

# **Boerse Stuttgart AG**

## **EG-Ordertypen**

Version: 1.2

Stand vom: 09.05.2011

## Dokumentenhistorie

<b>Version</b>	<b>Datum</b>	<b>Autor(en)</b>	<b>Beschreibung / Wesentliche Änderungen</b>
0.9	08.07.2009	Mathias Braun	Initiale Erstellung
1.0	22.01.2010	Jörg Schöneberg	Erweiterung
1.1	29.01.2010	Marc Eisenlohr	Nennung Ansprechpartner
1.2	09.05.2011	Jennifer Kullik	Aktualisierung Ansprechpartner

# Inhaltsverzeichnis

<b>1. Einleitung.....</b>	<b>5</b>
1.1 Ziel des Dokuments .....	5
1.2 Zielgruppen .....	5
1.3 Referenzierte Dokumente .....	5
<b>2. Spezifikation der Ordertypen .....</b>	<b>6</b>
2.1 Aufbau der Orderinstruktion.....	6
2.2 Stop Limit Order (SL).....	7
2.2.1 Order Parameter (MT500, MT501) .....	7
2.2.2 Order Parameter (MT595).....	7
2.3 Trailing Stop Order (TS).....	8
2.3.1 Order Parameter (MT500, MT501) .....	8
2.3.2 Order Parameter (MT595).....	8
2.4 One-Cancels-Other(OCO).....	9
2.4.1 Order Parameter (MT500, MT501) .....	9
2.4.2 Order Parameter (MT595).....	9
<b>3. Ansprechpartner .....</b>	<b>10</b>

## Tabellenverzeichnis

Tabelle 1: Order Parameter der Stop Limit Order.....	7
Tabelle 2: Aufbau Textfeld bei Aktivierung der Stop Limit Order.....	7
Tabelle 3: Order Parameter der Trailing Stop Order.....	8
Tabelle 4: Aufbau Textfeld bei Aktivierung der Trailing Stop Limit Order.....	8
Tabelle 5: Order Parameter der OCO Order.....	9
Tabelle 6: Aufbau Textfeld bei Aktivierung des Stop Limits der OCO Order.....	9

# 1. Einleitung

## 1.1 ZIEL DES DOKUMENTS

Das vorliegende Dokument richtet sich an die Nutzer des XONTRO-Systemanschluss KI und beschreibt die Belegung des S.W.I.F.T. Textfeldes (Etikett 72, 1. Zeile) für die am Börsenplatz Stuttgart für Banken und Makler bereitgestellten Funktionalitäten der ereignisgesteuerten Ordertypen (EG-Ordertypen).

## 1.2 ZIELGRUPPEN

Das Dokument ist an folgende Empfänger gerichtet:

- XONTRO-Systembanken via SAKI

## 1.3 REFERENZIERTE DOKUMENTE

Das Dokument enthält Referenzen zu folgenden Dokumenten:

- 1\_swift\_xontro\_5.4.pdf

## 2. Spezifikation der Ordertypen

### 2.1 AUFBAU DER ORDERINSTRUKTION

Jeder EG-Ordertyp benötigt eine Aktivierungsregel, die im Textfeld der Ordereinstellungsnachricht übermittelt wird.

Gemäß [XONTRO SAKI-Konvention] sind folgende Zeichen innerhalb des Textfeldes erlaubt:

- Zeichen: A-Z, a-z, 0-9
- Sonderzeichen: /+-(.)', Leerzeichen

Da das Textfeld eine Limitierung von 25 Zeichen hat, wird für die Instruktion ein Format mit variablen Längen und Feldtrenner verwendet, um die Zeichenanzahl effektiv auszunutzen.

Als Feldtrenner wird ',' gewählt.

Für die Beschreibung der Feldformate der Instruktion wird folgende Notation verwendet:

- **num[n,m]** numerisches Feld mit maximal n Vorkomma und maximal m Nachkommastellen.
- **varchar[n]** alphanumerisches Feld mit maximaler Länge n.
- **char[n]** alphanumerisches Feld mit fixer Länge n.

Um die Art der EG-Order im BS-OM-System identifizieren zu können, steht im ersten Feld der Instruktion jeweils der Typ der EG-Order, gefolgt von ergänzenden Informationen.

Obschon die reine Addition der einzelnen maximalen Feldlängen die maximale Gesamtfeldlänge des Feldes (72) übersteigt, ist inhaltlich sichergestellt, dass dieser Fall in der Realität nicht auftreten wird.

## 2.2 STOP LIMIT ORDER (SL)

### 2.2.1 Order Parameter (MT500, MT501)

Für die Aufgabe einer Stop Limit Order sind neben der Geschäftsart, der Gültigkeit der Order dem Limit und der Gattung, folgende zusätzliche Parameter erforderlich, die in der Instruktion mitgegeben werden müssen:

Parameter	Beschreibung	Format	Wertebereich
EGOrdType	Typ der EG-Order	char[2]	Fixer Wert: SL
StopLim	Stop Limit	Num[6,4]	0 < StopLim <= 999999,9999

Tabelle 1: Order Parameter der Stop Limit Order

Beispiel für Orderinstruktion bei Aufgabe einer Stop Limit Order: **SL?13,0**

### 2.2.2 Order Parameter (MT595)

Bei Aktivierung der Stop Limit Order wird der Bank der Preis oder die Taxe zu dem die Order getriggert wurde in der Triggermeldung (MT595 und GV-Code=060) im Textfeld mitgeteilt. Das Textfeld beinhaltet dann folgende Informationen:

Parameter	Beschreibung	Format	Wertebereich
EGOrdType	Typ der EG-Order	char[2]	Fixer Wert: SL
TriggerPx	Preis zu dem die Order aktiviert wurde	num[6,4]	0 < TriggerPx <= 999999,9999

Tabelle 2: Aufbau Textfeld bei Aktivierung der Stop Limit Order

Beispiel für Inhalt des Textfeldes nach Triggerung einer Stop Limit Order: **SL?12,7**

## 2.3 TRAILING STOP ORDER (TS)

### 2.3.1 Order Parameter (MT500, MT501)

Für die Aufgabe einer Trailing Stop Order sind neben der Geschäftsart, der Gültigkeit der Order und der Gattung, folgende zusätzliche Parameter erforderlich, die in der Instruktion mitgegeben werden müssen:

Parameter	Beschreibung	Format	Wertebereich
EGOrdType	Typ der EG-Order	char[2]	Fixer Wert: TS
TrailType	Legt fest, ob das Trailing Stop Limit prozentual oder absolut berechnet wird	char[1]	Wertebereich: <ul style="list-style-type: none"> <li>○ A für absolut</li> <li>○ P für prozentual</li> </ul>
StopLim	Initiales Stop Limit	num[6,4]	0 < StopLim <= 999999,9999
TrailAmount	Trailing Abstand	num[6,3]	0 < StopLim <= 999999,999

Tabelle 3: Order Parameter der Trailing Stop Order

Beispiel für Orderinstruktion bei Aufgabe einer Trailing Stop Order: **TS?A?8,5?0,7**

### 2.3.2 Order Parameter (MT595)

Bei Aktivierung der Trailing Stop Order wird der Bank der Preis oder die Taxe zu dem die Order getriggert wurde in der Triggermeldung (MT595 und GV-Code=060) im Textfeld mitgeteilt. Das Textfeld beinhaltet dann folgende Informationen:

Parameter	Beschreibung	Format	Wertebereich
EGOrdType	Typ der EG-Order	char[2]	Fixer Wert: TS
StopLim	Berechnetes Trailings Stop Limit bei Aktivierung	num[6,4]	0 < StopLim <= 999999,9999
TriggerPx	Preis zu dem die Order aktiviert wurde	num[6,4]	0 < TriggerPx <= 999999,9999

Tabelle 4: Aufbau Textfeld bei Aktivierung der Trailing Stop Limit Order

Beispiel für Inhalt des Textfeldes nach Triggerung einer Trailing Stop Limit Order: **TS?14,4?14,3**



## 2.4 ONE-CANCELS-OTHER(OCO)

### 2.4.1 Order Parameter (MT500, MT501)

Für die Aufgabe einer OCO Order sind neben der Geschäftsart, der Gültigkeit der Order, dem Limit (Kauf oder Verkauf) und der Gattung, folgende zusätzliche Parameter erforderlich, die in der Instruktion mitgegeben werden müssen:

Parameter	Beschreibung	Format	Wertebereich
EGOrdType	Typ der EG-Order	char[3]	Fixer Wert: OCO
StopLim	Stop Limit	num[6,4]	0 < StopLim <= 999999,9999
LimitSL	Limit der Stop Order Für Market wird der Parameter mit 0 belegt	num[6,4]	0 <= LimitSL <= 999999,9999

Tabelle 5: Order Parameter der OCO Order

Hinweis: Die OCO Order wird unmittelbar nach der Einstellung aktiviert. In diesem Fall wird der Inhalt des Textfeldes gelöscht.

Beispiel für Orderinstruktion bei Aufgabe einer OCO Order: **OCO?9,0?0**

### 2.4.2 Order Parameter (MT595)

Wird das Stop Limit der Order erreicht, wird in der Triggermeldung im Textfeld der Preis zu dem die Stop Order getriggert wurde, mitgeteilt. Das Textfeld beinhaltet dann folgende Informationen:

Parameter	Beschreibung	Format	Wertebereich
EGOrdType	Typ der EG-Order	char[3]	Fixer Wert: OCO
TriggerPx	Preis zu dem Stop Order getriggert wurde	num[6,4]	0 < TriggerPx <= 999999,9999

Tabelle 6: Aufbau Textfeld bei Aktivierung des Stop Limits der OCO Order

Beispiel für Inhalt des Textfeldes nach Triggerung des Stop Limits einer OCO Order: **OCO?8,9**

### 3. Ansprechpartner

Für Fragen zur Einführung der EG-Ordertypen, zur technischen Anbindung, zur Vereinbarung von Tests und zu allen anderen allgemeinen Fragen stehen Ihnen folgende Ansprechpartner zur Verfügung:

Gerold Feller (Projektleitung): Tel. +49 (711) 222985 - 780

Jennifer Kullik (Testbetreuung): Tel. +49 (711) 222985 - 793

eMail: [ordertypen@boerse-stuttgart.de](mailto:ordertypen@boerse-stuttgart.de)

Frank Dinges (Braintrade): Tel. +49 (69) 589978 - 122

Bei Fragen zu tatsächlich aufgegebenen EG-Orders und zur Orderabstimmung wenden Sie sich bitte an die Abteilung Marktsteuerung der Boerse Stuttgart AG:

Tel. +49 (711) 222985 - 799

eMail: [abstimmung@boerse-stuttgart.de](mailto:abstimmung@boerse-stuttgart.de)