwendig.  |
| <Execution within firm> | 20012   | PartyIDExecutingTrader                  | String(20), Shortcode oder Algorithmus.<br>(ESMA RTS24 Feld 5)<br>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.<br>22 = Algorithmus<br>24 = Shortcode für nat. Person<br>Fehlt Tag 21112, wird von einem Shortcode ausgegangen.                    |
|                         | 21312   | PartyIDExecutingTraderSource            | Char<br>Klassifizierung des Tag 20012.<br>P = Shortcode, oder in Verbindung mit Tag 21112 auch Algorithmus.<br>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".

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 22 von 137

**4.2 FIX Header <standard message header>****Eingehende Nachrichten**

| Tag | Feldname               | RF | R | Kommentare  |
|-----|------------------------|----|---|---|
| 8   | BeginString            | M  | M | String<br>Kennzeichnung der FIX Version<br>muss immer = "FIX.4.4" oder "FIX.4.2" sein<br>feste Feldposition (1)   |
| 9   | BodyLength             | M  | M | Length<br>Nachrichtenlänge<br>feste Feldposition (2)  |
| 35  | MsgType                | M  | M | String<br>Typ der Nachricht<br>feste Feldposition (3)<br>nur die vom BT-FIX Gateway definierten Typen sind zulässig   |
| 34  | MsgSeqNum              | M  | M | SeqNum<br>Folgenummer der Nachricht, vom sendenden System<br>vergeben, lückenlos pro Session, Startwert = "1".<br>Die Sequenznummer der FIX Engine wird innerhalb eines<br>Tages hochgezählt, unabhängig davon, wie oft eine Session<br>beendet und wieder aufgebaut wurde. Am nächsten Tag startet<br>die Sequenznummer wieder mit "1"   |
| 43  | PossDupFlag            | O  | O | Boolean<br>Wird bei einer Retransmission mit identischer Folgenummer<br>von der Engine auf "Y" gesetzt  |
| 49  | SenderCompID           | M  | M | String<br>Identifikation des sendenden Systems. Ist zwischen dem<br>Eigentümer des Systems und der BrainTrade GmbH zu<br>vereinbaren.<br>Werden von einem Eigentümer mehrere Systeme betrieben,<br>dann können diese nicht gleichzeitig aktiv sein<br>Das Tag SenderCompID muss auf allen Systemen identisch<br>belegt werden   |
| 52  | SendingTime            | M  | M | UTCTimestamp  |
| 56  | TargetCompID           | M  | M | String<br>Identifikation des empfangenden Systems. Wird von der<br>BrainTrade GmbH festgelegt   |
| 97  | PossResendFlag         | O  | O | Boolean<br>Die sendende Applikation zeigt bei auf „Y“ gesetztem Flag an,<br>dass die Nachricht ggf. mit anderer Sequenznummer schon<br>einmal übertragen wurde. Muss von Applikation überprüft<br>werden.<br>Diese Funktionalität wird nicht in vollem Umfang unterstützt:<br>Das BT-FIX-Gateway erlaubt das PossResend nur für<br>NewOrderSingle. Wenn der Request mit derselben ClOrderID<br>bereits einmal empfangen wurde, dann wird der bereits<br>versendete ExecutionReport bzw. Reject nochmals an den<br>Client übertragen, ansonsten wird der Request nicht<br>verarbeitet, sondern mit einem Reject beantwortet. |
| 122 | OrigSendingTime        | O  | O | UTCTimestamp<br>Bei Antworten auf einen Resend Request des BT-FIX<br>Gateway:<br>Timestamp der Originalnachricht<br>Aus Kompatibilitätsgründen aufgenommen<br>Das Tag wird ignoriert  |
| 369 | LastMsgSeqNumProcessed | O  | O | SeqNum<br>Letzte vom sendenden System verarbeitete Folgenummer  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 23 von 137

**Ausgehende Nachrichten**

| Tag | Feldname        | RF | R | Kommentare   |
|-----|-----------------|----|---|--|
| 8   | BeginString     | M  | M | String<br>Kennzeichnung der FIX Version<br>immer = "FIX.4.4" oder "FIX.4.2"<br>feste Feldposition (1)  |
| 9   | BodyLength      | M  | M | Length<br>Nachrichtenlänge<br>feste Feldposition (2)   |
| 35  | MsgType         | M  | M | String<br>Typ der Nachricht<br>feste Feldposition (3)<br>nur die vom BT-FIX Gateway definierten Typen sind zulässig  |
| 34  | MsgSeqNum       | M  | M | SeqNum<br>Folgenummer der Nachricht, vom sendenden System<br>vergeben, lückenlos pro Session, Startwert = 1  |
| 43  | PossDupFlag     | O  | O | Boolean<br>Wird bei einer Retransmission mit gleicher Folgennummer auf<br>"Y" gesetzt,<br>wird bei einer Antwort auf einen Resend Request immer<br>gesetzt   |
| 49  | SenderCompID    | M  | M | Identifikation des empfangenden Systems. Wird von der<br>BrainTrade GmbH festgelegt  |
| 52  | SendingTime     | M  | M | UTCTimestamp   |
| 56  | TargetCompID    | M  | M | Identifikation des sendenden Systems. Ist zwischen dem<br>Eigentümer des Systems und der BrainTrade GmbH zu<br>vereinbaren   |
| 97  | PossResendFlag  | O  | O | Boolean<br>Das BT-FIX Gateway zeigt bei auf „Y“ gesetztem Flag an, dass<br>die Nachricht ggf. mit anderer Sequenznummer schon einmal<br>übertragen wurde. Das Feld muss von der empfangenden<br>Applikation überprüft werden |
| 122 | OrigSendingTime | O  | O | UTCTimestamp<br>Bei Antworten auf einen Resend Request des Clients:<br>Timestamp der Originalnachricht   |

**4.3 FIX Trailer <standard message trailer>**

| Tag | Feldname | RF | R | Kommentare  |
|-----|----------|----|---|---|
| 10  | Checksum | M  | M | 3 Byte<br>Checksum<br>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 die Angaben Mandatory/Optional/Conditional/Not allowed für die Handels- bzw. Abwicklungssysteme Xetra<sup>4</sup>/XEtra Ffm-2<sup>5</sup>/XONTRO/MAX-ONE/INVESTRO.

Inhalte: In den Spalten **R/RF** werden M/C nur vergeben, wenn das Tag für alle Zielsysteme mandatory/conditional mandatory ist. In **XEOMI** 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.

---

<sup>4</sup> vgl. hierzu bitte auch Abschnitt 2.4 Zielsysteme

<sup>5</sup> vgl. hierzu bitte auch Abschnitt 2.4 Zielsysteme

---



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 25 von 137

**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.

**Logon Request**

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 26 von 137

**Logon Response**

| Tag | Feldname                   | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|-----|----------------------------|----|---|-------|---|
|     | <standard message header>  | M  | M |       | Tag 35 = "A" (MsgType)  |
| 98  | EncryptMethod              | M  | M |       | Integer<br>Verschlüsselungsmethode<br>immer auf 0 = "keine" gesetzt   |
| 108 | HeartBtInt                 | M  | M |       | Integer<br>Heartbeatintervall<br>wird gegen den im BT-FIX Gateway konfigurierten Wert<br>geprüft            |
| 141 | ResetSeqNumFlag            | O  | O | OOOOO | Boolean<br>Anforderung zum Rücksetzen der Sequence Number   |
| 383 | MaxMessageSize             | O  | O | OOOOO | Length<br>Maximale Nachrichtenlänge (Empfang)   |
| 553 | Username                   | O  | O | OOOOO | String(10)<br>userID<br>Das Tag ist zur Zeit nie belegt   |
| 789 | NextExpectedMsgSeqNum      | O  | O | OOOOO | SeqNum<br>Nächste Erwartete Sequence Number<br>wird nicht belegt<br>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 | XEOMI | Kommentare  |
|------|----------------------------|----|---|-------|---|
|      | <standard message header>  | M  | M |       | Tag 35 = "5" (MsgType)  |
| 58   | Text                       |    | O | OOOOO | String<br>Fehlertext  |
| 1409 | SessionStatus              |    | O | OOOOO | Integer<br>Errorcode<br>5 = "Invalid username or password"<br>7 = "Logons are not allowed at this time"<br>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 Passwort) und das Tag 925 (NewPassword) zu liefern.

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 27 von 137

**5.3 Passwortänderung**

Dieser Request erfordert eine bestehende Session. Er kann also **bei einem abgelaufenen Passwort nicht verwendet werden.**

**User Request**

| Tag                        | Feldname        | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|----------------------------|-----------------|----|---|-------|---|
| <standard message header>  |                 | M  | M |       | Tag 35 = "BE" (MsgType)   |
| 553                        | Username        | M  | M |       | String<br>userID  |
| 554                        | Password        | O  | M |       | String(8)<br>Passwort   |
| 923                        | UserRequestID   | M  | M |       | String(16)<br>Eindeutiger Schlüssel                                   |
| 924                        | UserRequestType | M  | M |       | Integer<br>Requesttyp<br>muss auf 3 = "Passwortänderung" gesetzt sein |
| 925                        | NewPassword     | O  | M |       | String(8)<br>Passwort neu   |
| <standard message trailer> |                 | M  | M |       |   |

**User Response**

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

## 5.4 Logout

### Logout Request

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

### Logout Response

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 29 von 137

**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. Abwicklungssysteme 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")                        |             | ←●             |                                 |
|     | <i>weitere Requests vom Client</i>                       |             |                |                                 |
| 2   | NewOrderSingle   | ●→          |                |                                 |
|     | <i>Ablehnung auf Requests nach "End of Business Day"</i> |             |                |                                 |
| 3   | Business Message Reject (4)                              |             | ←●             |                                 |
|     | <i>Nachrichten vom System werden noch geliefert</i>      |             |                |                                 |
| 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 | XEOMI | Kommentare  |
|-----|----------------------------|----|---|-------|---|
|     | <standard message header>  | M  | M |       | Tag 35 = "B" (MsgType)  |
| 33  | LinesOfText                |    | M |       | NumInGroup<br>Anzahl Zeilen mit "1" belegt  |
| 58  | Text                       |    | M |       | String<br>Text der News Messages<br>End of Business Day<br>"End of Day Processing – No more Input messages"<br>End of Business Day Cut-Off<br>"End of Business Day Cut-Off, System unavailable" |
| 148 | Headline                   |    | M |       | String<br>Message Status<br>"002" = End of Business Day<br>"003" = End of Business Day Cut-Off  |
|     | <standard message trailer> | M  | M |       |   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 30 von 137

**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 | XEOMI | Kommentare   |
|------|---------------------|----|---|-------|--|
| 45   | RefSeqNum           | M  | M |       | SeqNum<br>Sequenznummer des abgelehnten Requests                   |
| 58   | Text                | O  | O | OOOOO | String<br>Fehlertext   |
| 371  | RefTagID            | O  | M |       | Integer<br>Tag auf das sich die Fehlermeldung bezieht              |
| 372  | RefMsgType          | O  | M |       | String<br>MsgType der abgelehnten Nachricht                        |
| 373  | SessionRejectReason | O  | O | OOOOO | Integer<br>Grund der Ablehnung                                     |
| 5555 | ReturnCode          |    | O | OOOOO | Integer<br>Returncode  |
| 9803 | TradingSystemID     |    | O | OOOOO | Integer<br>Identifizier 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 | XEOMI | Kommentare   |
|------|----------------------|----|---|-------|--|
| 45   | RefSeqNum            | O  | M |       | SeqNum<br>Sequenznummer des abgelehnten Requests                   |
| 58   | Text                 | O  | O | OOOOO | String<br>Fehlertext   |
| 372  | RefMsgType           | M  | M |       | String<br>MsgType der abgelehnten Nachricht                        |
| 380  | BusinessRejectReason | M  | M |       | Integer<br>Grund der Ablehnung                                     |
| 5555 | ReturnCode           |    | O | OOOOO | Integer<br>Returncode  |
| 9803 | TradingSystemID      |    | O | OOOOO | Integer<br>Identifizier 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, XEOMI die Angaben **M**andatory/**O**ptional/**C**onditional/**N**ot allowed für die Handels- bzw. Abwicklungssysteme **X**etra/**XE**tra Ffm-2/**XO**NTRO/**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, 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 **XEOMI** 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. Auftragseinstellung

#### 7.2.1.1 Abläufe – Orders

| Nr. | Ordereinstellung positiv   | messageflow |                |               |
|-----|--|-------------|----------------|---------------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | Handelssystem |
| 1   | new order single   |             |                |               |
|     | <i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i> |             |                |               |
| 2   | execution report ("Pending New", "Pending New")                          |             |                |               |
|     | <i>endgültige Bestätigung positiv</i>                                    |             |                |               |
| 3   | execution report ("New", "New")  |             |                |               |

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



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 33 von 137

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 34 von 137

**7.2.1.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)**INVESTRO "classic"

| Nr. | Auftragseinstellung positiv  | messageflow |                |          |
|-----|--|-------------|----------------|----------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | INVESTRO |
| 1   | new order single   |             |                |          |
|     |  |             |                |          |
| 2   | <i>endgültige Bestätigung positiv</i><br>execution report<br>("New", "New")              |             |                |          |
|     |  |             |                |          |
| 3   | <i>Nachricht an den Auftragsempfänger</i><br>execution report<br>("Order Status", "New") |             |                |          |
|     |  |             |                |          |

| Nr. | Auftragseinstellung negativ   | messageflow |                |          |
|-----|---|-------------|----------------|----------|
|     |   | FE Customer | BT FIX Gateway | INVESTRO |
| 1   | new order single  |             |                |          |
|     |   |             |                |          |
| 2   | <i>endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation</i><br><i>(Tags 5555, 9320, 9803)</i><br>execution report<br>("Rejected", "Rejected") |             |                |          |
|     |   |             |                |          |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 35 von 137

INVESTRO/Vestima

| Nr. | positive Auftragseinstellung an INVESTRO/Vestima  | messageflow |                |            |         |
|-----|---|-------------|----------------|------------|---------|
|     |   | FE Customer | BT FIX Gateway | INVESTRO   | Vestima |
| 1   | new order single  |             |                |            | MT502   |
| 2   | <i>Annahmestätigung INVESTRO</i><br>execution report<br>("Pending New", "Pending New")          |             |                |            |         |
| 3   | <i>Annahmestätigung Vestima</i><br>execution report<br>("Pending New", "Pending New")           |             |                | MT509<br>  |         |
| 4   | <i>optional Provision check</i><br>execution report<br>("Pending New", "Pending New")           |             |                | MT509<br>  |         |
| 5   | <i>optional, wenn OHA den Auftrag endgültig bestätigt</i><br>execution report<br>("New", "New") |             |                | MT 509<br> |         |

**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
-

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 37 von 137

**7.2.1.3 Request "NewOrderSingle"**

| Tag | Feldname                     | RF | R | XEOMI | Kommentare   |
|-----|------------------------------|----|---|-------|--|
|     | <standard message header>    | M  | M |       | Tag 35 = "D" (MsgType)   |
|     | <parties>                    | O  | M |       |  |
| 453 | NoPartyIDs                   | O  | M |       | NumInGroup<br>Anzahl der beteiligten Instanzen<br>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, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig<br>Für alle anderen Handelssysteme ignoriert  |
|     | <intermediary>               | O  | O | NNNNO | Daten, die den Vertriebspartner beschreiben, nur für INVESTRO zulässig.  |
|     | <systematic internaliser>    | O  | O | ONNNN | Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben   |
|     | <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<br>Relevant ist nur die TradingSessionSubID<br>alternativ können auch die Einzeltags 336 und 625 geliefert<br>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<br>Account Type Code<br>und Account Type Number<br><u>Möglicher Wertebereich:</u><br><u>P1 – Eigengeschäft der Bank</u><br><u>A1 – Kundengeschäft der Bank</u>  |
| 11  | ClOrdID                      | M  | M |       | String(16)<br>Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom sendenden System vergeben werden muss. Der Identifier muss für die gesamte Lebensdauer der Order eindeutig sein.<br>Wird vom BT-FIX Gateway überprüft   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 38 von 137

| Tag | Feldname  | RF    | R     | XEOMI | Kommentare  |
|-----|-----------|-------|-------|-------|---|
| 21  | HandlInst | M / O | M / O |       | Char<br>für "FIX.4.2" mandatory<br>für "FIX.4.4" optional<br>Instructions for order handling on Broker trading floor<br>Valid values:<br>1 = Automated execution order, private, no Broker intervention<br>2 = Automated execution order, public, Broker intervention OK<br>3 = Manual order, best execution<br>Dieses Tag wird ignoriert           |
| 38  | OrderQty  | O     | M     |       | Qty, Float(12,3)<br>Ordervolumen  |
| 40  | OrdType   | M     | M     |       | Char<br>Zulässig sind<br><br>Xetra<br>1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"<br>4 = "Stop Limit"<br>K = "Market with Leftover"<br>P = "Pegged"<br><br>Xetra Ffm-2, MAX-ONE<br>1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"<br>4 = "Stop Limit"<br><br>XONTRO<br>1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"<br><br>INVESTRO / Vestima<br>1 = "Market" |
| 44  | Price     | C     | C     |       | Price, Float(13,5)<br>Orderlimit, muss bei Limitorders<br>Tag 40 (OrdType) = "2", "4", "P" angegeben sein,<br>darf bei anderen Werten von OrdType nicht<br>angegeben sein.  |
| 54  | Side      | M     | M     |       | Char<br>Seite der Order<br>1 = "Buy"<br>2 = "Sell"  |
| 58  | Text      | O     | O     | OOOOO | String(25)<br>An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2<br>werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 39 von 137

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 40 von 137

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



**FAGSE**

**BT-FIX Gateway**

**Rules of Engagement**

---

| Tag                        | Feldname   | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|----------------------------|------------|----|---|-------|---|
| 5253                       | OrdTypeExt |    | C | NNOON | Char<br>Zulässig sind<br>XONTRO, MAX-ONE<br>E = "EG-Order"<br><br>Besonderheit nur für XONTRO:<br>Das Kennzeichen EG-Order ist bei einer Folgetags-<br>Order nicht erlaubt. |
| <standard message trailer> |            | M  | M |       |   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 42 von 137

**7.2.1.4 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"<br>2 = "locked stock"<br>3 = "response delayed"<br>4 = "order status unknown (end of day)"<br>5 = "verification pending" | -   | -              | -  |
| nur für Aufträge in Vestima Gattungen |                  |   |   |                |  |
| 5048                                  | OrdSubStatus     | D = "provision check negativ"<br>E = "provision check positiv"<br>I = "order entry received in Vestima"                                 | F = "enter confirmation from OHA"           | -              | G = "delete from Vestima"                      |
| 5476                                  | PrivateReference | "Order-Entry received in Vestima"<br>"Provision check"  | "OHA Confirmation - successful Order-Entry" | -              | Text von Vestima (Erläuterung zu der Löschung) |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 43 von 137

**7.2.1.5 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 | XEOMI | Kommentare   |
|---------------------------|------------|----|---|-------|--|
| <standard message header> |            | M  | M |       | Tag 35 = "8" (MsgType)   |
| <parties>                 |            | O  | M |       |  |
| 453                       | NoPartyIDs | O  | M |       | NumInGroup<br>Anzahl der beteiligten Instanzen<br>Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt<br>Nur die Werte 2 – 4 können vorkommen  |
| <entering firm>           |            | O  | M |       | Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben  |
| <executing firm>          |            | O  | O | MMMMM | Daten, die den Orderaufgeber beschreiben   |
| <market maker>            |            | O  | O | NOOOO | Daten, die den Orderempfänger beschreiben, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig   |
| <intermediary>            |            | O  | O | NNNNO | Daten, die den Vertriebspartner beschreiben, nur für INVESTRO zulässig.  |
| <systematic internaliser> |            | O  | O | ONNNN | Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben   |
| end <parties>             |            |    |   |       |  |
| <instrument>              |            | M  | M |       | Zu handelndes Instrument als ISIN  |
| 1                         | Account    | O  | O | MMOMO | String(2), aufgebaut aus<br>Account Type Code und Account Type Number<br><br>Wenn in der Request-Nachricht nicht vorhanden werden von den Handels- bzw. Abwicklungssystemen Defaultwerte gesetzt   |
| 6                         | AvgPx      | M  | M |       | Schnittpreis, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt   |
| 11                        | ClOrdID    | O  | M |       | String(16)<br>Eindeutiger Identifier des Auftrags  |
| 14                        | CumQty     | M  | M |       | Qty, Float(12,3)<br>Gesamtausführungsmenge, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt   |
| 17                        | ExecID     | M  | M |       | String<br>eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig   |
| 37                        | OrderID    | M  | M |       | String(13)<br>Eindeutige Ordernummer des Handels- bzw. Abwicklungssystems<br><br>Wenn keine Ordernummer vorhanden wird "[N/A]" geliefert.<br>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)<br>Ordervolumen   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 44 von 137

| Tag | Feldname      | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|-----|---------------|----|---|-------|---|
| 39  | OrdStatus     | M  | M |       | Char<br>OrderStatus<br><br>0 = "New"<br>Einstellung endgültig positiv<br><br>A = "Pending New"<br>Einstellung vorläufig angenommen<br>(genauere Information über das Tag 5946 –<br>PendingReason)<br><br>8 = "Rejected"<br>Einstellung abgelehnt<br><br>Vestima<br>4 = "Cancelled"<br>Ablehnung eines Auftrags durch Vestima-Depotbank<br>(wird als Auftragslöschung übermittelt)   |
| 40  | OrdType       | O  | M |       | Char<br>Ordertyp  |
| 44  | Price         | C  | C |       | Price, Float(13,5)<br>Limit der Order<br>Orderlimit, wird für OrdType "2", "4" und "P" belegt   |
| 54  | Side          | M  | M |       | Char<br>Seite der Order<br>1 = Buy<br>2 = Sell  |
| 58  | Text          | O  | O | OOOOO | String(25)<br>An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden<br>nur die ersten 12 Stellen weitergegeben<br>Textfeld   |
| 59  | TimeInForce   | O  | M |       | Char  |
| 60  | TransactTime  | O  | M |       | UTC Timestamp<br>[microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss]<br>Zeitstempel des Handels- bzw. Abwicklungssystems  |
| 99  | StopPx        | C  | O | CCCCN | Price, Float(13,5)<br>Stop Limit, wird für OrdType "3" und "4" belegt   |
| 100 | ExDestination | O  | M |       | Exchange<br>MIC Code<br>Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt  |
| 110 | MinQty        | O  | O | CNNNN | Qty, Float(12,3)<br>Minimal auszuführendes Volumen<br>wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt   |
| 150 | ExecType      | M  | M |       | Char<br>Art des Report<br><br>0 = "New"<br>Einstellung endgültig positiv<br><br>A = "Pending New"<br>Einstellung vorläufig angenommen<br>(genauere Information über das Tag 5946 –<br>PendingReason)<br><br>8 = "Rejected"<br>Einstellung abgelehnt<br><br>INVESTRO<br>I = "OrderStatus"<br>Nachricht an den Auftragsempfänger bei einer positiven<br>Einstellung (OrdStatus "New") |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 45 von 137

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 46 von 137

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 47 von 137

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

**7.2.2 Order- bzw. Auftragslöschung****7.2.2.1 Abläufe – Orders**

| Nr. | Orderlöschung positiv  | messageflow |                |               |
|-----|--|-------------|----------------|---------------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | Handelssystem |
| 1   | order cancel ("CIOrdID", "OrigCIOrdID")                                  |             |                |               |
|     | <i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i> |             |                |               |
| 2   | execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")                    |             |                |               |
|     | <i>endgültige Bestätigung positiv</i>                                    |             |                |               |
| 3   | execution report ("Canceled", "Canceled")                                |             |                |               |

| Nr. | Orderlöschung negativ   | messageflow |                |               |
|-----|---|-------------|----------------|---------------|
|     |   | FE Customer | BT FIX Gateway | Handelssystem |
| 1   | order cancel ("CIOrdID", "OrigCIOrdID")   |             |                |               |
|     | <i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i>            |             |                |               |
| 2   | execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")                               |             |                |               |
|     | <i>endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)</i> |             |                |               |
| 3   | order cancel reject ("Rejected")  |             |                |               |



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 49 von 137

| Nr. | Orderlöschung ohne endgültige Bestätigung  | messageflow |                |               |
|-----|--|-------------|----------------|---------------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | Handelssystem |
| 1   | order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")  |             |                |               |
| 2   | optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)<br>execution report ("Pending Cancel", "Pending Cancel")                           |             |                |               |
|     |  |             |                |               |
| 3   | Tagesende: vorläufige Bestätigung mit PendingReason 4 = "order status unknown (end of day)"<br>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 endgültig, aber aus technischen Gründen vorübergehend zurückgestellt ist. Der endgültige Execution Report der Bestätigung "Replace" oder "Canceled" folgt.

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 50 von 137

**7.2.2.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)**INVESTRO "classic"

| Nr. | Auftragslöschung positiv  | messageflow |                |          |
|-----|---|-------------|----------------|----------|
|     |   | FE Customer | BT FIX Gateway | INVESTRO |
| 1   | order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")   |             |                |          |
| 2   | <i>endgültige Bestätigung positiv</i><br>execution report<br>("Canceled", "Canceled")         |             |                |          |
|     |   |             |                |          |
| 3   | <i>Nachricht an den Auftragsempfänger</i><br>execution report<br>("Order Status", "Canceled") |             |                |          |
|     |   |             |                |          |

| Nr. | Auftragslöschung negativ   | messageflow |                |          |
|-----|--|-------------|----------------|----------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | INVESTRO |
| 1   | order cancel ("ClOrdID", "OrigClOrdID")  |             |                |          |
| 2   | <i>endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation</i><br><i>(Tags 5555, 9320, 9803)</i><br>order cancel reject<br>("Rejected") |             |                |          |
|     |  |             |                |          |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 51 von 137

INVESTRO/Vestima

| Nr. | positive Auftragslöschung an INVESTRO/Vestima  | messageflow |                |          |         |
|-----|--|-------------|----------------|----------|---------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | INVESTRO | Vestima |
| 1   | ordercancel<br>("ClOrdID", "OrigClOrdID")  |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          | MT502   |
| 2   | <i>Annahmestätigung INVESTRO</i><br>execution report<br>("Pending Cancel", "Pending Cancel") |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          |         |
| 3   | <i>Validierung Vestima</i><br>execution report<br>("Pending Cancel", "Pending Cancel")       |             |                | MT509    |         |
|     |  |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          |         |
| 4   | <i>Bestätigung der Löschung durch OHA</i><br>execution report<br>("Canceled", "Canceled")    |             |                | MT509    |         |
|     |  |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          |         |

| Nr. | negative Auftragslöschung an INVESTRO/Vestima  | messageflow |                |          |         |
|-----|--|-------------|----------------|----------|---------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | INVESTRO | Vestima |
| 1   | ordercancel<br>("ClOrdID", "OrigClOrdID")  |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          | MT502   |
| 2   | <i>Annahmestätigung INVESTRO</i><br>execution report<br>("Pending Cancel", "Pending Cancel") |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          |         |
| 3   | <i>Validierung Vestima</i><br>execution report<br>("Pending Cancel", "Pending Cancel")       |             |                | MT509    |         |
|     |  |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          |         |
| 4   | <i>Ablehnung der Löschung durch OHA</i><br>execution report<br>("Rejected", "Rejected")      |             |                | MT509    |         |
|     |  |             |                |          |         |
|     |  |             |                |          |         |

---

**Anmerkungen zum Messageflow:**

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.

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

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

**Nr. 3:** Auftragslöschung in Vestima empfangen

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

---

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 53 von 137

**7.2.2.3 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 | XEOMI | Kommentare   |
|-----|------------------------------|----|---|-------|--|
|     | <standard message header>    | M  | M |       | Tag 35 = "F" (MsgType)   |
|     | <parties>                    | O  | M |       |  |
| 453 | NoPartyIDs                   | O  | M |       | NumInGroup<br>Anzahl der beteiligten Instanzen<br>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 | OOOOO | Daten, die den Orderaufgeber beschreiben, fehlt die Gruppe, dann werden die Daten des Anschlussinhabers für die Transformationen verwendet   |
|     | <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  |
|     | <OrderAttributes>            | O  | O | NNOON | Repeating Group für Order-Attribute  |
| 11  | ClOrdID                      | M  | M |       | String(16)<br>Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom sendenden System vergeben werden muss. Der Identifier muss für die gesamte Lebensdauer der Order eindeutig sein.<br>Wird vom BT-FIX Gateway geprüft |
| 37  | OrderID                      | O  | C |       | String(13)<br>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)<br>Ordervolumen<br><br>Dieses Tag wird ignoriert  |
| 41  | OrigClOrdID                  | M  | M |       | String(16)<br>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<br>Seite der Order<br>1 = "Buy"<br>2 = "Sell"<br>MAX-ONE akzeptiert einen Cancel Request auch bei einer falschen, aber formal korrekten Angabe  |
| 60  | TransactTime                 | M  | M |       | UTC Timestamp<br>Zeitstempel des sendenden Systems oder des Orderaufgebers<br><br>Dieses Tag wird ignoriert  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 54 von 137

| Tag                        | Feldname      | RF | R  | XEOMI | Kommentare   |
|----------------------------|---------------|----|----|-------|--|
| 100                        | ExDestination |    | O  | OOOOO | Exchange<br>MIC Code   |
| 5253                       | OrdTypeExt    |    | OC | COOOO | Char<br>Alternativer Ordertyp<br>Ist für XONTRO, MAX-ONE oder INVESTRO ein Wert<br>angegeben, dann wird er ignoriert. Der Request wird<br>akzeptiert.<br>Wird für Xetra Ffm-2 ein Wert angegeben, muss er mit<br>dem Wert der Order übereinstimmen, das Tag ist jedoch<br>optional<br>Wird für Xetra ein Wert angegeben, muss er ebenfalls<br>mit dem Wert der Order übereinstimmen.<br>Ist die Order vom Typ "Stop", "Stop Limit", "Midpoint"<br>oder "Iceberg" muss das Tag belegt sein<br><br>Zulässig sind<br>Xetra:<br>1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"<br>4 = "Stop Limit"<br>K = "Market with Leftover"<br>M = "Midpoint"<br>I = "Iceberg"<br>Xetra Ffm-2<br>1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"<br>4 = "Stop Limit" |
| 6042                       | CxlReason     | O  | O  | NNOON | Integer<br>Kennzeichnung einer Orderlöschung durch Kill-<br>Funktionalität (MIFID II).<br>1 = Cancel durch Kill-Funktion   |
| <standard message trailer> |               | M  | M  |       |  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 55 von 137

**7.2.2.4 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv, negativ von Vestima)**

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 56 von 137

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



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 57 von 137

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 58 von 137

**7.2.2.5 Response "Order Cancel Reject" (endgültig negativ)**

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

| Tag  | Feldname                   | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|------|----------------------------|----|---|-------|---|
|      | <standard message header>  | M  | M |       | Tag 35 = "9" (MsgType)  |
|      | <parties>                  |    | M |       |   |
| 453  | NoPartyIDs                 |    | M |       | NumInGroup<br>Anzahl der beteiligten Instanzen<br>Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt<br><br>Nur der Wert 2 kann vorkommen      |
|      | <entering firm>            |    | M |       | Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben   |
|      | <executing firm>           |    | O | OOOOO | Daten, die den Orderaufgeber beschreiben  |
|      | end <parties>              |    |   |       |   |
| 11   | ClOrdID                    | M  | M |       | String(16)<br>Eindeutiger Identifier des Auftrags<br>Der im Cancel Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben  |
| 37   | OrderID                    | M  | M |       | String(13)<br>Eindeutige Ordernummer des Handels- bzw. Abwicklungssystems<br>Das Tag kann fehlen oder mit [N/A] belegt sein   |
| 39   | OrdStatus                  | M  | M |       | Char<br>OrderStatus<br>wird mit 8 = "Rejected" belegt   |
| 41   | OrigClOrdID                | M  | M |       | String(16)<br>Der im Cancel Request gelieferte Wert wird wieder zurückgegeben   |
| 60   | TransactTime               | O  | M |       | UTC Timestamp<br>Zeitstempel des Handels bzw. Abwicklungssystems  |
| 100  | ExDestination              |    | M |       | Exchange<br>MIC Code<br>Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt  |
| 102  | CxlRejReason               | O  | M |       | Integer<br>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<br>1 = "Order Cancel Request"  |
| 5555 | ReturnCode                 |    | M |       | Integer<br>Returncode   |
| 9320 | OrderRejectReasonTxt       |    | M |       | String<br>Fehlertext des Handels- bzw. Abwicklungssystems   |
| 9803 | TradingSystemID            |    | M |       | Integer<br>Identifiziert das System, welches den Returncode erzeugt hat   |
|      | <standard message trailer> | M  | M |       |   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 59 von 137

**7.2.3 Order- bzw. Auftragsänderung****7.2.3.1 Abläufe – Orders**

| Nr. | Orderänderung positiv  | messageflow |                |               |
|-----|--|-------------|----------------|---------------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | Handelssystem |
| 1   | order cancel/replace<br>("CLOrdID", "OrigCLOrdID")                           |             |                |               |
|     | <i>optional: vorläufige Bestätigung(en)<br/>mit PendingReason (Tag 5946)</i> |             |                |               |
| 2   | execution report<br>("Pending Replace", "Pending Replace")                   |             |                |               |
|     | <i>endgültige Bestätigung positiv</i>  |             |                |               |
| 3   | execution report<br>("Replace", aktueller Orderstatus)                       |             |                |               |

| Nr. | Orderänderung negativ   | messageflow |                |               |
|-----|---|-------------|----------------|---------------|
|     |   | FE Customer | BT FIX Gateway | Handelssystem |
| 1   | order cancel/replace<br>("CLOrdID", "OrigCLOrdID")  |             |                |               |
|     | <i>optional: vorläufige Bestätigung(en)<br/>mit PendingReason (Tag 5946)</i>                |             |                |               |
| 2   | execution report<br>("Pending Replace", "Pending Replace")                                  |             |                |               |
|     | <i>endgültige Bestätigung negativ mit<br/>Fehlerinformation<br/>(Tags 5555, 9320, 9803)</i> |             |                |               |
| 3   | order cancel reject<br>("Rejected")   |             |                |               |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 60 von 137

| Nr. | Orderänderung ohne endgültige Bestätigung  | messageflow |                |               |
|-----|--|-------------|----------------|---------------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | Handelssystem |
| 1   | order cancel/replace<br>("CLOrdID", "OrigCLOrdID")   |             |                |               |
|     |  |             |                |               |
| 2   | <i>optional: vorläufige Bestätigung(en) mit PendingReason (Tag 5946)</i><br>execution report<br>("Pending Replace", "Pending Replace")                           |             |                |               |
|     |  |             |                |               |
| 3   | <i>Tagesende: vorläufige Bestätigung mit PendingReason 4 = "order status unknown (end of day)"</i><br>execution report<br>("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 endgültig, aber aus technischen Gründen vorübergehend 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<br>("CLOrdID", "OrigCLOrdID")   |             |                |          |
|     |  |             |                |          |
| 2   | <i>endgültige Bestätigung negativ mit Fehlerinformation (Tags 5555, 9320, 9803)</i><br>order cancel reject<br>("Rejected") |             |                |          |
|     |  |             |                |          |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 61 von 137

**7.2.3.3 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 | XEOMI | Kommentare  |
|------------------------------|------------|----|---|-------|---|
| <standard message header>    |            | M  | M |       | Tag 35 = "G" (MsgType)  |
| <parties>                    |            | O  | M |       |   |
| 453                          | NoPartyIDs | O  | M |       | NumInGroup<br>Anzahl der beteiligten Instanzen<br>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 | MMMM- | Daten, die den Orderaufgeber beschreiben, fehlt die Gruppe, dann werden die Daten des Anschlussinhabers für die Transformationen verwendet  |
| <market maker>               |            | O  | O | NOOO- | Daten, die den Orderempfänger beschreiben, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig<br>Wird für alle anderen Handelssysteme ignoriert  |
| <systematic internaliser>    |            | O  | O | ONNN- | Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben  |
| <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 | ONOO- | Trading Session Information<br>Relevant ist nur die TradingSessionSubID<br>alternativ können auch die Einzeltags 336 und 625 geliefert werden<br>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.  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 62 von 137

| Tag | Feldname  | RF    | R     | XEOMI | Kommentare  |
|-----|-----------|-------|-------|-------|---|
| 1   | Account   | O     | O     | MMNN- | String(2),<br>aufgebaut aus Account Type Code und Account Type<br>Number<br>Nicht änderbar<br><b>Möglicher Wertebereich:</b><br><b>P1 – Eigengeschäft der Bank</b><br><b>A1 – Kundengeschäft der Bank</b>   |
| 11  | ClOrdID   | M     | M     |       | String(16)<br>Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom sendenden<br>System vergeben werden muss. Der Identifier muss für<br>die gesamte Lebensdauer der Order eindeutig sein.<br>Wird vom BT-FIX Gateway geprüft  |
| 21  | HandlInst | M / O | M / O |       | Char<br>für "FIX.4.2" mandatory<br>für "FIX.4.4" optional<br><br>Instructions for order handling on Broker trading floor<br>Valid values:<br>1 = Automated execution order, private, no Broker<br>intervention<br>2 = Automated execution order, public, Broker<br>intervention OK<br>3 = Manual order, best execution<br><br>Dieses Tag wird ignoriert             |
| 37  | OrderID   | O     | C     |       | String(13)<br>Ordernummer des Handelssystems<br>nicht änderbar<br>kann zur Identifikation einer Order verwendet werden,<br>die OrigClOrdID muss in diesem Fall auf "[N/A]" gesetzt<br>sein  |
| 38  | OrderQty  | O     | M     |       | Qty, Float(12,3)<br>Ordervolumen incl. ausgeführter Menge<br>Bei XONTRO und MAX-ONE entspricht dies der<br>Ursprungsnominalen.<br>Eine Änderung der Qty ist nicht möglich.<br><br>XONTRO<br>Der Request wird abgelehnt wenn die OrderQty und die<br>Ursprungsnominale der Order nicht übereinstimmen.<br><br>Xetra, Xetra Ffm-2, MAX-ONE<br>Das Tag wird ignoriert. |
| 40  | OrdType   | M     | M     |       | Char<br>Zulässig sind<br>Xetra:<br>1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"<br>4 = "Stop Limit"<br>K = "Market with Leftover"<br>P = "Pegged"<br>Xetra Ffm-2, MAX-ONE<br>1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"<br>4 = "Stop Limit"<br>XONTRO<br>1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 63 von 137

| Tag  | Feldname         | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|------|------------------|----|---|-------|---|
| 41   | OrigClOrdID      | M  | M |       | String(16)<br>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)<br>Orderlimit, muss bei Limitorders Tag 40 (OrdType) = "2", "4", "P" angegeben sein  |
| 54   | Side             | M  | M |       | Char<br>Seite der Order<br>1 = "Buy"<br>2 = "Sell"<br>nicht änderbar  |
| 58   | Text             | O  | O | OOOO- | String(25)<br>An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben  |
| 59   | TimeInForce      | O  | O | OOOO- | Char<br>Zulässig ist:<br><br>6 = Good till Date<br><br>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<br>Zeitstempel des sendenden Systems oder des Orderaufgebers.<br><br>Dieses Tag wird ignoriert  |
| 99   | StopPx           | O  | O | CCCC- | Price, Float(13,5)<br>Stop Limit, muss bei Stop Orders Tag 40 (OrdType) = "3", "4" angegeben sein   |
| 100  | ExDestination    | O  | O | OOOO- | Exchange<br>MIC Code<br>nicht änderbar  |
| 432  | ExpireDate       | O  | C |       | LocalMktDate<br>Ordergültigkeit bis, bei Änderungen der Ordergültigkeit anzugeben, siehe Tag 59   |
| 526  | SecondaryClOrdID | O  | O | OOOO- | String(16)<br>Bankinterne Ordernummer<br><br>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 |
| 1094 | PegPriceType     |    | O | CNNN- | Integer<br>Nur für Xetra Midpoint Orders anzugeben:<br>2 = "Mid-price peg"  |
| 1138 | DisplayQty       |    | O | CNNN- | Qty, Float(12,3)<br>Nur für Xetra Iceberg Orders anzugeben, maximal sichtbares Volumen  |
| 1724 | OrderOrigination | O  | O | NNOON | Integer<br>Kennzeichen für DEA (Direct Electronic Access). (ESMA RTS 24, Feld 2)<br>5 = DEA (Direct Electronic Access)<br>Fehlendes Tag bedeutet „kein DEA“.  |
| 5689 | VersionID        |    | O | OONN- | Integer(18)<br><br>Xetra, Xetra Ffm-2<br>Schlüssel zur Updatekontrolle  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 64 von 137

| Tag                        | Feldname      | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|----------------------------|---------------|----|---|-------|---|
| 6126                       | OrigLeavesQty |    | O | NNOO- | Qty, Float(12,3)<br>Noch ausführbare Menge zur Updatekontrolle<br>Wird eine Prüfung der noch ausführbaren Nominale der Order gewünscht dann, dann muss diese im Tag 6126 mitgegeben werden (nur XONTRO)<br>Ansonsten ist das Tag nicht erforderlich |
| <standard message trailer> |               | M  | M |       |   |

**7.2.3.4 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 | XEOMI | Kommentare   |
|---------------------------|------------|----|---|-------|--|
| <standard message header> |            | M  | M |       | Tag 35 = "8" (MsgType)   |
| <parties>                 |            | O  | M |       |  |
| 453                       | NoPartyIDs | O  | M |       | NumInGroup<br>Anzahl der beteiligten Instanzen<br>Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt<br>Nur die Werte 2 – 3 können vorkommen  |
| <entering firm>           |            | O  | M |       | Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben  |
| <executing firm>          |            | O  | O | OOOO- | Daten, die den Orderaufgeber beschreiben   |
| <market maker>            |            | O  | O | NOOO- | Daten, die den Orderempfänger beschreiben, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig   |
| end <parties>             |            |    |   |       |  |
| <instrument>              |            | M  | M |       | Zu handelndes Instrument als ISIN  |
| 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)<br>Eindeutiger Identifier des Auftrags- Aus dem Order Cancel/Replace Request übernommen   |
| 14                        | CumQty     | M  | M |       | Qty, Float(12,3)<br>Gesamtausführungsmenge   |
| 17                        | ExecID     | M  | M |       | String<br>eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig   |
| 37                        | OrderID    | M  | M |       | String(13)<br>Eindeutige Ordernummer des Handelssystems<br><br>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)<br>Ordervolumen   |



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 65 von 137

| Tag | Feldname         | RF | R | XEOMI | Kommentare   |
|-----|------------------|----|---|-------|--|
| 39  | OrdStatus        | M  | M |       | Char<br>OrderStatus<br><br>0 = „New“<br>Änderung durchgeführt (endgültig)<br>wird je nach Status der Order belegt<br><br>Änderung vorläufig angenommen<br>E = "Pending Replace"<br>(genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason)  |
| 40  | OrdType          | O  | M |       | Char<br>Ordertyp   |
| 41  | OrigClOrdID      | O  | M |       | String(16)<br>Aus dem Request kopiert<br>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)<br>Limit der Order  |
| 54  | Side             | M  | M |       | Char<br>Seite der Order  |
| 58  | Text             | O  | O | OOOO- | String(25)<br>An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben<br>Textfeld   |
| 59  | TimeInForce      | O  | O | MMOO- | Char   |
| 60  | TransactTime     | O  | M |       | UTC Timestamp<br>[microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss]<br>Zeitstempel des Handelssystems   |
| 99  | StopPx           | C  | O | CCCC- | Price, Float(13,5)<br>Stop Limit   |
| 100 | ExDestination    |    | M |       | Exchange<br>MIC Code<br>Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt   |
| 150 | ExecType         | M  | M |       | Char<br>Art des Report<br><br>Änderung durchgeführt (endgültig)<br>5 = "Replace"<br><br>Änderung vorläufig angenommen<br>E = "Pending Replace"<br>(genauere Information über das Tag 5946 – PendingReason)                                   |
| 151 | LeavesQty        | M  | M |       | Qty, Float(12,3)<br>offene Menge der Order   |
| 336 | TradingSessionID | O  | O | ONOO- | String(1)<br>immer mit Tag 625 zusammen verwendet<br>"1" oder fehlend  |
| 432 | ExpireDate       | O  | C |       | LocalMktDate<br>Ordergültigkeit bis  |
| 526 | SecondaryClOrdID | O  | O | OOOO- | String(16)<br>Bankinterne Ordernummer  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 66 von 137

| Tag                        | Feldname            | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|----------------------------|---------------------|----|---|-------|---|
| 625                        | TradingSessionSubID | O  | O | CNCC- | String<br>immer mit Tag 336 zusammen verwendet  |
| 1094                       | PegPriceType        |    | O | CNNN- | Integer<br>Nur für Xetra Midpoint Orders  |
| 1138                       | DisplayQty          |    | O | CNNN- | Qty, Float(12,3)<br>Nur für Xetra Iceberg Orders, maximal sichtbares Volumen  |
| 5689                       | VersionID           |    | O | MMNN- | Integer(18)<br>Schlüssel zur Updatekontrolle  |
| 5946                       | Pending Reason      |    | O | CCCCC | String<br>das BT-FIX Gateway liefert immer Integer(1)<br><br>Das Feld ist nur bei vorläufigen Bestätigungen ("Pending Replace" - OrdStatus = E, ExecType = E) belegt<br><br>1 = "buffered"<br>Orderänderung wegen nicht verfügbarem Handelssystem vorgehalten (Xetra, Xetra Ffm-2)<br><br>2 = "locked stock"<br>Orderänderung wegen Orderbuchsperrung (XONTRON, MAX-ONE) bzw. wegen Locked-Stock (Xetra, Xetra Ffm-2) vorgehalten.<br><br>3 = "response delayed (intraday)"<br>keine Bestätigung vom Handelssystem innerhalb eines bestimmten, konfigurierbaren Zeitintervalls empfangen (Xetra, Xetra Ffm-2)<br><br>4 = "order status unknown (end of day)"<br>Bis Ende des Handelstages wurde keine endgültige Bestätigung (positiv oder negativ) zu der Orderänderung erhalten. Der Orderstatus ist unbekannt. |
| <standard message trailer> |                     | M  | M |       |   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 67 von 137

**7.2.3.5 Response "Order Cancel Reject" (endgültig negativ)**

Statt eines Execution Reports wird ein Order Cancel Reject versendet.

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

**7.2.4 Order- bzw. Auftragsausführung****7.2.4.1 Abläufe – Orders**

| Nr. | Teilausführung   | messageflow    |                   |               |
|-----|--|----------------|-------------------|---------------|
|     |  | FE<br>Customer | BT FIX<br>Gateway | Handelssystem |
| 1   | <i>Teilausführung</i><br>execution report<br>("Trade", "Partially Filled") |                | ← ●               | ← ●           |

| Nr. | Vollausführung   | messageflow    |                   |               |
|-----|--|----------------|-------------------|---------------|
|     |  | FE<br>Customer | BT FIX<br>Gateway | Handelssystem |
| 1   | <i>Vollausführung</i><br>execution report<br>("Trade", "Filled") |                | ← ●               | ← ●           |

**7.2.4.2 Abläufe – Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima)**INVESTRO "classic"

| Nr. | Vollausführung   | messageflow |                |          |
|-----|--|-------------|----------------|----------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | INVESTRO |
| 1   | <i>Vollausführung</i><br>execution report ("Trade", "Filled")                            |             |                | ←●       |
|     |  |             | ←●             |          |
| 2   | <i>Nachricht an den Auftragsempfänger</i><br>execution report ("Order Status", "Filled") |             |                | ←●       |
|     |  |             | ←●             |          |

INVESTRO/Vestima

| Nr. | Auftragsausführung und Storno  | messageflow |                |          |         |
|-----|--|-------------|----------------|----------|---------|
|     |  | FE Customer | BT FIX Gateway | INVESTRO | Vestima |
| 1   | <i>Auftragsausführung</i><br>execution report ("Trade"; "Filled")                |             |                | MT 515   | ←●      |
|     |  |             | ←●             | ←●       |         |
| 2   | <i>Stornierung Auftragsausführung</i><br>execution report ("Restated", "Filled") |             |                | MT 515   | ←●      |
|     |  |             | ←●             | ←●       |         |
| 3   | <i>neue Auftragsausführung</i><br>execution report ("Restated", "Filled")        |             |                | MT515    | ←●      |
|     |  |             | ←●             | ←●       |         |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 70 von 137

**7.2.4.3 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 | XEOMI | Kommentare   |
|-----|---------------------------|----|---|-------|--|
|     | <standard message header> | M  | M |       | Tag 35 = "8" (MsgType)   |
|     | <parties>                 | O  | M |       |  |
| 453 | NoPartyIDs                | O  | M |       | NumInGroup<br>Anzahl der beteiligten Instanzen<br>Wird vom GW entsprechend der Anzahl der beteiligten Repeating Groups belegt<br>Nur die Werte 1 –3 können vorkommen   |
|     | <entering firm>           | O  | M |       | Daten, die den Anschlussinhaber beschreiben  |
|     | <executing firm>          | O  | O | OOOOO | Daten, die den Orderaufgeber beschreiben   |
|     | <market maker>            | O  | O | NOOOO | Daten, die den Orderempfänger beschreiben, nur für XONTRO und MAX-ONE zulässig   |
|     | <systematic internaliser> | O  | O | ONNNN | Daten, die einen Xetra Best Executor beschreiben   |
|     | end <parties>             |    |   |       |  |
|     | <instrument>              | M  | M |       | Zu handelndes Instrument als ISIN  |
|     | <RegulatoryTradeIDGrp>    | O  | O | NNMMN | TVTIC (Trading venue transaction identifier)   |
| 6   | AvgPx                     | M  | M |       | Schnittpreis, vom BT-FIX Gateway auf "0" gesetzt   |
| 11  | ClOrdID                   | O  | M |       | String(16)<br>Eindeutiger Identifier eines Requests.<br>Eingesetzt wird der Wert, der im letzten für diese Order erfolgreichen FIX Request geliefert wurde<br><br>Vestima<br>Bei Nachrichten mit Tag 150 (ExecType) D (Restated) enthält die ClOrdID immer "[N/A]" |
| 14  | CumQty                    | M  | M |       | Qty, Float(12,3)<br>Gesamtausführungsmenge   |
| 15  | Currency                  | O  | O | OOOOO | Currency<br>Handels-Währung am gehandelten Börsenplatz   |
| 17  | ExecID                    | M  | M |       | String<br>eindeutiger Schlüssel des Auftrags, ist über den Handelstag hinweg eindeutig   |
| 31  | LastPx                    | M  | M |       | Price, Float(13,5)<br>Preis der Ausführung   |
| 32  | LastQty                   | M  | M |       | Qty, Float(12,3)<br>Volumen der Ausführung   |
| 37  | OrderID                   | M  | M |       | String(13)<br>Eindeutige Ordnernummer des Handels- bzw. Abwicklungssystems   |
| 38  | OrderQty                  | O  | M |       | Qty, Float(12,3)<br>Ordervolumen (Gesamtvolumen der Order)   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 71 von 137

| Tag | Feldname      | RF | R | XEOMI | Kommentare   |
|-----|---------------|----|---|-------|--|
| 39  | OrdStatus     | M  | M |       | Char<br>OrderStatus<br><br>XONTRO, MAX-ONE, Xetra, Xetra Ffm-2<br>1 = "Partially Filled" Teilausführung<br>2 = "Filled" Vollauführung<br><br>INVESTRO / Vestima<br>2 = "Filled" Vollauführung<br>(Teilausführungen sind nicht möglich)   |
| 44  | Price         | C  | O | CCCNN | Price, Float(13,5)<br>Limit der Order, wird für OrdType "2", "4" und "P" belegt.<br>Fehlt für das Handelssystem MAX-ONE  |
| 54  | Side          | M  | M |       | Char<br>Seite der Order<br>1 = "Buy"<br>2 = "Sell"   |
| 59  | TimelnForce   | O  | M |       | Char   |
| 60  | TransactTime  | O  | M |       | UTC Timestamp<br>[microseconds YYYYMMDD-HH:MM:SS.ssssss]<br>Zeitstempel des Handels- bzw. Abwicklungssystems   |
| 64  | SettlDate     | O  | O | NNOOO | LocalMktDate<br><br>XONTRO, MAX-ONE<br>Valutadatum bei Ausführungen, die vor dem<br>Emissionstermin erfolgen.<br><br>INVESTRO / Vestima<br>SettlementDate von Vestima.<br><br>Xetra, Xetra Ffm-2<br>Das Feld wird nicht geliefert  |
| 99  | StopPx        | C  | C |       | Price, Float(13,5)<br>Stop Limit, wird für OrdType "3" und "4" belegt  |
| 100 | ExDestination |    | M |       | Exchange<br>MIC Code<br>Das Tag wird vom BT-FIX Gateway immer versorgt   |
| 110 | MinQty        | O  | O | CNNNN | Qty, Float(12,3)<br>Minimal auszuführendes Volumen<br>wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt  |
| 150 | ExecType      | M  | M | MMMMC | Char<br>Art des Report<br><br>alle Systeme<br>das Feld mit F = "Trade" belegt<br>(Nachrichten an den Orderaufgeber)<br><br>INVESTRO classic<br>Bei Nachrichten an den Auftragsempfänger wird das<br>Feld mit I = "OrderStatus" belegt<br><br>Vestima<br>wird in folgenden Fällen mit D = "Restated" belegt:<br>- zur Kennzeichnung der Stornierung einer<br>Auftragsausführung durch Vestima<br>oder<br>- zur Kennzeichnung einer Auftragsausführung von<br>Vestima nach dem einer vorherigen Ausführung storniert<br>wurde<br>Bei ExecType = D wird das Tag 11 (ClOrdID) mit "[N/A]"<br>belegt. |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 72 von 137

| Tag                        | Feldname                      | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|----------------------------|-------------------------------|----|---|-------|---|
| 151                        | LeavesQty                     | M  | M |       | Qty, Float(12,3)<br>offene Menge der Order bei Teilausführung<br>0 bei Vollauführung  |
| 157                        | NumDaysInterest               | O  | O | OOOON | Integer<br>Stückzinstage<br>analog FIX 4.4 Tag 157 auch für FIX.4.2   |
| 432                        | ExpireDate                    | O  | M |       | LocalMktDate<br>Ordergültigkeit bis   |
| 526                        | SecondaryClOrdID              | O  | O | OOOOO | String(16)<br>Bankinterne Ordernummer   |
| 1094                       | PegPriceType                  |    | O | CNNNN | Integer<br>wird nur für Midpoint Orders (OrdType "P") belegt  |
| 1138                       | DisplayQty                    |    | O | CNNNN | Qty, Float(12,3)<br>Nur für Xetra Iceberg Orders, maximal sichtbares<br>Volumen   |
| 5048                       | OrdSubStatus                  |    | O | NNNNC | Char<br><br>Nur für INVESTRO / Vestima<br>"H" = disabled für die "Kennzeichnung der (Vestima-)<br>Stornierung einer Auftragsausführung".<br>In diesem Fall ist Tag 150 (ExecType) = D.<br>Das Tag 11 (ClOrdID) wird mit [N/A] belegt. |
| 5689                       | VersionID                     |    | O | MMNNN | Integer(18)<br><br>Xetra, Xetra Ffm-2<br>Schlüssel zur Updatekontrolle  |
| 5944                       | InitialDisplayQty             |    | O | CNNNN | Qty, Float(12,3)<br>Enthält für Iceberg Orders das ursprünglich eingestellte,<br>maximal sichtbare Volumen  |
| 6584                       | SpreadPctPremium              |    | O | NNNNO | Float(5,3)<br>Bonifikationssatz   |
| 6585                       | SpreadPctDiscount             |    | O | NNNNO | Float(10,7)<br>Wiederanlagerabatt in Prozent  |
| 6611                       | TotalAccruedInterestAmt       |    | O | NNNNO | Float(17,8)<br>Akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag   |
| 6893                       | Profit                        |    | O | NNNNO | Float(15,8)<br>Zwischengewinn   |
| 7491                       | CustomPrice1                  |    | O | NNNNO | Float(15,8)<br>Ausgabepreis<br>Wird nur belegt wenn bei der Auftrags-Aufgabe die Tags<br>5076 oder 5078 belegt waren.   |
| 7680                       | OTCInd                        |    | M |       | Integer<br>Kennzeichen börslich<br>0 = börslich<br>1 = außerbörslich  |
| 9583                       | MIFIDInternalizationIndicator |    | O | OONNN | Char<br>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 XONTRO, INVESTRO, MAX-ONE
- Systemanschluss Makler XONTRO
- 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. Abwicklungssystem 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 7.2.1.5 Response "Execution Report" - Nachrichtendaten
- Orderänderung 7.2.3.4 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv)
- Orderlöschung 7.2.2.4 Response "Execution Report" (vorläufig, endgültig positiv, negativ von Vestima)

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 74 von 137

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 75 von 137

**7.2.5.3 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. 7.2.3.4) 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 | XEOMI | Kommentare  |
|--|-------------------------------|----|---|-------|---|
| Im <parties> Component Block (Tag 453 wird erhöht) |                               |    |   |       |   |
| 448  | <executing system><br>PartyID |    | M |       | String<br>mögliche Werte sind<br>XETRA<br>XETRA-2<br>XONTRO<br>MAX-ONE  |
| 447  | PartyIDSource                 |    | M |       | Char<br>muss immer = "D" sein   |
| 452  | PartyRole                     |    | M |       | Integer<br>wird mit<br>16 = "Executing System" belegt   |
| 802  | NoPartySubIDs                 |    | M |       | NumInGroup<br>wird mit "1" belegt   |
| 523  | PartySubID                    |    | M |       | String<br>wird mit "[N/A]" belegt   |
| 803  | PartySubIDType                |    | M |       | Integer<br>wird mit 3 belegt (System)   |
|  |                               |    |   |       |   |
| 11   | ClOrdID                       |    | M |       | String(16)<br>Identifikationsbegriff des letzten erfolgreich<br>durchgeführten Requests, der über das FIX Interface<br>übermittelt wurde (falls vorhanden), ansonsten "[N/A]" |
| 39   | OrdStatus                     |    | M |       | Char<br>OrderStatus<br>0 = "New"  |
| 41   | OrigClOrdID                   |    | M |       | String(16)<br>wird mit "[N/A]" belegt   |
| 6489   | TriggerIndicator              |    | C | CCCC- | Char<br>"Y" = Trigger Stop Order<br>(fehlt bei der Antwort auf einen normalen<br>Cancel/Replace)  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 76 von 137

**7.2.5.4 Aktivierung einer EG-Order**

Wenn die Aktivierungsregel für eine EG-Order erfüllt ist, wird diese vom 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 | XEOMI | Kommentare   |
|------|------------------|----|---|-------|--|
| 6489 | TriggerIndicator |    | C | NNCC- | Char<br><br>Nur XONTRO und MAX-ONE<br>"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<br><br>Nur XONTRO<br>"E" = EG-Order                   |
| 6489 | TriggerIndicator |    | C | NNCN- | Char<br><br>Nur XONTRO<br>"B" = Order auf EG zurückgesetzt |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 77 von 137

**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, 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                                   | 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 XONTRO 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 | XEOMI | Kommentare  |
|--|-------------------------------|----|---|-------|---|
| Im <parties> Component Block (Tag 453 wird erhöht) |                               |    |   |       |   |
| 448  | <executing system><br>PartyID |    | M |       | String<br>mögliche Werte sind<br>XETRA<br>XETRA-2<br>XONTRO<br>MAX-ONE                  |
| 447  | PartyIDSource                 |    | M |       | Char<br>muss immer = "D" sein   |
| 452  | PartyRole                     |    | M |       | Integer<br>wird mit 16 = "Executing System" belegt                                      |
| 802  | NoPartySubIDs                 |    | M |       | NumInGroup<br>wird mit "1" belegt   |
| 523  | PartySubID                    |    | M |       | String<br>wird mit "[N/A]" belegt   |
| 803  | PartySubIDType                |    | M |       | Integer<br>wird mit "3" belegt (System)   |
| 39   | OrdStatus                     |    | M |       | Char<br>OrderStatus<br>wird bei Löschung wegen Orderverfall<br>mit "C" belegt (expired) |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 78 von 137

| Tag  | Feldname     | RF | R | XEOMI | Kommentare   |
|------|--------------|----|---|-------|--|
| 150  | ExecType     |    | M |       | Char<br>Art des Report<br>wird bei Löschung wegen Orderverfall<br>mit "C" belegt (expired)   |
| 5862 | UpdateReason |    | O | OOOON | String(15)<br>Grund der systemgenerierten Order-Änderung bzw. –<br>Löschung<br><br><u>Stammdatenänderungen</u><br>"SBSL" = Entfall der SB/SL Fähigkeit der Gattung<br>"MSEG" = Marktsegmentwechsel<br>"EREO" = Datum der Redenominierung<br>"ENOT" = Einstellung der Notierung<br>"MBKS" = Änderung Kassa-Notierung (Mindestbetrag,<br>kleinste handelbare Einheit,<br>Inkrement)<br>"MBVA" = Änderung Variabel-Notierung<br>(Mindestbetrag, kleinste handelbare Einheit,<br>Inkrement)<br>"KSVA" = Notierung von Kassa auf Variabel<br>"KSKH" = Einstellung Notierung Kassa<br>"VAKS" = Notierung von Variabel auf Kassa<br>"VAKH" = Einstellung Notierung Variabel<br>"VKKS" = Kassa und Variabel auf Kassa<br>"VKVA" = Kassa und Variabel auf Variabel<br>"VKKH" = Einstellung Kassa- und Variabel-Notierung<br>"LHBR" = Ende des Bezugsrechtshandels<br><br><u>Nebenrechte</u><br>"EXBR" = Ex Bezugsrecht<br>"EXBA" = Ex Berichtigungsaktien<br>"EXDI" = Ex Dividendenausschüttung<br>"EXAG" = Ex Ausschüttung<br>"EXDA" = Ex Dividendenausschüttung (Auslandsaktien)<br>"EXSP" = Ex Split bei ausländischen Aktien<br>"EXRS" = Ex Reversesplit<br>"EXZS" = Ex Zinsen<br>"EXAZ" = Ex Ausgleichszahlung<br>"EXBO" = Ex Bonusrecht<br>"EABC" = Ex Verschiedene Rechte<br>"HL" = Hinweis (Orderlöschung)<br>"HA" = Hinweis (Limitabschlag)<br>"WKNA" = ISIN-Änderung<br><br><u>Weitere Ereignisse</u><br>"SYSV" = Löschung nicht akzeptierter EG Order<br>"AUSG" = Kursaussetzung<br>"_Z" = Kursaussetzung mit dem Zusatz<br>"gestrichen Ziehung"<br><br>"XETRABATCH" = Xetra Batch<br>(Löschung, Orderverfall)<br>"XETRAGENERATED" = Löschung Restnominale<br>(FOK, IOC oder MTL Orders)<br>"SUPERUSER" = Eingabe durch den Superuser<br>"KASSASPITZE" = Kassaspitze wegen<br>Teilausführung<br>"ORDEREXPIRED" = Orderverfall in MAX-ONE |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 79 von 137

**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 | XEOMI | Kommentare                      |
|-----|------------------|----|---|-------|---------------------------------|
| 55  | Symbol           | O  | M |       | String<br><b>ignoriert</b>      |
| 48  | SecurityID       | O  | M |       | String<br>ISIN                  |
| 22  | SecurityIDSource | O  | M |       | String<br>muss immer = "4" sein |

**Ausgehende Nachrichten**

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

Der Instrument Component Block wird mit <instrument> referenziert.

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 80 von 137

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



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 81 von 137

| Tag  | Feldname             | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|------|----------------------|----|---|-------|---|
| 452  | PartyRole            | O  | M |       | <p>Integer<br/>muss mit einem der Werte</p> <p>1 = "Executing Firm"<br/>3 = "Client Identification Code"<br/>7 = "Entering Firm"<br/>12 = "Execution within Firm"<br/>29 = "Intermediary"<br/>63 = "Systematic Internaliser"<br/>66 = "Market Maker"<br/>122 = "Investment Decision Maker"<br/>belegt sein</p>  |
| 2376 | PartyIDRoleQualifier | O  | O | NNOON | <p>Integer<br/>Die Angabe dieses Qualifiers ist nur notwendig, wenn „PartyID“ einen Algorithmus (22) darstellt und keinen Shortcode (Default).<br/>Die Differenzierung eines Shortcodes als LEI (23) oder nat. Person (24) ist nicht notwendig und wird ignoriert.</p> <p>22 = „Algorithmus“<br/>Kennzeichnet die PartyID als Algorithmus.<br/>Nur erlaubt für PartyRoles<br/>12 = "Execution within Firm"<br/>122 = "Investment Decision Maker"</p> <p>23 = „LEI (Legal Entity Identifier)“<br/>Kennzeichnet die PartyID als Shortcode für einen LEI<br/>Nur erlaubt für PartyRole<br/>3 = "Client Identification Code"</p> <p>24 = „Nat. Person“<br/>Kennzeichnet die PartyID als Shortcode für eine natürliche Person<br/>Nur erlaubt für PartyRoles<br/>3 = "Client Identification Code"<br/>12 = "Execution within Firm"<br/>122 = "Investment Decision Maker"</p> |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 82 von 137

**Ausgehende Nachrichten**

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 83 von 137

**7.2.7.3 Trading Sessions Repeating Group <trading sessions>**

Nur bei eingehenden Nachrichten

| Tag | Feldname            | RF | R | XEOMI | Kommentare   |
|-----|---------------------|----|---|-------|--|
| 386 | NoTradingSessions   | O  | O | OOOOO | NumInGroup<br><b>ignoriert</b><br>Nur der Wert "1" ist zulässig<br>Ist das Tag vorhanden, dann müssen die Tags 336 und 625 direkt folgen   |
| 336 | TradingSessionID    | O  | O | OOOOO | String(1)<br><b>ignoriert</b><br>Nur der Wert "1" ist zulässig<br>muss vorhanden sein, falls Tag 386 vorhanden ist<br>muss vorhanden sein, falls Tag 625 vorhanden ist   |
| 625 | TradingSessionSubID | O  | O | OOOOO | String<br>muss vorhanden sein, falls Tag 336 vorhanden ist<br>Zulässig sind<br><br>Xetra, Xetra Ffm-2<br>2 = "Opening auction only"<br>3 = "Main trading"<br>4 = "Closing auction only"<br>6 = "Main auction"<br>100 = "Auction only"<br>101 = "End-of-day auction"<br>102 = "Pending for next auction"<br>103 = "Closing crossing"<br>104 = "Accept surplus"<br>105 = "Special auction"<br><br><del>XONTRO, MAX-ONE</del><br>2 = "Opening auction only" (EK - EK-Order)<br>6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order)<br><br><u>MAX-ONE</u><br><u>6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order)</u><br><br>INVESTRO / Vestima<br>Das Feld wird ignoriert<br><br>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.

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 84 von 137

**7.2.7.4 Order Attribute Repeating Group <OrderAttributes>**

Nur bei eingehenden Nachrichten

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

**7.2.7.5 Value Checks Repeating Group <ValueChecksGrp>**

Nur bei eingehenden Nachrichten

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

### 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.

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 86 von 137

**7.3 Fondsabwicklung (INVESTRO / Vestima) - Besonderheiten****7.3.1 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

|                                |                |                                       |
|--------------------------------|----------------|---------------------------------------|
| SecondaryCIOrdID               | 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><br>PartyID |    | M |       | String<br>INVESTRO   |
| 447  | PartyIDSource                 |    | M |       | Char<br>muss immer = "D" sein                                |
| 452  | PartyRole                     |    | M |       | Integer<br>wird mit 16 = "Executing System" belegt           |
| 802  | NoPartySubIDs                 |    | M |       | NumInGroup<br>wird mit "1" belegt                            |
| 523  | PartySubID                    |    | M |       | String<br>wird mit "[N/A]" belegt                            |
| 803  | PartySubIDType                |    | M |       | Integer<br>wird mit "3" belegt (System)                      |
| 150  | ExecType                      |    | M |       | Char<br>Art des Report<br>wird mit "I" belegt (Order Status) |

## **7.3.2 Auftragsrouting an INVESTRO mit Vestima-Gattungen**

### **7.3.2.1 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).

### **7.3.2.2 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.

---

## 7.4 Ereignisse

### 7.4.1 Abläufe

| Nr. | Ereignis                | messageflow    |                   |               |
|-----|-------------------------|----------------|-------------------|---------------|
|     |                         | FE<br>Customer | BT FIX<br>Gateway | Handelssystem |
| 1   | <i>Ereignis</i><br>news |                |                   | ← ●           |
|     |                         |                | ← ●               |               |

### 7.4.2 Ereignismitteilung "News"

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



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 89 von 137

**7.4.3 NoLinesOfText Repeating Group <LinesOfTextGrp>**

| Tag | Feldname    | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|-----|-------------|----|---|-------|---|
| 33  | LinesOfText |    | M |       | NumInGroup<br>Anzahl Zeilen<br>mit "1" oder "2" belegt  |
| 58  | Text        |    | M |       | String<br><u>1. Zeile:</u> Text zum Ereignis <b>oder</b><br><u>2. Zeile optional:</u><br>" _Z" = Kursaussetzung mit dem Zusatz<br>"gestrichen Ziehung"<br>"PO" = Zeichnungssperre mit dem Zusatz<br>"Public Offering" |

**7.4.4 NoRelatedSym Repeating Group <InstrmtGrp>**

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

**7.4.5 NoRoutingIDs Repeating Group <RoutingGrp>**

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

## 7.5 Tradefunktionalität

### 7.5.1 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, 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.

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 91 von 137

**7.5.2 Abläufe**

| Nr. | OTC-Requests<br>MiFID-Requests                                   | messageflow |                   |        |
|-----|--|-------------|-------------------|--------|
|     |  | FE Customer | BT FIX<br>Gateway | XONTRO |
| 1   | trade capture report   |             |                   |        |
| 3   | <i>Bestätigung (immer endgültig)</i><br>trade capture report ack |             |                   |        |

| Nr. | SNO-Realtime                                       | messageflow |                   |        |
|-----|--|-------------|-------------------|--------|
|     |  | FE Customer | BT FIX<br>Gateway | XONTRO |
|     | <i>Schlussnote</i>                                 |             |                   |        |
| 1   | trade capture report sno<br>(für den Kontrahent 1) |             |                   |        |
| 2   | trade capture report sno<br>(für den Kontrahent 2) |             |                   |        |

### 7.5.3 OTC-Geschäfte und MiFID-Reports - Requests

#### 7.5.3.1 Request "TradeCaptureReport" - Identifikationskriterien

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

|   | <b>6556</b><br>BusinessTransactionType | <b>487</b><br>TradeReportTransType  | <b>856</b><br>TradeReportType |
|---|--|-------------------------------------|-------------------------------|
| OTC-Geschäftseingang<br>(EnterOTC)              | Tag nicht vorhanden                    | 0 (new)                             | 0 (submit)                    |
| OTC-Geschäftsstorno<br>(DeleteOTC)              | Tag nicht vorhanden                    | 1 (cancel)                          | 6 (TradeReportCancel)         |
| OTC-<br>Geschäftsdurchlieferung<br>(ReverseOTC) | Tag nicht vorhanden                    | 4 (reverse)                         | 0 (submit)                    |
| MiFID-Report-Eingang<br>(EnterMifid)            | 1 (TradeAdvice)                        | 0 (new)<br>2 (replace)<br>Amendment | 0 (submit)                    |
| MiFID-Report-Storno<br>(DeleteMifid)            | 1 (TradeAdvice)                        | 1 (cancel)                          | 6 (TradeReportCancel)         |

In allen Fällen ist das Tag 571 (TradeReportID) mit einem eindeutigen 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 unterstützten Vorfälle beschrieben.

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 93 von 137

**7.5.3.2 Request "TradeCaptureReport" - Nachrichtendaten**

| Tag | Feldname                  | RF | R | EnterOTC | DeleteOTC | ReverseOTC | EnterMifid | DeleteMifid | Kommentare   |
|-----|---------------------------|----|---|----------|-----------|------------|------------|-------------|--|
|     | <standard message header> | M  | M |          |           |            |            |             | Tag 35 = "AE" (MsgType)  |
| 30  | LastMkt                   | O  | M |          |           |            |            |             | Exchange<br>MIC Code<br>Börsenplatz  |
| 31  | LastPx                    | M  | M |          |           |            |            |             | Price, Float(10,4)   |
| 32  | LastQty                   | M  | M |          |           |            |            |             | Qty, Float(13,3)   |
| 60  | TransactTime              | M  | M |          |           |            |            |             | UTCTimestamp<br>Zeitstempel  |
| 64  | SettlDate                 | O  |   | C        | I         | I          | I          | I           | LocalMktDate<br>Datum Festvaluta<br>Nur mit Tag 5053 gemeinsam zu<br>verwenden.  |
| 75  | TradeDate                 | M  | M |          |           |            |            |             | LocalMktDate<br>Schlusstag (AS)<br>Datum des Abschlusses des Geschäfts.  |
| 487 | TradeReportTransType      | O  | M |          |           |            |            |             | Integer<br>0 = new für EnterOTC<br>EnterMiFID<br>1 = cancel für DeleteOTC<br>DeleteMiFID<br>2 = replace für EnterMiFID (amendment)<br>4 = reverse für ReverseOTC               |
| 570 | PreviouslyReported        | M  | M | C        | C         | C          | C          | C           | Boolean<br>wenn Tag 487 = new,<br>dann Tag 570 = N,<br>ansonsten = Y<br>N für EnterOTC<br>EnterMiFID<br>Y für ReverseOTC<br>EnterMiFID (amendment)<br>DeleteOTC<br>DeleteMiFID |
| 571 | TradeReportID             | M  | M |          |           |            |            |             | String(16)<br>Eindeutiger Identifier des Auftrags, der vom<br>FIX-Client vergeben wird.<br>Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.  |
| 572 | TradeReportRefID          | O  | O | N        | M         | M          | N          | M           | String(16)<br>Identifier des Auftrags, der vom FIX-Client<br>vergeben wird.  |
| 818 | SecondaryTradeReportID    | O  | O | O        | I         | I          | O          | I           | String(13)<br>Bankinterne OTC-Nummer, vom FIX-Client<br>vergeben.<br>Wird vom BT-FIX-Gateway nicht geprüft.  |
| 880 | TrdMatchID                | O  | O | N        | M         | M          | N          | M           | String(16)<br>ursprüngliche Geschäftsnummer<br>Identifier - von XONTRO - des<br>ursprünglichen Auftrags.   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 94 von 137

| Tag  | Feldname                   | RF | R | EnterOTC | DeleteOTC | ReverseOTC | EnterMifid | DeleteMifid | Kommentare  |
|------|----------------------------|----|---|----------|-----------|------------|------------|-------------|---|
| 856  | TradeReportType            | O  | M |          |           |            |            |             | Integer<br>0 (submit) für<br><br>6 = TradeReportCancel für<br><br>EnterOTC<br>ReverseOTC<br>EnterMifid<br>DeleteOTC<br>DeleteMifid  |
|      | <instrument>               | M  | M |          |           |            |            |             |   |
|      | <TrdRegTimestamps>         | O  |   | O        | I         | I          | O          | I           | Abweichender Abschlusstag (AA) bzw. Abschlussdatum.   |
| 5053 | TradeType2                 | O  |   | C        | I         | I          | I          | I           | Integer<br>Festvaluta-Kennzeichnung<br>1 (DVP) = FZ<br>Nur mit Tag 64 gemeinsam zu verwenden.   |
| 5179 | TradeTime                  | O  |   | O        | I         | I          | O          | I           | String<br>Abschluss-Uhrzeit (hhmmss)<br><br>EnterOTC / EnterMifid<br>Default ist die aktuelle Uhrzeit.  |
| 5681 | ExchangeTradeType          | O  |   | C        | I         | I          | I          | I           | Char<br>Kennzeichen Emissionsgeschäft<br>"1"= Emissionsgeschäft<br>Bei Kombination mit Tag 9473 nur 1=AC zulässig.  |
| 6556 | BusinessTransactionType    | O  | O | N        | N         | N          | M          | M           | String<br>1 = TradeAdvice   |
| 5458 | MDDelayed                  | O  | O | I        | I         | I          | O          | I           | Boolean<br>Delay-Indikator  |
| 7017 | VolumeIndicator            | O  | O | I        | I         | I          | M          | I           | Integer<br>Einheit der Effektennotiz<br>1 =Stück, 2 = Prozent, 3 = Promille,<br>4 = Punkte, 9 = Sonstige  |
| 7566 | TimezoneOffset             | O  | O | I        | I         | I          | M          | I           | Integer<br>Abweichung der Abschlussuhrzeit zu UTC.<br>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         | I          | O          | I           | Boolean<br>Abweichender Preis Indikator   |
| 7568 | ReportedPxReason           | O  | O | I        | I         | I          | O          | I           | Char<br>Verhandelter Preis Indikator<br>"N" = negotiated Trade  |
| 7680 | OTCInd                     | O  | O | O        | I         | I          | I          | I           | Integer<br>OTC (Off Exchange order) indicator<br>0 = börslich<br>1= außerbörslich (Default)   |
|      | <TrdCaptRptSideGrp>        | M  | M |          |           |            |            |             |   |
|      | <standard message trailer> | M  | M |          |           |            |            |             |   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 95 von 137

**7.5.3.3 Instrument Component Block <instrument>**

| Tag | Feldname         | RF | R | EnterOTC | DeleteOTC | ReverseOTC | EnterMifid | DeleteMifid | Kommentare  |
|-----|------------------|----|---|----------|-----------|------------|------------|-------------|---|
| 55  | Symbol           | O  | M |          |           |            |            |             | String<br>Börsenkürzel<br>Wird vom BT-FIX-Gateway ignoriert |
| 48  | SecurityID       | M  | M |          |           |            |            |             | String<br>ISIN  |
| 22  | SecurityIDSource | M  | M |          |           |            |            |             | String<br>muss immer = "4" sein                             |

Der Instrument Component Block wird mit <instrument> referenziert.

**7.5.3.4 NoTrdRegTimestamps Repeating Group <TrdRegTimestamps>**

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

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 96 von 137

| Tag | Feldname            | RF | R | EnterOTC | DeleteOTC | ReverseOTC | EnterMifid | DeleteMifid | Kommentare  |
|-----|---------------------|----|---|----------|-----------|------------|------------|-------------|---|
| 770 | TrdRegTimestampType | O  | C | C        | I         | I          | C          | I           | Integer<br>Ist vorhanden, falls Tag 768 vorhanden ist.<br>Gültige Werte<br>1 = "Execution Time" (Abschluss-<br>Zeitstempel) |



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 97 von 137

**7.5.3.5 NoTransactionCosts Repeating Group <courtage>**

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

**7.5.3.6 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 | ReverseOTC | EnterMifid | DeleteMifid | Kommentare  |
|----------|----------|----|---|----------|-----------|------------|------------|-------------|---|
| 552      | NoSides  | M  | M | 2        | 1         | 1          | 1          | 1           | NumInGroup<br>Für EnterOTC:<br>Nur der Wert "2" ist zulässig.<br>Für die die sonstigen Requests:<br>Nur der Wert "1" ist zulässig.<br><br>Es folgt das Tag 54 (Side). |
| <Side 1> |          | M  | M |          |           |            |            |             | <Side 1> für die Geschäfts-Angaben des Eingebers  |
| <Side 2> |          | O  | O | M        | N         | N          | N          | N           | <Side 2> für die Geschäfts-Angaben zum Kontrahenten   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 98 von 137

**<Side1>**

| Tag  | Feldname            | RF | R | EnterOTC | DeleteOTC | ReverseOTC | EnterMifid | DeleteMifid | Kommentare   |
|------|---------------------|----|---|----------|-----------|------------|------------|-------------|--|
| 54   | Side                | M  | M |          |           |            |            |             | Char<br>Seite des Trades<br>1 = Buy<br>2 = Sell  |
| 37   | OrderID             | M  | M |          |           |            |            |             | String<br>Mit "[N/A]" belegt.  |
|      | <parties>           | O  | M |          |           |            |            |             |  |
| 453  | NoPartyIDs          | O  | M |          |           |            |            |             | NumInGroup<br>Nur die Werte "1" bis "4" sind zulässig.   |
|      | <entering firm>     | O  | M |          |           |            |            |             |  |
|      | <executing firm>    | O  | O | O        | O         | O          | O          | O           |  |
|      | <report originator> | O  | O | N        | N         | N          | M          | N           |  |
|      | <execution venue>   | O  | O | N        | N         | N          | M          | N           |  |
|      | end <parties>       | O  | M |          |           |            |            |             |  |
| 12   | Commission          | O  | O | O        | I         | I          | I          | I           | Float(9,2)<br>Spesen<br>Das Feld enthält die Angabe des Spesenbetrags. Bei Finanzierungsschätzen ist die Angabe nicht erlaubt.   |
| 15   | Currency            | O  | O | M        | I         | I          | M          | I           | Currency<br>Währung der Notierung.<br>Bei EnterOTC wird das Feld nicht berücksichtigt.   |
| 58   | Text                | O  | O | O        | I         | I          | I          | I           | String(30)<br>Frei wählbarer Text.   |
| 155  | SettlCurrFxRate     | O  | O | C        | I         | I          | I          | I           | Float(10,5)<br>Devisenkurs des Geschäfts.<br>Nur mit Tag 156 gemeinsam zu verwenden.   |
| 156  | SettlCurrFxRateCalc | O  | O | C        | I         | I          | I          | I           | Char<br>D=divide<br>Nur mit Tag 155 gemeinsam zu verwenden.  |
| 6584 | SpreadPctPremium    | O  | O | O        | I         | I          | I          | I           | Float(5,3)<br>Bonifikationssatz<br>Das Feld enthält die Prozentangabe des Bonifikationssatzes für die Bonifikationsberechnung.<br>Bei Finanzierungsschätzen ist das Feld Mussfeld. Ansonsten ist eine Eingabe nur bei Emissionsgeschäften möglich. |
| 6586 | CashOffset          | O  | O | O        | I         | I          | I          | I           | Float(9,2)<br>Wiederanlagerabatt<br>Eine Eingabe ist nur bei Investmentzertifikaten möglich.   |
|      | <courtage>          | O  | O | O        | I         | I          | I          | I           |  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 99 von 137

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

**<Side2>**

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 100 von 137

**7.5.3.7 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<br>Anzahl der beteiligten Instanzen<br>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<br><b>PartyRole=1 (Executing Firm)</b><br>String(4), zugelassene KVNr des Geschäftseingegers<br><b>PartyRole=7 (Entering Firm)</b><br>String(4), KVNr des Anschlussinhabers<br><b>PartyRole=17 (Contra Firm)</b><br>String(4), KVNr des Kontrahenten<br><b>PartyRole=62 (Report Originator)</b><br>String(11, Code zur Identifizierung des meldenden Instituts<br><b>PartyRole=73 (Execution Venue)</b><br>String(12)<br>Hier ist anzugeben, ob das gemeldete Geschäft <ul style="list-style-type: none"> <li>• ein OTC-Geschäft,</li> <li>• ein internalisiertes Geschäft oder</li> <li>• ein auf einer Plattform (und ggf. welcher) zustande gekommenes Geschäft ist.</li> <li>• Konstante "OTC" für OTC-Geschäfte</li> <li>• Konstante "SI" für systematische Internalisierer</li> </ul> Zur Identifizierung einer Plattform: <ul style="list-style-type: none"> <li>• "B" plus BIC (ISO 9662, 11-stellig alphanumerisch)</li> <li>• "M" plus MIC (ISO 10383, 4-stellig alphanumerisch)</li> <li>• "I" plus IBEL (ISO 16327, 10-stellig alphanumerisch)</li> </ul> |
| 447 | PartyIDSource | O  | M | Char<br>muss immer = "D" sein  |
| 452 | PartyRole     | O  | M | Integer<br>muss mit einem der Werte<br>1 = "Executing Firm"<br>7 = "Entering Firm"<br>17 = "Contra Firm"<br>62 = "Report Originator"<br>73 = "Execution Venue"<br>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>.

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 101 von 137

**7.5.4 OTC-Geschäfte und MiFID-Reports - Responses****7.5.4.1 Response "TradeCaptureReportAck" - Identifikationskriterien**

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

**TradeCaptureReportAck (positive Bestätigung)**

|                    | <b>6556</b><br>Business<br>TransactionType | <b>487</b><br>TradeReport<br>TransType | <b>856</b><br>TradeReportType | <b>150</b><br>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.

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 102 von 137

**7.5.4.2 Response "TradeCaptureReportAck" - Nachrichtendaten**

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 103 von 137

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

**7.5.4.3 Instrument Component Block <instrument>**

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

### 7.5.5 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 bis zu 15 Orderreferenzen enthalten.

Die Orderreferenzen werden als zusätzliche "Sides" 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- 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 880 (TrdMatchID) enthält die Geschäftsnummer.

Das Tag 571 (TradeReportID) wird in jeder Nachricht mit einem eindeutigen, von XONTRO 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.

Das Tag 6732 (DealerNote) wird einmalig in der ersten Nachricht geliefert.

---



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 105 von 137

**7.5.5.1 Geschäftsinformation "TradeCaptureReportSno"**

| Tag                       | Feldname             | RF | R | Kommentare  |
|---------------------------|----------------------|----|---|---|
| <standard message header> |                      | M  |   | Tag 35 = "USN" (MsgType)  |
| <instrument>              |                      | M  |   |   |
| 30                        | LastMkt              | O  | M | Exchange<br>MIC Code<br>Börsenplatz   |
| 31                        | LastPx               | M  |   | Price, Float(10,4)<br>Kurs  |
| 32                        | LastQty              | M  |   | Qty, Float(13,3)<br>Geschäfts-Nominale  |
| 75                        | TradeDate            | M  |   | LocalMktDate<br>Schlusstag<br>Datum des Geschäfts-Abschlusses (ggf. abweichender AS).   |
| 60                        | TransactTime         | M  |   | UTCTimestamp<br>Zeitstempel des sendenden Systems   |
| 64                        | SettlDate            | O  | C | LocalMktDate<br>Datum Festvaluta<br>Nur mit Tag 5053 gemeinsam.   |
| 283                       | LocationID           | O  | M | String<br>Börsenplatz des Meldewesens<br>Wird als FIX-Data-Type Exchange geliefert.<br>"XBER" = Berlin<br>"XMUN" = Muenchen<br>"XINV" = Investro Abwicklungssystem<br>"XDUS" = Duesseldorf<br>"XFRA" = Frankfurt<br>"XHAM" = Hamburg<br>"XHAN" = Hannover<br>"XETR" = Xetra<br>"XSTU" = Stuttgart<br>"XQTS" = Quotrix |
| 487                       | TradeReportTransType | O  | M | Integer<br>0 = new  |
| 570                       | PreviouslyReported   | M  | M | Boolean<br>N = no   |
| 571                       | TradeReportID        | M  | M | String(16)<br>Eindeutiger Identifier des Auftrags, der von XONTRO vergeben wird.  |
| <TrdRegTimestamps>        |                      | O  |   | - Abschlussdatum + abweichende Abschlussuhrzeit (AU)<br>Wurde ein Abweichendes Abschlussdatum (AA) eingegeben, so wird dieser in das Abschlussdatum übernommen, ansonsten ist das Abschlussdatum immer der Schlusstag aus dem Tag 75.<br>- Eingabezeit  |
| 820                       | TradeLinkID          | O  | O | String(16)<br>Wegen-Geschäftsnummer   |
| 828                       | TrdType              | O  | O | Integer<br>OTC Post-trade indicator<br>Indikator für die Art der Transaktion gemäß ESMA RTS 22 Feld 63.<br>9001 = ACTX (Agency cross transaction)<br>9002 = CANC (Cancellation)<br>9101 = ACTX CANC (Agency cross transaction and Cancellation)   |
| 829                       | TrdSubType           | O  | M | Integer<br>Satzart<br>siehe Kapitel 14 Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart)<br>bspw. 9012= "Kauf - Direktgeschäft"   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 106 von 137

| Tag                    | Feldname        | RF | R | Kommentare   |
|------------------------|-----------------|----|---|--|
| 856                    | TradeReportType | O  | M | Integer<br>0 = submit  |
| 880                    | TrdMatchID      | O  | O | String(16)<br>Geschäftsnummer  |
| 1125                   | OrigTradeDate   | O  | O | LocalMktDate<br>ursprünglicher Schlusstag (bei Aufgabenschließung und -weitergabe)   |
| 1126                   | OrigTradeID     | O  | O | String(16)<br>Ursprünglicher Geschäftsnummer (bei Aufgabenschließung, Aufgabenweitergabe und Durchlieferung)   |
| <RegulatoryTradeIDGrp> |                 | O  | O | TVTIC (Trading venue transaction identifier)   |
| 5053                   | TradeType2      | O  | C | Integer<br>Festvaluta-Kennzeichnung<br>1 (DVP) = FZ<br>7 (when issued) = FE<br>Nur mit Tag 64 gemeinsam.   |
| 5494                   | LastTrader      | O  | O | Integer<br>Ursprünglicher Makler (bei Aufgabenschließung und -weitergabe)  |
| 5665                   | MKTXPriceDiff   | O  | O | Float(15,2)<br>Kurs-Differenz-Betrag<br>Wenn negativer Betrag, dann überweist der Makler.<br>Ansonsten erhebt der Makler.  |
| 6034                   | ConcessionAmt   | O  | O | Float(9,2)<br>Boni-Differenz-Betrag  |
| 6475                   | ClientIndicator | O  | O | Char<br>Y = "IW-Geschäft"  |
| 6732                   | DealerNote      | O  | O | String(350)<br>diverse SAKI-Feldinhalte mit \ getrennt.<br>In TradeCaptureReportSno wurden alle relevanten Tags zur Beschreibung eines Geschäfts definiert. Im <del>neuen</del> Tag 6732 werden Feldi-halte, die zusätzlich in einer SAKI-SNO-Nachricht <u>bzw. aufgrund von zusätzlichen Anforderungen</u> enthalten sind, aufgenommen.<br><br>Kennzeichen Lieferfreigabe ab 3.6.2013 immer Space\<br>Abweichender Kontrahentenkurs \<br>Kennzeichen für Abweichender Schlusstag \<br>Art des Wertpapiers \<br>Verwahrmöglichkeit \<br>Zinstermin \<br>APMT-Konstante \<br>Abschlusskurs-Währung \<br>Kurswert-Währung \<br>Kursdifferenz-Währung \<br>Stückzins-Währung \<br>Kennzeichen für Courtage \<br>Kennzeichen für Spesen \<br>Kennzeichen für Wiederanlagerabatt \<br>Kennzeichen für Bonifikation \<br>Kennzeichen für Boni-Differenz \<br>Kennzeichen für Provision \<br>Courtage-Währung \<br>Spesen-Währung \<br>Wiederanlagerabatt-Währung \<br>Bonifikations-Währung \<br>Boni-Differenz-Währung \<br>Provisions-Währung \<br>Kennzeichen für Wiederanlagerabatt \<br>Kennzeichen für Bonifikation \<br>Bonischlüssel \<br>Kennzeichen für Boni-Differenz \<br>Kennzeichen für Order-Referenz \<br>Kennzeichen für Order-Referenz |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 107 von 137

| Tag  | Feldname                   | RF | R | Kommentare  |
|------|----------------------------|----|---|---|
|      |                            |    |   | <u>Eingaber-ID\</u><br>Formate und Werte siehe im Kapitel Anhang C: Benutzerdefinierte Tags   |
| 7017 | VolumeIndicator            | O  | O | Integer<br>Einheit der Effektennotiz<br>1 =Stück, 2 = Prozent, 3 = Promille   |
| 7680 | OTCInd                     | O  | M | Integer<br>OTC (Off Exchange) indicator<br>0 = börslich<br>1 = außerbörslich  |
| 9954 | NextMsgFlag                | O  | M | Boolean<br>Y = (weitere) Folgesätze werden geliefert<br>N = keine (weiteren) Folgesätze   |
| 9807 | RegFeeFlag                 | O  | O | Char<br>Courtage-Schlüssel aus der jeweiligen Courtage Staffel.<br>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. |
| 9893 | DiscountRate               | O  | O | Float(9,7)<br>Diskontsatz (Nur für Finanzierungsschätze)  |
|      | <SnoRealtimeSideGrp>       | M  |   |   |
|      | <standard message trailer> | M  | M |   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 108 von 137

**7.5.5.2 Instrument Component Block <instrument>**

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

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 109 von 137

**7.5.5.3 NoSecAltID Repeating Group <SecAltIDGrp>**

Der SecAltIDGrp Component Block beinhaltet die Repeating Group NoSecAltID.

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

**7.5.5.4 NoTrdRegTimestamps Repeating Group <TrdRegTimestamps>**

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

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

**7.5.5.5 NoMiscFees Repeating Group <gebühren>**

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

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 110 von 137

**7.5.5.6 NoTransactionCosts Repeating Group <courtage>**

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 111 von 137

**7.5.5.7 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<br>Nur die Werte größer gleich 2 sind zulässig.<br>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<br>Seite des Trades für <entering firm><br>1 = Buy<br>2 = Sell  |
| 37                         | OrderID    | M  | M | String<br>Mit "[N/A]" belegt.  |
| <parties>                  |            | O  | M |  |
| 453                        | NoPartyIDs | O  | M | NumInGroup<br>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 Eingebener beschreiben.   |
| <buyer seller>             |            | O  | O | Daten, die den Käufer / Verkäufer beschreiben.   |
| <order origination trader> |            | O  | O | Händlernummer  |
| <clearing firm>            |            | O  | O | KVNr des Clearers  |
| <clearing organization>    |            | O  | O | KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei internem Settlement.<br>KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei bilaterale Aggregation.  |
| end <parties>              |            | O  | M |  |
| 1                          | Account    | O  | O | String(2),<br>Aufgebaut aus Account Type Code und Account Type Number.<br><br>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.<br><br>Bei Bankdirektgeschäften wird dieses Kennzeichen n i c h t gefüllt.<br><br>Möglicher Wertebereich:<br>EA – Eigengeschäft des Maklers aus systemseitiger Aufgabenschließung<br>EE – Eigengeschäft des Maklers<br>P1 – Eigengeschäft der Bank<br>A1 – Kundengeschäft der Bank |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 112 von 137

| Tag  | Feldname            | RF | R | Kommentare  |
|------|---------------------|----|---|---|
| 12   | Commission          | O  | O | Float(9,2)<br>Spesen<br>Das Feld enthält die Angabe des Spesenbetrags. Bei Finanzierungsschätzen ist die Angabe nicht erlaubt.  |
| 58   | Text                | O  | O | String(35)<br>frei wählbarer Text. mit ggf. vorangestellten Präfix:<br>"BOSS/" bei XONTRÖ-Order-Geschäften<br>"INVESTRO/" bei INVESTRO-Geschäften<br>"EUFO/" bei EUFO-Geschäften<br>"MAX/" bei Max-One-Geschäfte<br>"FIX/" bei OTC-Geschäften, die über FIX erfasst wurden.<br>"FIXF/" bei OTC-Geschäften, die über FIX fremd-erfasst wurden. |
| 157  | NumDaysInterest     | O  | C | Integer<br>Zinstage, wenn Tag 5427 = I<br>Diskonttag, wenn Tag 5427 = D   |
| 159  | AccruedInterestAmt  | O  | C | Amt, Float(12,2)<br>Zinsbetrag, wenn Tag 5427 = I<br>Diskontbetrag, wenn Tag 5427 = D   |
| 119  | SettlCurrAmt        | O  | O | Amt, Float(12,2)<br>Ausmachender Betrag   |
| 120  | SettlCurrency       | O  | O | Currency<br>Währung des Ausmachender Betrags.   |
| 155  | SettlCurrFxRate     | O  | C | Float(10,5)<br>Devisenkurs des Geschäfts.<br>Nur mit Tag 156 gemeinsam zu verwenden.  |
| 156  | SettlCurrFxRateCalc | O  | C | Char<br>D=divide<br>Nur mit Tag 155 gemeinsam zu verwenden.   |
| 381  | GrossTradeAmount    | O  | O | Amt, Float(15,2)<br>Kurswert  |
| 5427 | IntrAttribType      | O  | C | Char<br>Kennzeichen, ob Zins- oder Diskont-Felder - Tags 157 und 159 - geliefert werden.<br>I = Interest (Zinsen)<br>D = Discount (Diskont)   |
| 6583 | SpreadPremium       | O  | O | Float(9,2)<br>Bonifikationsbetrag   |
| 6584 | SpreadPctPremium    | O  | O | Float(5,3)<br>Bonifikationssatz<br>Das Feld enthält die Prozentangabe des Bonifikationssatzes für die Bonifikationsberechnung.  |
| 6585 | SpreadPctDiscount   | O  | O | Float(10,7)<br>Wiederanlagerabatt in Prozent  |
| 6586 | CashOffset          | O  | O | Float(9,2)<br>Wiederanlagerabatt  |
| 7493 | CustomRate1         | O  | O | Float(4,2)<br>Ausgabeaufschlag  |
| 9596 | ClientFreeField1    | O  | O | String<br>Provision<br>Das Feld ist auf Float(10,3) > 0 eingeschränkt.<br>Nur mit Tag 9597 gemeinsam zu verwenden.<br>Falls Tag 9597 "PM" enthält, muss der Wert <= 99,999 sein<br>Falls Tag 9597 "PD" enthält, muss der Wert <= 9999999,990 sein<br>(letzte Nachkommastelle = 0)   |



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 113 von 137

| Tag  | Feldname             | RF | R | Kommentare  |
|------|----------------------|----|---|---|
| 9597 | ClientFreeField2     | O  | O | String(2)<br>Schlüsselcode zur Provision.<br>Nur mit Tag 9596 gemeinsam zu verwenden.<br>Zulässig sind<br>"PM" = Provisionsatz<br>"PD" = Provisionsbetrag   |
| 9938 | ClearingHandlingType | O  | O | Char<br>Kennzeichen des (Handels-)Schlussnote für internes Settlement oder bilaterale Aggregation. Das Geschäft wird nicht an Clearstream geliefert.<br>"I" = internes Settlement<br>"A" = bilaterale Aggregation<br>Kennzeichen des Abwicklungs-Geschäfts bei bilateraler Aggregation. Das Geschäft wird an Clearstream geliefert.<br>"B" = bilaterale Aggregation |
|      | <gebühren>           | O  | O |   |
|      | <courtage>           | O  | O |   |

**<Side2>**

| Tag | Feldname              | RF | R | Kommentare  |
|-----|-----------------------|----|---|---|
| 54  | Side                  | M  | M | Char<br>Seite des Trades für "contra firm"<br>1 = Buy<br>2 = Sell   |
| 37  | OrderID               | M  | M | String<br>Mit "[N/A]" belegt.   |
|     | <parties>             | O  | M |   |
| 453 | NoPartyIDs            | O  | M | NumInGroup<br>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.   |
|     | <buyer seller>        | O  | M | Daten, die den Käufer / Verkäufer beschreiben.<br>Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann Verkäufer.<br>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.<br>Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann DEAG.<br>Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy, dann REAG.     |
|     | <custodian>           | O  | O | DECU / RECU, Vestima-BIC des Delivering / Receiving Custodian.<br>Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann DECU.<br>Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy, dann RECU. |
|     | <buyer seller>        | O  | O | BUY / SELL, Vestima-BIC des Käufers / Verkäufers.<br>Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell, dann SELL.<br>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<br>Seite des Trades für <entering firm><br>1 = Buy<br>2 = Sell |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 114 von 137

| Tag  | Feldname     | RF | R | Kommentare  |
|------|--------------|----|---|---|
| 37   | OrderID      | M  | C | String(16)<br>Ordernummer (Ordernummer des Handelssystems)<br>Bankinterne Ordernummer (SecondaryClOrdID) oder<br>Bankinterne OTC-Nummer (SecondaryTradeReportID) oder<br>Eingabenummer ("Halbe Geschäftsnummer" beginnend mit "MAN")<br>Zusammen mit Tag 6141 |
| 119  | SettlCurrAmt | O  | C | Float(10,4)<br>Anteiliger Abrechnungsbetrag   |
| 6141 | TradeQty     | O  | C | Qty, Float(12,3)<br>Ausgeführte Nominale<br>Zusammen mit Tag 37 (OrderID).  |

**7.5.5.8 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 | XEOMI | Kommentare  |
|-----|------------|----|---|-------|---|
| 453 | NoPartyIDs | O  | M |       | NumInGroup<br>Anzahl der beteiligten Instanzen<br>Nur die Werte 2 – 7 sind zulässig, der angegebene Wert muss der Anzahl der folgenden Repeating Groups entsprechen   |
| 448 | PartyID    | O  | M |       | String<br><b>PartyRole=1 (Executing Firm)</b><br>String(4), zugelassene KVNr des Orderaufgebers bzw. Geschäftseingebers<br><b>PartyRole=4 (Clearing Firm)</b><br>String(4), KVNr des Clearers<br><b>PartyRole=10 (Settlement Location)</b><br>String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (PSET)<br><b>PartyRole=11 (Order Origination Trader)</b><br>String(6), Händlernummer<br><b>PartyRole=17 (Contra Firm)</b><br>String(4), KVNr des Kontrahenten, wenn PartyIDSource = D<br>String(20), LEI (Legal Entity Identifier) des Kontrahenten, PartyIDSource = N<br><b>PartyRole=21 (Clearing Organization)</b><br>String(4)<br>KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei internem Settlement<br>KVNr des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei bilaterale Aggregation<br><b>PartyRole=24 (Customer Account)</b><br>String(4), KVNr des SNO-Empfängers<br><b>PartyRole=27 (Buyer Seller)</b><br>String(4), KVNr des Käufers / Verkäufers, bei PartyIDSource=D<br>String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (SELL/BUY), bei PartyIDSource=B<br><b>PartyRole=28 (Custodian)</b><br>String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DECU/RECU)<br><b>PartyRole=30 (Agent)</b><br>String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DEAG/REAG) |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 115 von 137

| Tag | Feldname      | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|-----|---------------|----|---|-------|---|
| 447 | PartyIDSource | O  | M |       | Char<br>muss immer = "D", bei PartyRole 1, 4, 11, 21, 24<br>oder = "B", bei PartyRole 10, 28, 30<br>oder = "D" oder "B", bei PartyRole 27<br>oder = „D“ oder „N“ bei PartyRole 17<br>sein   |
| 452 | PartyRole     | O  | M |       | Integer<br>wird mit einem der Werte<br>1 = "Executing Firm"<br>4 = "Clearing Firm"<br>10 = "Settlement Location"<br>11 = "Order Origination Trader"<br>17 = "Contra Firm"<br>21 = "Clearing Organization"<br>24 = "Customer Account"<br>27 = "Buyer Seller"<br>28 = "Custodian"<br>30 = "Agent"<br>belegt |
|     | PtysSubGrp    | O  | C |       | Nur für PartyRole 27, 28 und 30 zulässig  |

**7.5.5.9 NoPartySubIDs Repeating Group <PtysSubGrp>**

| Tag | Feldname       | RF | R | XEOMI | Kommentare  |
|-----|----------------|----|---|-------|---|
| 802 | NoPartySubIDs  | O  | C |       | NumInGroup<br>wird mit "1" oder "2" belegt.<br>Nur für PartyRole 27, 28 und 30 zulässig   |
| 523 | PartySubID     | O  | C |       | String(35)<br>wird für PartyRole 27, 28 und 30 mit weiteren Identifikationsmerkmal des Safe-Accounts belegt.  |
| 803 | PartySubIDType | O  | C |       | Integer<br>für PartyRole 27 mit "4050" (Buy/Sell Safe Account)<br>für PartyRole 30 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell mit<br>"4060" (DEAG-Safe-Account),<br>für PartyRole 30 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy mit<br>"4070" (REAG-Safe-Account) ,<br>für PartyRole 28 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Buy mit<br>"4080" (DECU-Safe-Account),<br>für PartyRole 28 und Tag 54 (Side) aus <Side2> gleich Sell mit<br>"4090" (RECU-Safe-Account). |

**7.5.5.10 Regulatory TradeID Repeating Group <RegulatoryTradeIDGrp>**

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

## 8 Anhang A: Beispiele

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>
```

---

**FAGSE**

**BT-FIX Gateway**

---

13.03.2018

**Rules of Engagement**

---

Seite 117 von 137

---

**OrderCancelReject**

8=FIX.4.4 <SOH> 9= <SOH> 35=9 <SOH> 34=49 <SOH> 49=FSRH9917 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FS776617 <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=FSRH9917 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FS776617 <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=FS776617 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FSRH9917 <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\_ReplID\_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=FSRH9917 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FS776617 <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\_ReplID\_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=FSRH9919 <SOH> 52=20110831-07:00:01.000 <SOH> 56=FS776619 <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>

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 118 von 137

**9 Anhang B: Einschränkungen von Formaten und Strukturen****Legende**Sortierung: Nach Namen aufsteigend sortiertÜberschriften: 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. Abwicklungssystem nicht aufgeführt, dann ist die Verwendung des Tags generell in diesem Handels- bzw. Abwicklungssystem 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<br>PartyIDSource<br>PartyRole | nicht systemspezifisch |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 119 von 137

| Tag | Format/Struktur | E/A | Restriktionen/Werte  | Handelssystem          |
|-----|-----------------|-----|--|------------------------|
|     |                 | A   | <p>für den Typ "session" werden zusätzlich genutzt:<br/>NoPartySubIDs (Tag 802), um "1" erhöht<br/>PartySubID (Tag 523) = Identifikationsmerkmal<br/>PartySubIDType (Tag 803) immer = "4040"</p> <p>für den Typ "Executing System" werden zusätzlich genutzt:<br/>NoPartySubIDs (Tag 802, um "1" erhöht)<br/>PartySubID (Tag 523) = "[N/A]"<br/>PartySubIDType (Tag 803) immer = "3"</p> <p>für den Typ "Settlement Location" werden zusätzlich genutzt:<br/>NoPartySubIDs (Tag 802), um "2" erhöht<br/>PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal"<br/>PartySubIDType (Tag 803) = "4060"<br/>PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal"<br/>PartySubIDType (Tag 803) = "4080"<br/>oder<br/>NoPartySubIDs (Tag 802), um "2" erhöht<br/>PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal"<br/>PartySubIDType (Tag 803) = "4070"<br/>PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal"<br/>PartySubIDType (Tag 803) = "4090"</p> <p>für den Typ "Buyer Seller" werden zusätzlich genutzt:<br/>NoPartySubIDs (Tag 802) um "1" erhöht<br/>PartySubID (Tag 523) = "Identifikationsmerkmal"<br/>PartySubIDType (Tag 803) = "4050"</p> <p>für den Typ „Execution within firm“ wird zusätzlich genutzt:<br/>PartyIDRoleQualifier (Tag 2376) = „22“ (Algorithmus)<br/>oder „24“ (Nat. Person)</p> <p>für den Typ „Investment Decision Maker“ wird zusätzlich genutzt:<br/>PartyIDRoleQualifier (Tag 2376) = „22“ (Algorithmus)<br/>oder „24“ (Nat. Person)</p> <p>für den Typ "Client Identification Code" wird zusätzlich genutzt:<br/>PartyIDRoleQualifier (Tag 2376) = „23“ (LEI) oder „24“ (Nat. Person)</p> | nicht systemspezifisch |
|     | Price           |     | <p>das FIX Float Format Price (15 signifikante Stellen, zusätzlich optional Dezimalpunkt und Vorzeichen) ist eingeschränkt.<br/>Siehe hierzu die Float-Format-Angabe Float (13,5) bei den jeweiligen Tags: 44 Price, 99 StopPx.<br/>Besonderheit bei Tag 31 LastPx:<br/>Float (13,5) bei den Ordernachrichten.<br/>Float (10,4) bei den Trade-Nachrichten.</p>   | nicht systemspezifisch |
|     | Qty             |     | <p>das FIX Float Format Qty (15 signifikante Stellen, zusätzlich optional Dezimalpunkt und Vorzeichen) ist eingeschränkt.<br/>Das Format ist immer Float (12,3)</p>  | nicht systemspezifisch |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 120 von 137

**10 Anhang C: Benutzerdefinierte Tags****Legende**Sortierung: Nach Tags aufsteigend sortiertÜberschriften: 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. Abwicklungssystem nicht aufgeführt, dann ist die Verwendung des Tags generell in diesem Handels- bzw. Abwicklungssystem nicht zulässig.

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



**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 121 von 137

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 122 von 137

| Tag  | Feldname                | E/A | Restriktionen/Werte  | Handelssystem   |
|------|-------------------------|-----|--|---|
| 6475 | ClientIndicator         | A   | Y = IW-Geschäft  | XONTRO für TradeCaptureReportSno                                    |
| 6489 | TriggerIndicator        | A   | A = Aktivierung einer EG-Order<br>B = Order auf EG zurückgesetzt<br>Y = Trigger Stop Order | XONTRO, MAX-ONE<br>XONTRO<br>XONTRO, MAX-ONE, Xetra,<br>Xetra Ffm-2 |
| 6516 | NewsValidUntil          |     | Datum bis  | XONTRO  |
| 6517 | NewsEventDate           |     | Datum bzw. Datum ab  | XONTRO  |
| 6555 | OrigTrdMatchID          | A   | Ursprüngliche Geschäftsnummer  | XONTRO für TradeCaptureReportAck                                    |
| 6556 | BusinessTransactionType |     | "1" = TradeAdvice  | XONTRO für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportAck             |
| 6583 | SpreadPremium           | A   | Bonifikationsbetrag  | XONTRO für TradeCaptureReportSno                                    |
| 6584 | SpreadPctPremium        |     | Bonifikationssatz  | INVESTRO,<br>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 für TradeCaptureReportSno                          |
| 6732 | DealerNote              | A   | diverse Unterfelder mit \ getrennt.<br>Die Beschreibung folgt im Anschluss dieser Tabelle  | INVESTRO, XONTRO für TradeCaptureReportSno                          |
| 6893 | Profit                  | A   | Zwischengewinn   | INVESTRO, XONTRO für TradeCaptureReportSno                          |
| 7017 | VolumeIndicator         | E   | 1 =Stück<br>2 = Prozent<br>3 = Promille<br>4 = Punkte<br>9 = Sonstige                      | XONTRO für TradeCaptureReport                                       |
|      |                         | A   | 1 =Stück<br>2 = Prozent<br>3 = Promille  | XONTRO 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 für TradeCaptureReport                                       |
| 7567 | ReportedPxDiff          | E   | Y = Abweichender Preis Indikator   | XONTRO für TradeCaptureReport                                       |
| 7568 | ReportedPxReason        | E   | N = negotiated Trade   | XONTRO für TradeCaptureReport                                       |
| 7680 | OTCInd                  |     | 0 = börslich<br>1 = außerbörslich (Default)  | nicht systemspezifisch  |
| 7931 | VenuelD                 |     | <executing system>   | nicht systemspezifisch, nur 4.2                                     |
| 9318 | MktMkerID               |     | <systematic internaliser><br><market maker>  | nicht systemspezifisch, nur 4.2                                     |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 123 von 137

| Tag   | Feldname                      | E/A | Restriktionen/Werte  | Handelssystem   |
|-------|-------------------------------|-----|--|---|
| 9320  | OrderRejectReasonTxt          | A   | Fehlertext des Handelssystems  | nicht systemspezifisch                                  |
| 9471  | NoTransactionCosts            |     | <courtage>   | XONTRO für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno |
| 9473  | TransactionCostCode           |     | <courtage>   | XONTRO für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno |
| 9476  | TransactionCostAmt            |     | <courtage>   | XONTRO für TradeCaptureReport und TradeCaptureReportSno |
| 9583  | MIFIDInternalizationIndicator |     | 1 = "Facilitation"<br>4 = "No"   | Xetra   |
| 9591  | PriceCheckingFlag             | A   | 2 = severe (PriceAlert)  | XONTRO für TradeCaptureReportAck                        |
| 9596  | ClientFreeField1              |     | String<br>auf Float(10,3) > 0 eingeschränkt<br>Falls Tag 9597 "PM" enthält, muss der Wert <= 99,999 sein<br>Falls Tag 9597 "PD" enthält, muss der Wert <= 9999999,990 sein (letzte Nachkommastelle = 0)                        | XONTRO  |
| 9597  | ClientFreeField2              |     | "PD" = Absolutbetrag<br>"PM" = Promille<br>Space = None  | XONTRO  |
| 9803  | TradingSystemID               | A   | 0 = Gateway<br>4 = Xetra<br>5 = Xetra Ffm-2<br>111 = Connector<br>112 = Connector<br>120 = XEO MAX-ONE<br>121 = XEO Xetra<br>122 = XEO Xetra Ffm-2<br>212 = XONTRO<br>312 = MAX-ONE<br>313 = MAX-ONE<br>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<br>H = Fondsegment Hannover<br><br>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<br>A = bilaterale Aggregation: das, Geschäft welches in die Aggregation einfließt.<br>B = bilaterale Aggregation: das aggregierte Abwicklungs-Geschäft.  | XONTRO  |
| 9954  | NextMsgFlag                   | A   | Y = (weitere) Folgesätze werden geliefert<br>N = keine (weiteren) Folgesätze   | XONTRO für TradeCaptureReportSno                        |
| 20003 | PartyIDClientID               | E   | <client identification code>   | XONTRO, MAX-ONE   |

**FAGSE**

**BT-FIX Gateway**

---

13.03.2018

---

**Rules of Engagement**

---

---

Seite 124 von 137

---

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

---

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 125 von 137

**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<br>Trenner              | Char<br>Char          | J, N<br>\   |
|   |                   | abweichender Kontrahentenkurs<br>Trenner           | String(11)<br>Char    | 6 Vorkomma, 4 Nachkomma<br>\  |
|   |                   | Kennzeichen für Abweichender Schlusstag<br>Trenner | String(2)<br>Char     | Konstante "AS"<br>\   |
|   |                   | Art des Wertpapiers<br><br>Trenner                 | String(3)<br><br>Char | Konstante<br>"SHS" = Aktien,<br>"BON" = Renten,<br>"BCE" = zertifikatsähnl. Renten,<br>"WTS" = Warrants,<br>"CER" = Zertifikate,<br>"FUN" = Fonds,<br>"SUB" = Nebenrechte,<br>"RTE" = Genussrechte,<br>"UNT" = Units,<br>"MSC" = Sonstige |
|   |                   | Verwahrmöglichkeit<br>Trenner                      | String(3)<br>Char     | \   |
|   |                   | Zinstermin<br>Trenner                              | String(8)<br>Char     | bspw. "21.07.G "  |
|   |                   | APMT-Konstante<br>Trenner                          | String(4)<br>Char     | "APMT" = gegen Zahlung  |
|   |                   | Abschlusskurs-Währung<br>Trenner                   | String(3)<br>Char     | \   |
|   |                   | Kurswert-Währung<br>Trenner                        | String(3)<br>Char     | \   |
|   |                   | Kursdifferenz-Währung<br>Trenner                   | String(3),<br>Char    | \   |
|   |                   | Stückzins-Währung<br>Trenner                       | String(3),<br>Char    | \   |
|   |                   | Kennzeichen für Courtage<br>Trenner                | String(6),<br>Char    | Konstante /BROK/<br>\   |
|   |                   | Kennzeichen für Spesen<br>Trenner                  | String(6)<br>Char     | Konstante /FEES/<br>\   |
|   |                   | Kennzeichen Wiederanlagerabatt<br>Trenner          | String(6)<br>Char     | Konstante /MISC/<br>\   |
|   |                   | Kennzeichen für Bonifikation<br>Trenner            | String(6)<br>Char     | Konstante /MISC/<br>\   |
| Kennzeichen für Boni-Differenz<br>Trenner | String(6)<br>Char | Konstante /MISC/<br>\                              |                       |   |
| Kennzeichen für Provision<br>Trenner      | String(6)<br>Char | Konstante /COMM/<br>\                              |                       |   |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 126 von 137

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

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 127 von 137

**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  | SecondaryCIOrdID        |
| 552  | NoSides                 |
| 553  | Username                |
| 554  | Password                |
| 570  | PreviouslyReported      |
| 571  | TradeReportID           |
| 572  | TradeReportRefID        |
| 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           |
| 1126 | OrigTradeID             |

**FAGSE**

**BT-FIX Gateway**

**Rules of Engagement**

---

| <b>Tag</b> | <b>Feldname</b>                         |
|------------|---|
| 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     |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 130 von 137

**13 Anhang F: Abweichende Belegungen von Standardtags****Legende**Sortierung: Nach Tags aufsteigend sortiertÜberschriften: 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. Abwicklungssystem nicht aufgeführt, dann ist die Verwendung des Tags generell in diesem Handels- bzw. Abwicklungssystem nicht zulässig.

| Tag | Feldname    | E/A | Restriktionen/Werte   | Handelssystem                           |
|-----|-------------|-----|---|---|
| 1   | Account     |     | Siehe <b>AcctTypCod</b> und <b>AcctTypNo</b>  |   |
|     | AcctTypCod  |     | "A" = Agent<br>"E" = BEST Executor<br>"I" = Issuer (Quote Provider)<br>"L" = Liquidity Provider<br>"M" = Betreuer<br>"P" = Proprietary<br>"Q" = Liquidity Manager<br><b>mandatory</b>   | Xetra, Xetra Ffm-2                      |
|     |             |     | "A" = Agent<br>"P" = Proprietary<br><b>optional</b>   | XONTRO (Orderfunktionalitäten), MAX-ONE |
|     |             |     | <b>optional</b><br><i>ignoriert</i>   | INVESTRO/Vestima                        |
|     |             |     | "A" = Agent (Kunde)<br>"P" = Proprietary (Banken Eigengeschäft)<br>"E" = Proprietary (Makler Eigengeschäft)<br><b>optional</b>  | XONTRO für Schlussnoten                 |
|     | AcctTypNo   |     | mandatory   | Xetra, Xetra Ffm-2                      |
|     |             |     | Nur "1" ist zulässig<br><b>optional</b>   | XONTRO-Order, MAX-ONE                   |
|     |             |     | "A" = Geschäft des Maklers, aus systemseitiger Aufgabenschließung, nur zusammen mit AcctTypCod="E" möglich<br>"E" = Geschäft des Maklers, nur zusammen mit AcctTypCod="E" möglich<br>"1" = Geschäft der Bank, nur zusammen mit AcctTypCod="A" oder "P" möglich<br><b>optional</b> | XONTRO für Schlussnoten                 |
|     |             |     | <b>optional</b><br><i>ignoriert</i>   | INVESTRO/Vestima                        |
| 8   | BeginString |     | nur "FIX.4.2" und "FIX.4.4" sind zulässig   |   |
| 11  | ClOrdID     |     | String(16), muss für die Laufzeit einer Order eindeutig sein  | nicht systemspezifisch                  |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 131 von 137

| Tag | Feldname         | E/A | Restriktionen/Werte  | Handelssystem                       |
|-----|------------------|-----|--|-------------------------------------|
| 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 <b>genau 2</b> Nachkommastellen abbilden lassen. Ist dies nicht möglich, wird die Nachricht als fehlerhaft behandelt | XONTRO                              |
| 21  | HandlInst        | E   | Char für "FIX.4.2" <b>mandatory</b> für "FIX.4.4." <b>optional ignoriert</b>   | nicht systemspezifisch              |
| 22  | SecurityIDSource |     | nur der Wert "4" ist zulässig  | nicht systemspezifisch              |
| 33  | LinesOfText      | A   | Bei Nachrichten des Sessionlevels immer mit "1" belegt.<br>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<br>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<br>Für 4.2 wird "BF" durch "UBF" und "AR" durch "UAR" ersetzt.  | nicht systemspezifisch              |
| 37  | OrderID          |     | String(13), eindeutiger Schlüssel im jeweiligen Handelssystem  | nicht systemspezifisch              |
| 38  | OrderQty         |     | Siehe <b>Qty</b>   | nicht systemspezifisch              |
| 39  | OrdStatus        | A   | 0 = "New"<br>1 = "Partially filled"<br>2 = "Filled"<br>4 = "Canceled"<br>6 = "Pending Cancel"<br>8 = "Rejected"<br>A = "Pending New"<br>C = "Expired"<br>E = "Pending Replace"   | XONTRO, Xetra, Xetra Ffm-2, MAX-ONE |
|     |                  | A   | 0 = "New"<br>2 = "Filled"<br>4 = "Canceled"<br>6 = "Pending Cancel"<br>8 = "Rejected"<br>A = "Pending New"   | INVESTRO/Vestima                    |
| 40  | OrdType          |     | 1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"<br>4 = "Stop Limit"<br>K = "Market with Leftover"<br>P = "Pegged"  | Xetra                               |
|     |                  |     | 1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"<br>4 = "Stop Limit"  | Xetra Ffm-2, MAX-ONE                |
|     |                  |     | 1 = "Market"<br>2 = "Limit"<br>3 = "Stop"  | XONTRO                              |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 132 von 137

| Tag | Feldname                  | E/A | Restriktionen/Werte   | Handelssystem                                  |
|-----|---------------------------|-----|---|--|
|     |                           |     | 1 = "Market"  | INVESTRO/Vestima                               |
| 44  | Price                     |     | Siehe <b>Price</b>  | nicht systemspezifisch                         |
| 55  | Symbol                    | E   | ignoriert   | nicht systemspezifisch                         |
|     |                           | A   | immer auf "[N/A]" gesetzt   | nicht systemspezifisch                         |
| 58  | Text                      |     | auf Länge 25 beschränkt<br>An die Handelssysteme Xetra und Xetra Ffm-2 werden nur die ersten 12 Stellen weitergegeben   | nicht systemspezifisch                         |
| 59  | TimelnForce               |     | 0 = "Day"<br>3 = "Immediate or Cancel"<br>4 = "Fill or Kill"<br>6 = "Good till Date"  | Xetra  |
|     |                           |     | 0 = "Day"<br>6 = "Good till Date"   | Xetra Ffm-2, MAX-ONE, XONTRO                   |
|     |                           |     | <i>ignoriert</i>  | INVESTRO/Vestima                               |
| 60  | TransactTime              | E   | <i>ignoriert</i>  | nicht systemspezifisch                         |
| 98  | EncryptMethod             |     | nur der Wert "0" ist zulässig   | nicht systemspezifisch                         |
| 99  | StopPx                    |     | Siehe <b>Price</b>  | nicht systemspezifisch                         |
| 100 | ExDestination             |     | MIC Code<br>XBER, XDUS, XETR, XHAN, XHAM, XMUN,<br>XSTU, XFRA<br>XINV adressiert INVESTRO/Vestima   | nicht systemspezifisch                         |
| 110 | MinQty                    |     | siehe <b>Qty</b><br>nur bei Midpoint Orders   | Xetra  |
| 150 | ExecType                  | A   | 0 = "New"<br>4 = "Canceled"<br>5 = "Replace"<br>6 = "Pending Cancel"<br>8 = "Rejected"<br>A = "Pending New"<br>C = "Expired"<br>E = "Pending Replace"<br>F = "Trade"  | XONTRO, Xetra, Xetra Ffm-2, MAX-ONE            |
|     |                           | A   | 0 = "New"<br>4 = "Canceled"<br>6 = "Pending Cancel"<br>8 = "Rejected"<br>A = "Pending New"<br>D = "Restated"<br>F = "Trade"<br>I = "Order Status"   | INVESTRO/Vestima                               |
| 156 | SettlCurrFxRateCalc       |     | nur D = "divide" ist zulässig   | XONTRO   |
| 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><br>PartyID        |     | String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DEAG/REAG)  | INVESTRO/Vestima                               |
| 448 | <buyer seller><br>PartyID |     | In Kombination mit PartyIDSource=D<br>Muss das Basisformat <b>KVNr</b> besitzen.<br>Muss eine in XONTRO zugelassene (Käufer/Verkäufer)KVNr sein<br><br>In Kombination mit PartyIDSource=B<br>String(11) Vestima-BIC des Kontrahenten (SELL/BUY) | nicht systemspezifisch<br><br>INVESTRO/Vestima |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 133 von 137

| Tag | Feldname                           | E/A | Restriktionen/Werte  | Handelssystem                                       |
|-----|------------------------------------|-----|--|---|
| 448 | <clearing firm><br>PartyID         |     | Muss das Basisformat <b>KVNr</b> besitzen.<br>Muss eine in XONTRO zugelassene (Clearer)KVNr sein   | nicht systemspezifisch                              |
| 448 | <clearing organization><br>PartyID |     | Muss das Basisformat <b>KVNr</b> besitzen.<br>Muss eine in XONTRO zugelassene KVNr sein  | nicht systemspezifisch                              |
| 448 | <contra firm><br>PartyID           |     | Muss das Basisformat <b>KVNr</b> besitzen.<br>Muss eine in XONTRO zugelassene (Kontrahenten) KVNr sein.<br>Ausnahme: Im TradeCaptureReportSno wird <contra firm> als <b>KVNr</b> und als <b>LEI</b> ausgegeben.  | nicht systemspezifisch                              |
| 448 | <custodian><br>PartyID             |     | String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (DECU/RECU)   | INVESTRO/Vestima                                    |
| 448 | <customer account><br>PartyID      |     | Muss das Basisformat <b>KVNr</b> besitzen.<br>Muss eine in XONTRO zugelassene (SNO-Empfänger)KVNr sein   | nicht systemspezifisch                              |
| 448 | <entering firm><br>PartyID         |     | Ist im Gegensatz zum FIX Standard mandatory.<br>Muss das Basisformat <b>KVNr</b> besitzen.<br>Die KVNr muss der Anschlussinhaber für die mitgelieferte SenderCompID sein. Wird nur eine "Party" geliefert, dann müssen auch alle Restriktionen des Formats <b>ExecutingFirm</b> erfüllt sein.  | nicht systemspezifisch                              |
| 448 | <executing firm><br>PartyID        |     | Muss das Basisformat <b>KVNr</b> besitzen.   |   |
|     |                                    |     | Muss eine in XONTRO zugelassene KVNr mit entsprechender userID sein.   | XONTRO, MAX-ONE                                     |
|     |                                    |     | Muss als zulässige KVNr, die eine MemberID repräsentiert, in Xentric definiert sein.   | Xetra, Xetra Ffm-2                                  |
| 448 | <executing system><br>PartyID      | A   | String<br>folgende Belegung ist möglich:<br>"XETRA"<br>"XETRA-2"<br>"XONTRO"<br>"MAX-ONE"<br>"INVESTRO"  | Xetra, Xetra Ffm-2,<br>XONTRO, MAX-ONE,<br>INVESTRO |
| 448 | <execution venue><br>PartyID       |     | String(12), Code zur Identifizierung des gemeldeten Geschäfts.<br><br>Folgende Belegung ist möglich:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>Konstante "OTC" für OTC-Geschäfte</li> <li>Konstante "SI" für systematische Internalisierer</li> </ul> zur Identifizierung einer Plattform:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>"B" plus BIC (ISO 9662, 11-stellig alphanumerisch)</li> <li>"M" plus MIC (ISO 10383, 4-stellig alphanumerisch)</li> <li>"I" plus IBEI (ISO 16327, 10-stellig alphanumerisch)</li> </ul> | INVESTRO/Vestima                                    |
| 448 | <intermediary><br>PartyID          |     | String(10) numerisch, INVESTRO-Vertriebspartner  | INVESTRO  |
| 448 | <market maker><br>PartyID          |     | Muss das Basisformat <b>KVNr</b> besitzen.   |   |
|     |                                    |     | Muss eine in XONTRO zugelassene (Makler)KVNr sein.   | XONTRO, MAX-ONE                                     |
|     |                                    |     | nicht erforderlich, ignoriert  | INVESTRO/Vestima,<br>Xetra, Xetra Ffm-2             |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 134 von 137

| Tag | Feldname                                | E/A | Restriktionen/Werte   | Handelssystem                     |
|-----|---|-----|---|-----------------------------------|
| 448 | <order origination trader><br>PartyID   |     | String(6), Händlernummer  | XONTRO, MAX-ONE                   |
| 448 | <report originator><br>PartyID          |     | String(11), Code zur Identifizierung des meldenden Instituts  | INVESTRO/Vestima                  |
| 448 | <session><br>PartyID                    | A   | String(5), Xetra MemberID   | Xetra, Xetra Ffm-2                |
|     |   |     | String(4), KVNr des Eingebers   | XONTRO, MAX-ONE, INVESTRO/Vestima |
| 448 | <settlement location><br>PartyID        |     | String(11), Vestima-BIC des Kontrahenten (PSET)   | INVESTRO/Vestima                  |
| 448 | <systematic internaliser><br>PartyID    |     | String(5), Xetra MemberID   | Xetra                             |
| 448 | <client identification code><br>PartyID |     | String(20), client identification code  | XONTRO, MAX-ONE                   |
| 448 | <Execution within firm><br>PartyID      |     | String(20), Execution within firm   | XONTRO, MAX-ONE                   |
| 448 | <Investment Decision Maker><br>PartyID  |     | String(20), Investment Decision Maker   | XONTRO, MAX-ONE                   |
| 452 | PartyRole                               |     | Die folgenden Einträge sind zulässig<br>1 = "Executing Firm"<br>3 = „Client Identification Code“<br>4 = "Clearing Firm"<br>7 = "Entering Firm"<br>10 = "SettlementLocation"<br>12 = "Execution within Firm"<br>11 = "Order Origination Trader"<br>16 = "Executing System"<br>17 = "Contra Firm"<br>21 = "Clearing Organization"<br>24 = "Customer Account"<br>27 = "Buyer Seller"<br>28 = "Custodian"<br>29 = "Intermediary"<br>30 = "Agent"<br>55 = "Session ID"<br>62 = "Report Originator"<br>63 = "Systematic Interliser"<br>66 = "Market Maker"<br>73 = "Execution Venue"<br>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 die Werte 0, 1, 2 und 4 sind in TradeCaptureReport und TradeCaptureReportAck zulässig.<br>Nur der Wert 0 ist in TradeCaptureReportSno zulässig.   | XONTRO                            |
| 523 | PartySubID                              | A   | String(6)<br>letzte 6 Stellen der UserID für <session>  | XONTRO, MAX-ONE, INVESTRO         |
|     |   |     | String(35)<br>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 <b>EnteringFirm</b> (Tag 448)   | nicht systemspezifisch            |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 135 von 137

| Tag | Feldname                | E/A | Restriktionen/Werte  | Handelssystem              |
|-----|-------------------------|-----|--|----------------------------|
| 554 | Password                |     | auf die Länge 8 beschränkt   | nicht systemspezifisch     |
| 625 | TradingSessionSubID     |     | 2 = "Opening auction only"<br>3 = "Main trading"<br>4 = "Closing auction only"<br>6 = "Main auction"<br>100 = "Auction only"<br>101 = "End-of-day auction"<br>102 = "Pending for next auction"<br>103 = "Closing crossing"<br>104 = "Accept surplus"<br>105 = "Special auction"              | Xetra, Xetra Ffm-2         |
|     |                         |     | 2 = "Opening auction only" (EK - EK-Order)<br>6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order)  | XONTRO, <del>MAX-ONE</del> |
|     |                         |     | <del>6 = "Main auction" (KS - Kassa-Order)</del>   | <del>MAX-ONE</del>         |
|     |                         |     | Das Tag wird ignoriert   | INVESTRO/Vestima           |
| 751 | TradeReportRejectReason |     | Nur 99 = "Other" ist zulässig  | XONTRO                     |
| 768 | NoTrdRegTimestamps      |     | Nur der Wert 1 ist in TradeCaptureReport zulässig.<br>Nur die Werte 1 und 2 sind in TradeCaptureReportSno zulässig.  | nicht systemspezifisch     |
| 770 | TrdRegTimestampType     |     | Nur der Wert 1 ist in TradeCaptureReport zulässig.<br>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<br>und bei PartyRole = 16 mit "3" (System)   | nicht systemspezifisch     |
|     |                         | A   | Das Tag wird<br>bei PartyRole = 28<br>mit "4080" (DECU-Safe-Account oder "4090"<br>(RECU-Safe-Account) belegt und<br>bei PartyRole = 30<br>mit "4060" (DEAG-Safe-Account) oder "4070"<br>(REAG-Safe-Account) belegt und<br>bei PartyRole = 27<br>mit "4050" (BUY/Sell--Safe-Account) belegt. | INVESTRO/Vestima           |
| 828 | TrdType                 | A   | OTC Post-trade indicator<br>9001 = ACTX (Agency cross transaction)<br>9002 = CANC (Cancellation)<br>9101 = ACTX CANC (Agency cross transaction<br>and Cancellation)  | XONTRO, MAX-ONE            |
| 829 | TrdSubType              |     | Siehe Kapitel 14 Anhang G: Wertebereich Tag<br>829 TrdSubType (Satzart)  | XONTRO                     |
| 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     |

**FAGSE****BT-FIX Gateway**

13.03.2018

**Rules of Engagement**

Seite 136 von 137

**14 Anhang G: Wertebereich Tag 829 TrdSubType (Satzart)**

| <b>TrdSubType</b> | <b>Beschreibung</b>                     |
|-------------------|---|
| 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 |



**FAGSE**

**BT-FIX Gateway**

**Rules of Engagement**

---

| <b>TrdSubType</b> | <b>Beschreibung</b>                   |
|-------------------|---------------------------------------|
| 9627              | Tagesstorno/Verkauf - INVESTRO        |
| 9913              | Löschung/Kauf - Aufgabe               |
| 9915              | Löschung/Kauf - Aufgabenweitergabe    |
| 9923              | Löschung/Verkauf - Aufgabe            |
| 9925              | Löschung/Verkauf - Aufgabenweitergabe |

---