



**Anleitung zur Meldung von
Wertpapiergeschäften gemäß
§ 64 Wertpapieraufsichtsgesetz 2007
(WAG 2007)**

Version 3.0

Oktober 2013

Für den Inhalt verantwortlich:

Abteilung III/1 „Markt- und Börsenaufsicht“ der FMA

Die Änderungen zur Version 2.0 wurden gelb hinterlegt.

Inhaltsverzeichnis

I.	Einleitung.....	2
II.	Hinweis zur Darstellung der Geschäftsarten	3
III.	Allgemeine Hinweise.....	5
IV.	Detailangaben und Beispiel zur Befüllung des Meldesatzes	6
V.	Meldesatzinhalt Wertpapierumsatzmeldung.....	7
VI.	Übermittlung der Meldesätze an die FMA	21
1.	Übertragungsweg	21
2.	Ablauf des Verfahrens	21
3.	Physisches Format der EDI Meldung.....	22
4.	Detailangaben zum Format des Meldesatzes	22
5.	Beschreibung des EDIFACT-Kuverts.....	22
6.	Fehlermeldungen der FMA	24
VII.	Formalprüfungen der Meldungen und Fehlercodes.....	25
VIII.	Spezielle Prüfungen.....	37
1.	Allgemeine Prüfung des Meldesatzes	37
2.	Prüfung der Felder zu den Stammdaten des Finanzinstruments.....	37
3.	Prüfung auf Gültigkeit des gemeldeten Geschäftsfalls	37
4.	Fehlercase.....	37
a.	Direktes Börsengeschäft: Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde	38
b.	Direktes Börsengeschäft: Auftraggeber ist Bank/WP-Firma	38
c.	Kommissionsgeschäft: Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde	39
d.	Kommissionsgeschäft: Auftraggeber ist Bank/WP-Firma	39
e.	Kommissionsgeschäft mit Selbsteintritt: Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde	40
f.	Kommissionsgeschäft mit Selbsteintritt: Auftraggeber ist Bank/WP-Firma	40
g.	Echtes Eigengeschäft: Ausführung über Börse	41
h.	Echtes Eigengeschäft: Ausführung über Broker.....	41
IX.	Reihenfolge der Prüfungen	42
	Anhang.....	43

• Einleitung

Gemäß § 64 des Wertpapieraufsichtsgesetzes 2007 – WAG 2007, BGBl. I Nr. 60/2007 sind alle im Gesetzestext angeführten Wertpapiergeschäfte ab 01.11.2007 analog den Bestimmungen der Richtlinie 2004/39/EG bzw. der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 sowie der Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde über die Meldung von Wertpapiergeschäften (Wertpapier-Meldeverordnung 2007 – WPMV 2007) an die Finanzmarktaufsicht (im Folgenden „FMA“) zu melden.

Der Inhalt dieses Dokuments umfasst folgende Punkte, die für die Adaptierung von EDV-Systemen notwendig sind:

- Die Anleitung, wie die einzelnen meldepflichtigen Geschäfte im Meldesatz darzustellen sind
- Detailangaben zur Befüllung der Felder des Meldesatzes
- Prüfungen und Fehlercodes
- Spezifikationen zur elektronischen Übermittlung an die FMA

• Hinweis zur Darstellung der Geschäftsarten

Bezüglich Auftraggeber, Vertragspartei und dgl. können grundsätzlich vier Geschäftstypen unterschieden werden:

- 1) **Direkte Börsegeschäfte**, bei denen der Auftrag eines Kunden ohne Eingriffe direkt an die Börse geleitet wird, mit den Varianten:
 - 1a) Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde
 - 1b) Auftraggeber ist Bank/WP-Firma

- 2) **Kommissionsgeschäfte**, bei denen der Meldepflichtige den Kundenauftrag an einen anderen Broker zur Ausführung weiterleitet, ohne aber in das Geschäft einzutreten, mit den Varianten:
 - 2a) Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde
 - 2b) Auftraggeber ist Bank/WP-Firma

- 3) **Kommissionsgeschäfte mit Selbsteintritt**, bei denen der Kundenauftrag aus dem Nostro des Meldepflichtigen bedient wird oder bei denen dem Kunden ein Mischkurs verrechnet wird, mit den Varianten:
 - 3a) Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde
 - 3b) Auftraggeber ist Bank/WP-Firma

- 4) **Echte Eigengeschäfte** auf das Nostro des Meldepflichtigen, mit den Varianten:
 - 4a) Ausführung über Börse
 - 4b) Ausführung über Broker

Für diese Geschäftsfälle sollte der Meldesatz in den entsprechenden Feldern wie folgt befüllt werden:

Bezeichnung		Auftraggeber	Auftraggeber	Vertragspartner	Vertragspartner	Börsenplatz	Börsliches Geschäft	Eigenbestand	Effektengeschäft	Market-Maker
Felder des Meldesatzes		3	4	5	6	14	15	18	28	38
Direkte Börsegeschäfte: Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde	1a	I	X	leer	leer	WBAH ¹	J	N	K	N
Direkte Börsegeschäfte: Auftraggeber ist Bank/WP-Firma	1b	B/S..	X	leer	leer	WBAH	J	N	K	N
Kommissionsgeschäfte: Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde	2a	I	X	B/S..	X	leer	N	N	K	N
Kommissionsgeschäfte: Auftraggeber ist Bank/WP-Firma	2b	B/S..	X	B/S..	X	leer	N	N	K	N
Kommissionsgeschäfte mit Selbsteintritt: Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde	3a	I	X	B/S..	X	leer	N	J	K	N
Kommissionsgeschäfte mit Selbsteintritt: Bank/WP-Firma	3b	B/S..	X	B/S..	X	leer	N	J	K	N
Echte Eigengeschäfte: Ausführung über Börse	4a	B/S	X	leer	leer	WBAH	J	J	E	J/N
Echte Eigengeschäfte: Ausführung über Broker	4b	B/S	X	B/S..	X	leer	N	J	E	N

Anmerkung:

1. Im Geschäftstyp 3a und 3b sind in den Feldern 5 und 6 die eigene Bankleitzahl bzw. SWIFT-Adresse anzugeben und niemals die interne Kundennummer.
2. Im Geschäftstyp 4a und 4b sind in den Feldern 3 und 4 die eigene Bankleitzahl bzw. SWIFT-Adresse anzugeben.
3. Falls ein Kundengeschäft innerhalb der Bank über die eigenen Bücher sofort mit einem anderen Kundengeschäft ausgeglichen wird, sollte dies mittels zweier Geschäfte gemäß 3a bzw. 3b gemeldet werden.
4. Die Felder 3 und 4 sind immer unterschiedlich zu den Feldern 5 und 6 zu befüllen.

¹ Hier ist der Market Identifier Code (MIC) des Handelsplatzes, an dem die meldepflichtige Transaktion stattgefunden hat, anzugeben. In oben angeführter Tabelle wurde als Beispiel der MIC des Amtlichen Handels der Wiener Börse gewählt.

Legende:

I	Interne Kundennummer
B	Inländische Bankleitzahl
S	SWIFT-Adresse
N	Von der FMA vergebene Nummer (FMA-ID) (FMA-ID), falls B oder S nicht möglich
X	Bankleitzahl, SWIFT-Adresse, von der FMA vergebene Nummer (FMA-ID) oder eine interne Kundennummer
N	Nein: mögliche Befüllung in Feld 38 (Market-Maker)
J	Ja
E	Eigengeschäft
K	Kundengeschäft

• Allgemeine Hinweise

- In den Feldern 8 (Kalenderdatum des tatsächlichen Geschäftsabschlusses) und 9 (Uhrzeit des tatsächlichen Geschäftsabschlusses) ist bei börslichen Geschäften das Datum und die Uhrzeit der Geschäftsausführung an der Börse anzugeben. Bei ausserbörslichen Geschäften sind das Datum und die Uhrzeit des Vertragsabschlusses der Partner anzugeben.
- Handelt es sich bei dem meldepflichtigen Instrument um einen Optionsschein, so ist bei der Befüllung der einzelnen Meldefelder analog der Befüllung bei Derivaten, im Speziellen Optionen, vorzugehen. Eine Ausnahme stellt hierbei Feld 30 (Kontraktgröße) dar: Dieses ist ausschließlich bei Derivaten, und daher nicht bei Optionsscheinen, zu befüllen.
- Handelt es sich bei dem meldepflichtigen Instrument um ein Zertifikat, welches in Prozent notiert, dann ist bei der Befüllung der einzelnen Meldefelder analog der Befüllung bei Anleihen vorzugehen.

Bei in Stück notierten Zertifikaten ist darüber hinaus noch Feld 33 (Bezeichnung des Underlying) zu befüllen.
- Ein Stornomeldesatz darf nicht im Meldefile in einer Zeile vor dem ursprünglichen Meldesatz genannt werden. Dies führt im Rahmen der Verarbeitung zu einer Ablehnung mit Fehler „0161- Ursprungssatz wurde nicht gefunden“.

• **Detailangaben und Beispiel zur Befüllung des Meldesatzes**

Die einzelnen Felder des Meldesatzes sind durch Strichpunkt (;) zu trennen. In der unter V. Meldesatzinhalt Wertpapierumsatzmeldung abgebildeten Tabelle gibt die Spalte „Format“ den Typ des Feldes und seine Maximallänge an:

A20	Alphanumerischer Text, maximal 20 Zeichen lang (auch Sonderzeichen)
N6	Integerzahl, maximal 6stellig
N6,2	Zahl mit maximal 6 Vorkomma- und maximal 2 Nachkommastellen
D8	Datumswert, 8stellig (JJJJMMTT)
T6	Zeitwert, 6stellig (HHMMSS)

Beispiel für die Angabe von Kommastellen:

Kurs 1.200:	Schreibweise im Meldesatz: 1200
Kurs 1.200,50:	Schreibweise im Meldesatz: 1200,5
Kurs 0,25:	Schreibweise im Meldesatz: 0,25

In nachfolgender Tabelle werden Beispiele für die Befüllung des Meldesatzes für folgende Geschäftsfälle angegeben:

- A:** Aktienkauf (1500 Stück) von Wienerberger AG für einen Nichtbankkunden an der Wiener Börse
- B:** Kauf eines Call auf Verbundgesellschaft AG (20 Kontrakte, Juni 2010, Ausübungspreis 54) für einen Nichtbankkunden im Marktsegment derivatives market.at der Wiener Börse
- C:** Kauf eines ATX-Future im Marktsegment derivatives market.at der Wiener Börse (30 Kontrakte, September 2007) als Market-Maker-Geschäft als Eigenposition
- D:** Außerbörslicher Verkauf (230 Stück²) eines Zertifikats auf einen Wasserbasket für einen Nichtbankkunden

² Das in dem Beispiel angeführte Zertifikat notiert in Stück

• **Meldesatzinhalt Wertpapierumsatzmeldung**

Nr.	Feldinhalt, Beschreibung, Wertebereich	Format	Beispiel
1	<p>Art der Identifikation des Meldepflichtigen</p> <p>Legt fest, wie die Identifizierung des Meldepflichtigen im nächsten Feld erfolgt.</p> <p>1. Priorität: B ... Inländische Bankleitzahl 2. Priorität: S ... SWIFT-Adresse</p>	A1	<p>für A,B,C,D:</p> <p>B oder S</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 1 (Identifikation der meldepflichtigen Wertpapierfirma) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>			
2	<p>Identifikation des Meldepflichtigen</p> <p>Es ist die österreichische Bankleitzahl oder die SWIFT-Adresse zu verwenden.</p> <p>Inländische Bankleitzahl SWIFT-Adresse</p>	<p>N5 A8/A11</p>	<p>für A,B,C,D:</p> <p>20111 oder GIBAATWWXXX</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 1 (Identifikation der meldepflichtigen Wertpapierfirma) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>			
3	<p>Art der Identifikation des Auftraggebers - Kunde</p> <p>Legt fest, wie die Identifizierung des Auftraggebers im nächsten Feld erfolgt.</p> <p>1. Priorität: B ... Inländische Bankleitzahl 2. Priorität: S ... SWIFT-Adresse 3. Priorität: N ... Von der FMA vergebene Nummer (FMA-ID), falls B oder S nicht möglich 3. Priorität: I ... Vom Meldepflichtigen vergebene interne Kundennummer, falls B/S/N nicht möglich.</p>	A1	<p>für A,B,D:</p> <p>I</p> <p>für C:</p> <p>B oder S</p>
<p><i>Die Befüllung dieses Feldes wird aufgrund Art. 13 Abs. 4 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 verlangt. Der Auftraggeber des gemeldeten Geschäfts ist ebenfalls in §6 WPMVO 2007 angeführt.</i></p>			



4	<p>Identifikation des Auftraggebers - Kunde</p> <p>Es ist je nach Auftraggeber die Bankleitzahl, FMA ID oder die interne Kundennummer zu melden. Für Kassa- und Terminmarkttransaktionen eines Kunden ist die gleiche Identifikation zu verwenden</p> <p>Inländische Bankleitzahl SWIFT-Adresse Von der FMA vergebene Nummer (FMA-ID), falls B oder S nicht möglich Interne Nummer</p>	<p>N5 A8/A11 A8 A16</p>	<p>für A,B,D: 1234567</p> <p>für C: 20111 oder GIBAATWWXXX</p>
<p><i>Die Befüllung dieses Feldes wird aufgrund Art. 13 Abs. 4 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 verlangt. Der Auftraggeber des gemeldeten Geschäfts ist ebenfalls in §6 WPMVO 2007 angeführt.</i></p>			
5	<p>Art der Identifikation der Gegenpartei –</p> <p>Legt fest, wie die Identifizierung der Vertragspartei im nächsten Feld erfolgt.</p> <p>1. Priorität: B ... Inländische Bankleitzahl 2. Priorität: S ... SWIFT-Adresse 3. Priorität: N ... Von der FMA vergebene Nummer (FMA-ID), falls B oder S nicht möglich.</p>	<p>A1</p>	<p>für A,B,C: leer</p> <p>für D: B oder S</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 20 (Gegenpartei) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006. Die Vertragspartei des gemeldeten Geschäfts ist ebenfalls in §5 Abs. 1. WPMVO 2007 angeführt.</i></p>			



6	<p>Identifikation der Gegenpartei</p> <p>Es ist nach Möglichkeit die Bankleitzahl, falls nicht vorhanden, die SWIFT-Adresse, falls ebenfalls nicht vorhanden eine von der FMA vergebene Nummer (FMA-ID) zu verwenden (FMA-ID) zu verwenden.</p> <p>Inländische Bankleitzahl SWIFT-Adresse FMA-ID³</p>	<p>N5 A8/A11 A8</p>	<p>für A,B,C: leer für D: 52000 oder HAABAT2KXXX</p>
	<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 20 (Gegenpartei) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006. Die Vertragspartei des gemeldeten Geschäfts ist ebenfalls in §5 Abs. 1. WPMVO 2007 angeführt.</i></p>		
7	<p>Geschäftsart</p> <p>Dieses Feld dient der Unterscheidung in Kauf oder Verkauf aus Sicht des Auftraggebers.</p> <p>B ... BUY S ... SELL</p>	<p>A1</p>	<p>für A,B,C: B für D: S</p>
	<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 4 (Kauf-/Verkauf-Indikator) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>		
8	<p>Kalenderdatum des tatsächlichen Geschäftsabschlusses</p> <p>Bei allen Geschäften, auch bei jenen, die in Ländern anderer Zeitzonen abgewickelt werden, ist der Zeitpunkt nach MEZ anzugeben.</p> <p>MEZ-Datum im Format JJJJMMTT</p>	<p>D8</p>	<p>für A,B,C,D: 20070710</p>
	<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 2 (Handelstag) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>		
9	<p>Uhrzeit des tatsächlichen Geschäftsabschlusses</p> <p>Hierbei ist die Uhrzeit in Österreich anzugeben.</p> <p>MEZ-Uhrzeit im Format HHMMSS</p>	<p>T6</p>	<p>für A,B,C,D: 133500</p>
	<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 3 (Handelszeit) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>		

³ Feld 6 (Identifikation der Gegenpartei) darf nicht mit einer FMA-ID befüllt sein, welche mit W beginnt



10	Mitteuropäische Zeit (MEZ) Dieses Feld ist mit blank zu befüllen.	A0	leer
	<i>Hierbei handelt es sich um kein MiFID Feld gemäß Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006. Demnach ist dieses Feld seitens Meldepflichtigen nicht zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.</i>		
11	Kalenderdatum des indirekten Börsegeschäfts Dieses Feld ist mit blank zu befüllen.	D0	leer
	<i>Hierbei handelt es sich um kein MiFID Feld gemäß Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006. Demnach ist dieses Feld seitens Meldepflichtigen nicht zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.</i>		
12	Uhrzeit des indirekten Börsegeschäfts Dieses Feld ist mit blank zu befüllen.	T0	leer
	<i>Hierbei handelt es sich um kein MiFID Feld gemäß Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006. Demnach ist dieses Feld seitens Meldepflichtigen nicht zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.</i>		
13	Mitteuropäische Zeit (MEZ) Dieses Feld ist mit blank zu befüllen.	T0	leer
	<i>Hierbei handelt es sich um kein MiFID Feld gemäß Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006. Demnach ist dieses Feld seitens Meldepflichtigen nicht zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.</i>		

14	<p>Handelsplatz</p> <p>Der Finanzplatz, an dem das Wertpapiergeschäft abgeschlossen wurde. Die Befüllung hat mit dem Market Identifier Code (MIC) zu erfolgen. Hierbei ist eine Verwendung des Segment-MIC dem Operationalen MIC vorzuziehen.</p> <p>Dieses Feld bleibt bei ausserbörslichen Geschäften leer.</p> <p>Wenn in Feld 19 (Kennzeichen der Nummernart) die Identifikationsart Ausländische Derivat-Nummer oder Rolfe & Nolan Nummer verwendet wird, so ist der Handelsplatz immer zu befüllen – unabhängig ob das Geschäft börslich oder ausserbörslich abgeschlossen wurde.</p>	A4	<p>für A,B,C</p> <p>WBAH⁴</p> <p>für D</p> <p>leer</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 20 (Gegenpartei) und MiFID Feld 21 (Identifikation des Handelsplatzes) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006. Der Handelsplatz ist ebenfalls in §5 Abs. 2. WPMVO 2007 angeführt.</i></p>			
15	<p>Kennzeichen börslich</p> <p>J ... Ja, börsliches Geschäft</p> <p>N ... Nein, ausserbörsliches Geschäft</p>	A1	<p>für A,B,C:</p> <p>J</p> <p>für D:</p> <p>N</p>
<p><i>Dieses nationale Feld ist MiFID Feld 20 (Gegenpartei) und MiFID Feld 21 (Identifikation des Handelsplatzes) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 zuordenbar.</i></p>			
16	<p>Stornodatum</p> <p>Stornos von Geschäften müssen durch einen zweiten Meldesatz (Stornosatz) angezeigt werden, der in diesem Feld das Datum des Stornos enthält.</p> <p>Die Felder 1,2 (Kennung des Meldepflichtigen) und 39 (Meldenummer) des Stornosatzes sind analog den Feldern des zu stornierenden Meldesatzes zu befüllen.</p> <p>Datum im Format JJJJMMTT</p>	D8	<p>für A,B,C,D:</p> <p>leer</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 23 (Stornohinweis) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>			

⁴ In dem Marktsegment derivatives market.at gelisteten Derivate sind mit dem Market Identifier Code (MIC) des Amtlichen Handels der Wiener Börse zu melden.

17	<p>Kennzeichen Aktualisierung</p> <p>Wird ein storniertes Geschäft nochmals mit aktualisierten Daten gemeldet, ist in diesem Feld die Meldenummer des stornierten Geschäfts einzutragen.</p>	A25	<p>für A,B,C,D: leer</p>
	<p><i>Hierbei handelt es sich um kein MiFID Feld gemäß Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006. Demnach muss dieses Feld seitens Meldepflichtigen im Falle einer Aktualisierung nicht befüllen werden. Ist dieses technische Feld dennoch befüllt, wird jedoch eine Prüfung der Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.</i></p>		
18	<p>Kennzeichen Eigenbestand</p> <p>Gibt an, ob das Geschäft für bzw. über Eigenbestand abgewickelt wurde.</p> <p>Ist das Feld mit „N“ befüllt, muss das Feld 28 (Effektengeschäft) mit „K“ befüllt sein.</p> <p>J ... Ja, Eigenbestand N ... Nein, Geschäft für fremde Rechnung</p>	A1	<p>für A,B,D: N für C: J</p>
	<p><i>Dieses nationale Feld ist MiFID Feld 5 (Handelseigenschaft) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 zuordenbar.</i></p>		
19	<p>Kennzeichen der Nummernart</p> <p>Gibt an, wie die Identifizierung des Finanzinstruments erfolgt.</p> <p>1. Priorität: S ... ISIN 2. Priorität: E ... Eurex Wien 2. Priorität: O ... ÖTOB 2. Priorität: A ... Ausländische Derivat-Nummer (Product Code z.B. DTE für Deutsche Telekom)⁵ 3. Priorität: R ... Rolfe & Nolan Nummer 4. Priorität: I ... Interne Nummer (nur im Falle eines OTC-Derivats und einer Notierung des Underlyings an einem geregelten Markt zulässig)</p>	A1	<p>für A,D: S für B,C: E und für auslaufende ÖTOB Geschäfte O</p>
	<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 7 (Art der Identifikation des Instruments) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>		

⁵ Am derivatives market.at gelistete Derivate dürfen nicht mittels ausländischer Derivat-Nummer gemeldet werden.



20	<p>Identifikation des Finanzinstruments Gibt die Identifikation des Finanzinstruments an.</p> <p>1. Priorität: S ... ISIN Format A12 2. Priorität: E ... Eurex Format A20⁶ 2. Priorität: O ... ÖTOB Format A15 2. Priorität: A ... Ausländische Derivat-Nummer Format A15 3. Priorität: R ... Rolfe & Nolan Nummer Format A4 4. Priorität: I ... Interne Nummer Format A15 (nur im Falle eines OTC-Derivats und einer Notierung des Underlyings an einem geregelten Markt zulässig.)</p>	A20	<p>für A: AT0000831706</p> <p>für B: Eurex VER_CJUN201000540001 ÖTOB VER10F54</p> <p>für C: ATX07I</p> <p>für D: AT0000A02MR0</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 6 (Identifikation des Instruments) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>			
21	<p>Depotwährung (Nominalwährung, Notierungseinheit)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Anleihen in %-Notiz: Währungscode nach ISO 4217 - Zertifikate in %-Notiz: Währungscode nach ISO 4217 - Aktien in Stücknotiz: XXX - Optionsscheine in Stücknotiz: XXO - Zertifikate in Stücknotiz: XXZ - Derivate in Kontrakte: XXK 	A3	<p>für A: XXX</p> <p>für B,C: XXK</p> <p>für D: XXZ</p>
<p><i>Dieses nationale Feld ist MiFID Feld 10 (Art des Finanzinstruments) und MiFID Feld 17 (Währung der Notierung) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 zuordenbar.</i></p>			

⁶ Eine Anleitung zum Aufbau der EUREX-ID findet sich im Anhang dieses Dokuments.



22	<p>Nominale (Stücke, Kontrakte) Menge, auf die das ausgeführte Geschäft lautet.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Anleihen, Zertifikate: in Nominale - Aktien, Optionsscheine, Zertifikate: in Stück - Derivate: in Kontrakte 	N15,4	<p>für A: 1500</p> <p>für B 20</p> <p>für C 30</p> <p>für D: 230</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 18 (Nominale/Menge) und MiFID Feld 19 (Art der Mengenangabe) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>			
23	<p>Einheit der Effektennotiz Beschreibt die Art des Kurses.</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 ... Stück-Notiz 2 ... Prozent-Notiz 3 ... Promille-Notiz 4 ... Punkte-Notiz 	N1	<p>für A,B,C,D: 1</p>
<p><i>Die Befüllung dieses Feldes wird aufgrund Art. 13 Abs. 3 lit. a der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 verlangt. Die Einheit der Effektennotiz ist ebenfalls in §2 WPMVO 2007 angeführt.</i></p>			
24	<p>Währung des Kurses Währungscode nach ISO 4217</p>	A3	<p>für A,B,C: EUR</p>
<p><i>Dieses nationale Feld ist MiFID Feld 17 (Währung der Notierung) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 zuordenbar.</i></p>			



25	<p>Abschlusskurs/Preis Kurs, zu dem das Geschäft ausgeführt wurde. Im Falle einer Option ist der Optionspreis (Optionsprämie) anzugeben.</p>	N7,4	<p>für A: 54,7 für B: 0,83 für C: 4963,9 für D: 6,6</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 16 (Stückpreis) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>			
26	<p>Wertpapierbezeichnung Dieses Feld ist mit blank zu befüllen.</p>	A0	<p>leer</p>
<p><i>Hierbei handelt es sich um kein MiFID Feld gemäß Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006. Demnach ist dieses Feld seitens Meldepflichtigen nicht zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.</i></p>			
27	<p>Wertpapierart Dieses Feld ist mit blank zu befüllen.</p>	A0	<p>leer</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 10 (Art des Finanzinstruments) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006, welches bereits durch das nationale Feld 21 (Depotwährung/Nominalwährung/Notierungseinheit) näher bestimmt wird. Demnach ist dieses Feld seitens Meldepflichtigen nicht zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.</i></p>			



28	<p>Kennzeichen Effektengeschäft</p> <p>Kennzeichen, ob es sich um ein Eigengeschäft oder ein Kundengeschäft handelt.</p> <p>Ist das Feld mit „E“ befüllt, muss das Feld 18 (Eigengeschäft) mit „J“ befüllt sein.</p> <p>E ... Eigengeschäft K ... Kundengeschäft</p>	A1	<p>für A,B,D: K</p> <p>für C: E</p>
<p><i>Dieses nationale Feld ist MiFID Feld 5 (Handelseigenschaft) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 zuordenbar.</i></p>			
29	<p>Art des Derivats/Optionsscheins</p> <p>C ... Call (Kaufoption, Kaufoptionsschein) P ... Put (Verkaufsoption, Verkaufsoptionsschein) F ... Future, Forward</p>	A1	<p>für A,D: leer</p> <p>für B: C</p> <p>für C: F</p>
<p><i>Dieses nationale Feld ist MiFID Feld 12 (Art des Derivats) und MiFID Feld 13 (Put/Call Verkaufsoption/Kaufoption) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 zuordenbar.</i></p>			
30	<p>Kontraktgröße</p> <p>Menge eines Basiswerts, die mit einem Kontrakt bezogen werden kann.</p> <p>Dieses Feld ist ausschließlich bei Derivaten zu befüllen.</p>	N10,6	<p>für A: leer</p> <p>für B: 50</p> <p>für C: 10</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 15 (Kurs-/Preismultiplikator) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>			



31	Währung des Basispreises der Option Dieses Feld ist mit blank zu befüllen.	N0	leer
<i>Hierbei handelt es sich um kein MiFID Feld gemäß Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006. Demnach ist dieses Feld seitens Meldepflichtigen nicht zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.</i>			
32	Basispreis der Option/des Optionsscheins (Ausübungspreis, Strike price) Preis, der bei Ausübung der Option/des Optionsscheins für den Basiswert zu bezahlen ist.	N10,6	für A,C,D: leer für B: 58
<i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 14 (Ausübungspreis) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i>			



35	<p>Ausübungspreis der Option Dieses Feld ist mit blank zu befüllen.</p>	N0	leer
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 14 (Ausübungspreis) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006, welches bereits durch das nationale Feld 33 (Basispreis der Option des Optionsscheins) näher bestimmt wird. Demnach ist dieses Feld seitens Meldepflichtigen nicht zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.</i></p>			
36	<p>Fälligkeit des Finanzinstruments Datum des letzten Handelstages im Format JJJJMMTT. Dieses Feld ist bei Derivaten, Anleihen, Optionsscheinen und Zertifikaten zu befüllen. Bei unendlich laufenden Finanzinstrumenten ist dieses Feld mit 99991231 zu befüllen. Bei Anleihen mit variabler Verzinsung ist dieses Feld mit der Endfälligkeit zu befüllen.</p>	D8	<p>für A: leer für B: 20100618 für C: 20070921 für D: 20080319</p>
<p><i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 11 (Fälligkeitstag) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i></p>			
37	<p>Open/Close Kennzeichen Kennzeichen für Öffnen/Schließen einer Kauf-/Verkauf-Position zu einem Derivat. O ... Open C ... Close</p>	A1	<p>für A,D: leer für B,C: O</p>
<p><i>Die Befüllung dieses Feldes wird aufgrund Art. 13 Abs. 3 lit. a der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 verlangt. Das Open/Close Kennzeichen ist ebenfalls in § 3 WPMVO 2007 angeführt.</i></p>			



38	Market-Maker Kennzeichen J ... Market-Maker Geschäft N ... Kein Market-Maker Geschäft	A1	für A,B,D: N für C: J
<i>Die Befüllung dieses Feldes wird aufgrund Art. 13 Abs. 3 lit. b der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 verlangt. Das Market-Maker Kennzeichen ist ebenfalls in § 4 WPMVO 2007 angeführt.</i>			
39	Meldenummer Eindeutige interne Nummer des Meldepflichtigen, unter der diese Transaktion in den Geschäftsbüchern geführt wird.	A25	für A,B,C,D: 123456789 oder 789456120 oder ABCDEFG12 oder 741852C
<i>Dieses nationale Feld entspricht MiFID Feld 22 (Referenznummer des Geschäfts) des Anhang I der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006.</i>			

Zusammenfassend für die in der Tabelle angegebenen Beispiele ergeben sich folgende Meldesätze:

Beispiel A:

B;20111;I;1234567;;;B;20070710;133500;;;;;WBAH;J;;;N;S;AT0000831706;XXX;1500;1;EUR;54,7;;;K;;;;;;N;123456789

Beispiel B:

B;20111;I;1234567;;;B;20070710;133500;;;;;WBAH;J;;;N;O;VER_CJUN20100054000;XXK;20;1;EUR;0,20;;;K;C;50;;54;SAT0000746409;;;20100618;O;N;789456120

Beispiel C:

B;20111;B;20111;;;B;20070710;133500;;;;;WBAH;J;;;J;O;ATX07I;XXK;30;1;EUR;4963,9;;;E;F;10;;;SAT0000999982;;;20070921;O;J;ABCDEFG12

Beispiel D:

B;20111;I;1234567;B;52000;S;20070710;133500;;;;;N;;;N;S;AT0000A02MR0;XXZ;230;1;EUR;6,6;;;K;;;;;TBASKET;;;20080319;;N;741852C

Beispiel für die Stornierung von Meldesatz C:

Bei Stornierungen von Meldesätzen müssen nicht mehr alle Felder des Meldesatzes noch einmal übermittelt werden, sondern es genügt die Angabe des Meldepflichtigen (Felder 1 und 2), des Stornodatum (Feld 16) und der Meldenummer (Feld 39) des zu stornierenden Meldesatzes.

B;20111;,,,,,,,,,,,,,20070712;,,,,,,,,,,,,,;ABCDEFG12

Beispiel für eine Aktualisierung (die Zahl der Kontrakte wird auf von 30 auf 50 ausgebessert)

Wird ein storniertes Geschäft nochmals mit aktualisierten Daten gemeldet, kann unter Kz_Aktualisierung (Feld 17) die Meldenummer des stornierten Geschäfts eingetragen werden.

**B;20111;B;20111;,,,B;20070710;133500;,,,WBAH;J;;
ABCDEFG12;J;O;ATX07I;XXK;50;1;EUR;4963,9;,,,E;F;10;,,,SAT0000999982;,,,20070921;
O;J;ABCDEFG13**

• Übermittlung der Meldesätze an die FMA

1. Übertragungsweg

Die elektronische Übermittlung der Meldesätze erfolgt mittels EDIFACT-Adressierung. Dadurch wird das für Geschäftstransaktionen erforderliche, hohe Sicherheitsniveau gewährleistet

2. Ablauf des Verfahrens

Die Daten werden durch das meldepflichtige Institut an die EDI Mailbox „ATBWA“⁸ der FMA der Firma IBM übermittelt. Der Rechner der FMA holt die Informationen ab, prüft die Meldesätze auf formale Richtigkeit und übernimmt sie in das Analyse- und Auswertungssystem.

Überträgt ein Meldepflichtiger die Übermittlung der Meldesätze an einen Meldenden (Spitzeninstitut, anderes Institut, Dienstleister, Geregelter Markt, ...), ist dies der Finanzmarktaufsicht schriftlich mitzuteilen und die Mailbox-Adresse des Meldenden bekanntzugeben. Die FMA prüft, ob der Meldende berechtigt ist, Meldesätze des Meldepflichtigen zu übermitteln, ansonsten werden die Meldesätze nicht angenommen.

Um den Datenverkehr und die Kosten für alle Beteiligten möglichst gering zu halten, erfolgt im Falle der erfolgreichen Übernahme der Meldesätze durch die Finanzmarktaufsicht keine explizite Empfangsbestätigung, im Fehlerfall erhält der Sender einen Bericht mit Hinweisen zur Behebung des Problems.

⁸ Zu Testzwecken hat die FMA eine eigene Testumgebungs-Mailbox „ATBWATEST“ eingerichtet

3. Physisches Format der EDI Meldung

Die Meldesätze sind

- mit einem Strichpunkt als Listentrennzeichen zwischen den Feldern
- in einem gemäß UN/EDIFACT genormten Umschlag an die Mailbox der Finanzmarktaufsicht zu übermitteln.

4. Detailangaben zum Format des Meldesatzes

Die einzelnen Feldwerte des Meldesatzes sind jeweils durch einen Strichpunkt getrennt aufzubereiten, wobei folgendes gilt:

- Kein Feld ist mit führenden oder nachfolgenden Nullen oder Blanks aufzufüllen, ausgenommen Datum und Uhrzeit (z.B. der 10.10.2007, ein Uhr morgens, würde sich so darstellen: 20071010;010000).
- Numerische Felder werden ohne Tausenderpunkt und nur bei Bedarf mit einem Dezimalkomma aufbereitet; auch hier sind keine nachfolgenden Nullen erforderlich, bei einem Feld im Format N7,4 wird z.B. der Wert 15,2 eingetragen.
- Leere Felder werden nicht ausgefüllt, es stoßen in diesem Fall daher zwei Strichpunkte direkt aneinander ohne ein Blank dazwischen.
- Zwei Meldesätze werden voneinander durch ein Carriage Return (CR) bzw. Line Feed (LF) getrennt (plattformabhängig, die Umsetzung erfolgt automatisch am IBM-Rechner).
- Vor dem ersten und nach dem letzten Meldesatz ist ein CR / LF einzufügen.

5. Beschreibung des EDIFACT-Kuverts

Der Business Contact Mailbox Service bietet für die Teilnehmer die gesicherte Übertragung von Daten. Geprüft werden die Identität des Senders durch Benutzernummer, Kennwort und Senderadresse in der Meldung. Daten werden nur angenommen, wenn für den Empfänger eine Mailbox eingerichtet und die Sendung vollständig ist.

Treten Fehler beim Senden der Daten auf, so werden die bereits übertragenen Zeichen gelöscht und die Sendung muss wiederholt werden. Ein Datenaustauschprotokoll der Firma IBM gibt Auskunft über die Verarbeitung und zeigt eventuelle Fehler mit Fehlercode und Text an.



Für die Adressierung werden die im EDIFACT-Standard verwendeten Segmente UNB und UNH verwendet. Der Aufbau dieser Segmente ist wie folgt:

UNB+UNOA:1+Sender+Empfänger+Datum:Uhrzeit+Kontrollwort++BWAMS'UNH+BWA+BWA:0'

wobei folgendes gilt:

Sender der von IBM vergebene Mailboxname
 Empfänger der Mailboxname des Empfängers (ATBWA für die FMA)
 Datum das Sendedatum in der Form JJJJMMTT
 Uhrzeit die Sendezeit in der Form HHMM
 Kontrollwort kann frei gewählt werden, max. 14 Stellen, sinnvoll ist eine laufende Nummer, um eine Kontrolle über die lückenlosen Sendungen zu haben. Achtung: dieses Kontrollwort muss auch im UNZ-Satz aufscheinen.

Nachrichtenklasse ..ein maximal 8-stelliges Code-Wort, das vom Kontrollwort durch zwei Pluszeichen “++” getrennt ist. Im Meldesatz ist hier „BWAMS“ einzutragen, in der Fehlermeldung wird hier durch die Finanzmarktaufsicht „BWAMSERR“ eingetragen. Dies unterstützt eine Zusatzfunktion der Mailbox zum selektiven Auslesen von Sendungen.

Für die Vollständigkeitskontrolle werden am Ende der Sendung die EDIFACT-Segmente UNT und UNZ mit folgendem Aufbau gesendet.

'UNT+Segment-Zähler+BWA'UNZ+1+Kontrollwort'

Segment-Zähler ... 3 (fix)

Achtung: die Meldedaten liegen nach dem Hochkomma des UNH-Segments und enden mit dem Hochkomma vor dem UNT-Segment.

Beispiel:

UNB+UNOA:1+ATPSK+ATBWA+20070713:1700+PSK0001++BWAMS'UNH+BWA+BWA:0'

B;20111;l;1234567;;;B;20070710;133500;;;;;WBAH;J;;;N;S;AT0000831706;XXX;1500;1;EUR;54,7;;;K;;;;;;;N;123456789

B;20111;l;1234567;;;B;20070710;133500;;;;;WBAH;J;;;N;O;VER_CJUN20100054000;XXK;20;1;EUR;0,20;;;K;C;50;;54;SAT0000746409;;;20100618;O;N;789456120

B;20111;B;20111;;;B;20070710;133500;;;;;WBAH;J;;;J;O;ATX07I;XXK;30;1;EUR;4963,9;;;E;F;10;;;SAT0000999982;;;20070921;O;J;ABCDEFG12

'UNT+3+BWA'UNZ+1+PSK0001'

6. Fehlermeldungen der FMA

Wird vom Sammelsystem ein Fehler in einem Meldesatz entdeckt, wird dieser Meldesatz nicht angenommen und eine entsprechende Fehlermeldung an den Absender retourniert. Der Meldesatz ist zu korrigieren und nochmals an die FMA zu übermitteln.

Hinweis: die fehlerhaften Sätze werden in einer Zwischentabelle im FMA-Sammelsystem gespeichert, die von der FMA zur Überprüfung der Einhaltung der Meldepflicht regelmäßig ausgewertet wird. Wird der korrigierte Meldesatz übersandt und sind die Prüfungen nunmehr erfolgreich, wird auch der ursprünglich fehlerhafte Satz aus der Fehlertabelle gelöscht.

Ein mangelhafter Meldesatz wird wie folgt zurückgemeldet:

... fehlerhafter Meldesatz ... Carriage Return/Line Feed ... vierstellige Fehlernummer, Bindestrich, Fehlermeldungstext ... Carriage Return/Line Feed

Im EDI-Kuvert der Fehlermeldung, wird im UNH-Segment BWERR als Nachrichtentyp übergeben.

Beispiel:

UNB+UNOA:1+ATBWA+ATPSK+20070713:1800+BWA0001++BWAMSERR'UNH+BWA+BWERR:0'

B;00001;l;1234567;;;B;20070710;133500;;;;;WBAH;J;;;N;S;AT0000831706;XXX;1500;1;EUR;54,7;;;K;;;;;;;N;123456789

0021-Feld 2: Identifikation des Meldepflichtigen: BLZ ist nicht gültig

B;20111;S;20111;;;B;20070710;133500;;;;;WBAH;J;;;J;O;ATX07l;XXK;30;1;EUR;4963,9;;;E;F;10;;;SAT0000999982;;;20070921;O;J;ABCDEFG12

0042-Feld 4: Identifikation des Auftraggebers: Swift-Adresse ist nicht gültig.

'UNT+3+BWA'UNZ+1+BWA0001'(= ursprünglich übermitteltes Kontrollwort)

• Formalprüfungen der Meldungen und Fehlercodes

Für die Fehlernummern von 0010 bis 0392 gilt ein vierstelliger numerischer Code. Die zweite und dritte Ziffer geben die Nummer des Feldes an, bei dem dieser Fehler festgestellt wurde.

Beispiel:

0161 - Feld 16: Ursprungssatz wurde nicht gefunden

Bei der Übernahme der Meldesätze werden folgende formale Prüfungen durchgeführt:

1. Art der Identifikation des Meldepflichtigen

Dieses Feld darf nicht leer sein und kann folgende Werte annehmen:

B Inländische Bankleitzahl
S SWIFT-Adresse

Fehlermeldungen:

0010 - Feld 01: Art der Identifikation des Meldepflichtigen darf nicht leer sein

0011 - Feld 01: Art der Identifikation des Meldepflichtigen ist falsch

2. Identifikation des Meldepflichtigen

Dieses Feld darf nicht leer sein.

Fehlermeldungen:

0020 - Feld 02: Identifikation des Meldepflichtigen darf nicht leer sein

0021 - Feld 02: Identifikation des Meldepflichtigen: BLZ ist nicht gültig

0022 - Feld 02: Identifikation des Meldepflichtigen: SWIFT-Adresse ist nicht gültig

0024 - Feld 02: Keine Berechtigung zur Nutzung dieser Identifikation



3. Art der Identifikation des Auftraggebers – Kunde

Dieses Feld darf nicht leer sein und kann folgende Werte annehmen:

- B Inländische Bankleitzahl
- S SWIFT-Adresse
- N Von der FMA vergebene Nummer (FMA-ID), falls B oder S nicht möglich
- I Vom Meldepflichtigen vergebene interne Kundennummer

Fehlermeldungen:

- 0030 - Feld 03: Art der Identifikation des Auftraggebers darf nicht leer sein
- 0031 - Feld 03: Art der Identifikation des Auftraggebers muss B, S, N oder I sein

4. Identifikation des Auftraggebers – Kunde

Dieses Feld darf nicht leer sein

Fehlermeldungen:

- 0040 - Feld 04: Identifikation des Auftraggebers darf nicht leer sein
- 0041 - Feld 04: Identifikation des Auftraggebers: Bankleitzahl ist nicht gültig
- 0042 - Feld 04: Identifikation des Auftraggebers: SWIFT-Adresse ist nicht gültig
- 0044 - Feld 04: Identifikation des Auftraggebers: FMA-ID ist nicht gültig
- 0046 - Feld 04: Identifikation des Auftraggebers: interne Nummer zu lang (A16)
- 0047 - Feld 04: Identifikation des Auftraggebers: Kunde und Kontrahent darf nicht ident sein

5. Art der Identifikation der Gegenpartei

Dieses Feld bleibt leer, wenn es sich um ein Börsengeschäft handelt. Bei einem außerbörslichen Geschäft kann das Feld folgende Werte annehmen:

- B Inländische Bankleitzahl
- S SWIFT-Adresse
- N Von der FMA vergebene Nummer (FMA-ID), falls B oder S nicht möglich

Fehlermeldungen:

- 0050 - Feld 05: Art der Identifikation der Gegenpartei muss B, S, N oder leer sein

6. Identifikation der Gegenpartei

Dieses Feld bleibt leer, wenn es sich um ein Börsegeschäft handelt.

Fehlermeldungen:

- 0060 - Feld 06: Identifikation der Gegenpartei darf für diese Art nicht leer sein
- 0061 - Feld 06: Identifikation der Gegenpartei BLZ ist nicht gültig
- 0062 - Feld 06: Identifikation der Gegenpartei SWIFT-Adresse ist nicht gültig
- 0063 - Feld 06: Identifikation der Gegenpartei FMA-ID ist nicht gültig
- 0064 - Feld 06: Identifikation der Gegenpartei darf nicht befüllt sein, wenn Feld 5 leer ist
- 0065 - Feld 06: Identifikation der Gegenpartei bleibt bei Börsegeschäften leer
- 0066 - Feld 06: Diese FMA-ID darf nur als Auftraggeber verwendet werden

7. Geschäftsart

Dieses Feld darf nicht leer sein und kann folgende Werte annehmen:

B	Buy
S	Sell

Fehlermeldungen:

- 0070 - Feld 07: Geschäftsart darf nicht leer sein
- 0071 - Feld 07: Geschäftsart muss B oder S sein

8. Kalenderdatum des tatsächlichen Geschäftsabschlusses

Dieses Feld darf nicht leer sein und muss im Format JJJJMMTT angegeben werden.

Fehlermeldungen:

- 0080 - Feld 08: Kalenderdatum des Geschäftsabschlusses darf nicht leer sein
- 0081 - Feld 08: Kalenderdatum des Geschäftsabschlusses ist kein gültiges Datum
- 0082 - Feld 08: Kalenderdatum des Geschäftsabschlusses liegt außerhalb des Gültigkeitsbereiches
- 0083 - Feld 08: Kalenderdatum des Geschäftsabschlusses darf nicht in der Zukunft liegen
- 0084 - Feld 08: Kalenderdatum des Geschäftsabschlusses liegt nicht innerhalb eines gültigen Handelszeitraums des Finanzinstruments

9. Uhrzeit des tatsächlichen Geschäftsabschlusses

Dieses Feld darf nicht leer sein und muss im Format HHMMSS angegeben werden

Fehlermeldungen:

0090 - Feld 09: Uhrzeit des Geschäftsabschlusses darf nicht leer sein

0091 - Feld 09: Uhrzeit des Geschäftsabschlusses ist keine gültige Uhrzeit

0092 - Feld 09: Uhrzeit des Geschäftsabschlusses liegt nicht innerhalb der Handelszeiten der Wiener Börse

10. Mitteleuropäische Zeit (MEZ)

Dieses Feld ist mit blank zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.

11. Kalenderdatum des indirekten Börsegeschäfts

Dieses Feld ist mit blank zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.

12. Uhrzeit des indirekten Börsegeschäfts

Dieses Feld ist mit blank zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.

13. Mitteleuropäische Zeit (MEZ)

Dieses Feld ist mit blank zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.

14. Handelsplatz

Dieses Feld bleibt leer, wenn es sich um ein ausserbörsliches Geschäft handelt. Bei börslichen Geschäften ist dieses Feld mit einem gültigen Market Identifier Code (MIC) zu befüllen.

Wird in Feld 19 A (Ausländische Derivat-Nummer) oder R (Rolfe & Nolan Nummer) angegeben, muss dieses Feld auch bei ausserbörslichen Geschäften befüllt werden.

Fehlermeldungen:

0140 - Feld 14: Handelsplatz ist nicht gültig

0141 - Feld 14: Bei Befüllung von Feld 19 mit A oder R muss der Handelsplatz angegeben werden

0142 - Feld 14: Bei Befüllung von Feld 15 mit J muss der Handelsplatz angegeben werden

0143 - Feld 14: Bei Befüllung von Feld 15 mit N muss der Handelsplatz leer sein

15. Kennzeichen börslich

Dieses Feld darf nicht leer sein und kann folgende Werte annehmen:

- J Ja, börsliches Geschäft
- N Nein, ausserbörsliches Geschäft

Fehlermeldungen:

- 0150 - Feld 15: Kennzeichen börslich darf nicht leer sein
- 0151 - Feld 15: Kennzeichen börslich muss J oder N sein
- 0152 - Feld 15: Kennzeichen börslich muss mit N befüllt sein, wenn die Identifikation des Finanzinstruments mittels Interner Nummer erfolgt

16. Stornodatum

Dieses Feld kann leer sein. Bei Befüllung muss dieses im Format JJJJMMTT angegeben werden.

Fehlermeldungen:

- 0160 - Feld 16: Stornodatum ist nicht gültig
- 0161 - Feld 16: Ursprungssatz wurde nicht gefunden⁹
- 0162 - Feld 16: Stornodatum liegt außerhalb des Gültigkeitsbereiches
- 0163 - Feld 16: Stornodatum darf nicht in der Zukunft liegen
- 0164 - Feld 16: Stornodatum darf nicht vor tatsächlichen. Geschäftsabschluss liegen
- 0166 - Feld 16: Stornodatum ist zu alt

17. Kennzeichen Aktualisierung

Dieses Feld kann leer sein. Wird die Meldenummer des zu aktualisierenden Satzes angegeben, so wird diese überprüft.

Fehlermeldungen:

- 0170 - Feld 17: Die Meldenummer des zu aktualisierenden Satzes wurde nicht gefunden
- 0171 - Feld 17: Meldenummer hat ungültiges Format (A25)

⁸ Diese Meldung hat nur Informationscharakter und verlangt eine Überprüfung der Meldenummer durch den Melder.

18. Kennzeichen Eigenbestand

Dieses Feld darf nicht leer sein und kann folgende Werte annehmen:

J Ja, Eigenbestand
N Nein, kein Eigenbestand

Fehlermeldungen:

- 0180 - Feld 18: Kennzeichen Eigenbestand darf nicht leer sein
- 0181 - Feld 18: Kennzeichen Eigenbestand muss J oder N sein
- 0184 - Feld 18: Kennzeichen Eigenbestand muss J sein, wenn Kunde oder Kontrahent mit Meldepflichtigen ident ist
- 0185 - Feld 18: Kennzeichen Eigenbestand muss N sein, wenn weder Kunde noch Kontrahent mit Meldepflichtigen ident ist

19. Kennzeichen der Nummernart

Dieses Feld darf nicht leer sein und kann folgende Werte annehmen:

S ISIN
E Eurex
O ÖTOB
A Ausländische Derivat-Nummer
R Rolfe & Nolan Nummer
I Interne Nummer

Fehlermeldungen:

- 0190 - Feld 19: Kennzeichen der Nummernart darf nicht leer sein
- 0191 - Feld 19: Kennzeichen der Nummernart muss S/E/O/A/R/I sein
- 0195 - Feld 19: Kennzeichen der Nummernart – Wertpapiere müssen mit ISIN gemeldet werden
- 0196 - Feld 20: Kennzeichen der Nummernart mittels A ist für den Börsenplatz Wien nicht zulässig

20. Identifikation des Finanzinstruments

Dieses Feld darf nicht leer sein.

Fehlermeldungen:

- 0200 - Feld 20: Identifikation des Finanzinstruments darf nicht leer sein
- 0201 - Feld 20: Identifikation des Finanzinstruments: ISIN hat falsches Format (A12)
- 0204 - Feld 20: Identifikation des Finanzinstruments: Rolfe & Nolan Nummer hat falsches Format (A4)
- 0206 - Feld 20: Identifikation des Finanzinstruments: ISIN-Kennung ist nicht gültig
- 0207 - Feld 20: Identifikation des Finanzinstruments hat ungültiges Format



21. Depotwährung/Nominalwährung/Notierungseinheit

Dieses Feld darf nicht leer sein. Es muss bei Anleihen/Zertifikaten in %-Notiz einen gültigen Währungscode gemäß ISO 4217 enthalten. Bei allen anderen Finanzinstrumenten ist dieses Feld mit einem der folgenden Werte zu befüllen:

XXX	Aktien
XXK	Derivate
XXO	Optionsscheine
XXZ	Zertifikate in Stücknotiz

Fehlermeldungen:

0210 - Feld 21: Feld 21 darf nicht leer sein

0211 - Feld 21: Feld 21 muss XXX/XXK/XXZ/XXO oder ein gültiger Währungscode nach ISO 4217 sein

0213 - Feld 21: Feld 21 Befüllung ist für dieses Finanzinstrument nicht korrekt

22. Nominale (Stücke, Kontrakte)

Dieses Feld darf nicht leer sein.

Fehlermeldungen:

0220 - Feld 22: Nominale darf nicht leer sein

0221 - Feld 22: Nominale hat kein gültiges Format (N15,4)

23. Einheit der Effektennotiz

Dieses Feld darf nicht leer sein und kann folgende Werte annehmen:

1	Stück-Notiz
2	Prozent-Notiz
3	Promille-Notiz
4	Punkte-Notiz

Fehlermeldungen:

0230 - Feld 23: Einheit der Effektennotiz darf nicht leer sein

0231 - Feld 23: Einheit der Effektennotiz muss 1,2,3 oder 4 sein

0232 - Feld 23: Einheit der Effektennotiz und Depotwährung: ungültige Kombination



24. Währung des Kurses

Dieses Feld muss leer sein, wenn Feld 21 (Depotwährung/Nominalwährung/Notierungseinheit) einen gültigen Währungscode nach ISO 4217 enthält.

Ist Feld 21 mit XXX/XXO/XXZ oder XXK befüllt, so ist Feld 24 mit einem gültigen Währungscode nach ISO 4217 zu versorgen.

Fehlermeldungen:

0240 - Feld 24: Währung des Kurses ist für dieses Finanzinstrument nicht korrekt

0241 - Feld 24: Währung des Kurses muss einem gültigen Währungscode nach ISO 4217 entsprechen

25. Abschlusskurs/Preis

Dieses Feld darf nicht leer sein.

Fehlermeldungen:

0250 - Feld 25: Abschlusskurs darf nicht leer sein

0251 - Feld 25: Abschlusskurs hat kein gültiges Format (N7,4)

26. Wertpapierbezeichnung

Dieses Feld ist mit blank zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.

27. Wertpapierart

Dieses Feld ist mit blank zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.

28. Kennzeichen Effektengeschäft

Dieses Feld darf nicht leer sein und kann folgende Werte annehmen:

E	Eigengeschäft
K	Kundengeschäft

Fehlermeldungen:

0280 - Feld 28: Kennzeichen Effektengeschäft darf nicht leer sein

0281 - Feld 28: Kennzeichen Effektengeschäft muss E oder K sein

0282 - Feld 28: Kennzeichen Effektengeschäft muss K sein, da Feld 18 mit N befüllt

0283 - Feld 28: Kennzeichen Effektengeschäft muss E sein, da der Auftraggeber dem Meldepflichtigen entspricht

0284 - Feld 28: Kennzeichen Effektengeschäft muss K sein, da der Auftraggeber unterschiedlich zum Meldepflichtigen ist

29. Art des Derivats/Optionsscheins

Dieses Feld muss bei Derivaten und Optionsscheinen befüllt sein und kann folgende Werte annehmen:

C	Call
P	Put
F	Future

Fehlermeldungen:

- 0290 - Feld 29: Art des Derivats/Optionsscheins muss C,P oder F sein
- 0292 - Feld 29: Optionsscheine können nur die Ausprägung C oder P haben
- 0293 - Feld 29: Art des Derivats/Optionsscheins ist nicht korrekt

30. Kontraktgröße

Dieses Feld muss bei Derivaten befüllt sein.

Fehlermeldungen:

- 0301 - Feld 30: Kontraktgröße hat ungültiges Format (N10,3)

31. Währung des Basispreises der Option

Dieses Feld ist mit blank zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.

32. Basispreis der Option/des Optionsscheins

Dieses Feld darf nicht leer sein, wenn es sich um eine Option bzw. einen Optionsschein handelt.

Fehlermeldungen:

- 0321 - Feld 32: Basispreis der Option/des Optionsscheins hat ungültiges Format (N10,6)



33. Bezeichnung des Underlyings

Dieses Feld darf nicht leer sein, wenn es sich beim übergeordneten Finanzinstrument (Feld 20) um ein Derivat, einen Optionsschein oder um ein Zertifikat in Stücknotiz handelt.

Das Format ist Code (A1) plus Nummer/Bezeichnung (A40).

Der Code (A1) kann folgende Werte annehmen:

S	ISIN
E	Eurex
O	ÖTOB
A	Ausländische Derivat-Nummer
T	mit den möglichen Ausprägungen ¹⁰ :
	TBASKET
	TCOMMODITY
	TMETAL
	TNON-METAL
	TINTEREST
	TCURRENCY

Fehlermeldungen:

- 0331 - Feld 33: Bezeichnung des Underlyings hat ungültiges Format (A41)
- 0332 - Feld 33: Bezeichnung des Underlyings: ISIN ist nicht gültig
- 0334 - Feld 33: Bezeichnung des Underlyings: Eurex/ÖTOB Kennung ist nicht gültig
- 0335 - Feld 33: Bezeichnung des Underlyings: Bei Identifikation des Finanzinstruments mittels Eurex Kennung ist nur E oder S zulässig
- 0336 - Feld 33: Textliche Bezeichnung muss Basket, Commodity, Metal, Nonmetal, Interest oder Currency sein
- 0337 - Feld 33: Bezeichnung des Underlyings muss mit S,E,O,A oder T beginnen
- 0338 - Feld 33: Bezeichnung des Underlyings: Bei Identifikation des Finanzinstruments mittels ÖTOB Kennung ist nur O oder S zulässig
- 0339 - Feld 33: Bezeichnung des Underlyings: hat falsches Format

34. Notierung des Basispreises

Dieses Feld ist mit blank zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.

35. Ausübungspreis der Option

Dieses Feld ist mit blank zu befüllen. Es werden keinerlei Prüfungen auf die Befüllung dieses Feldes durch die FMA vorgenommen.

¹⁰ Vergleich hierzu Fußnote 7.



36. Fälligkeit des Finanzinstruments

Dieses Feld darf nicht leer sein, wenn es sich um ein Derivat, eine Anleihe, einen Optionsschein oder um ein Zertifikat handelt.

Ist dieses Feld befüllt, so ist dieses im Format JJJJMMTT anzugeben.

Fehlermeldungen:

0361 - Feld 36: Fälligkeit des Finanzinstruments hat ungültiges Format (D8)

0362 - Feld 36: Fälligkeitsdatum des Finanzinstruments liegt außerhalb des Gültigkeitsbereiches

37. Open/Close Kennzeichen

Dieses Feld darf nicht leer sein, wenn es sich um ein Derivat handelt.

Ist dieses Feld befüllt, so kann es folgende Werte annehmen:

O Open
C Close

Fehlermeldungen:

0371 - Feld 37: Open/Close Kennzeichen kann nur O oder C sein

38. Market-Maker Kennzeichen

Dieses Feld darf nicht leer sein und kann folgende Werte annehmen:

J Ja, Market Maker Geschäft
N Nein, kein Market Maker Geschäft

Fehlermeldungen:

0380 - Feld 38: Market Maker Kennzeichen darf nicht leer sein

0381 - Feld 38: Market Maker Kennzeichen muss J oder N sein

0382 - Feld 38: Market Maker darf nur bei Echten Eigengeschäften über die Börse mit J befüllt sein

39. Meldenummer

Dieses Feld darf nicht leer sein. Die Meldenummer ist für jeden Meldepflichtigen eindeutig. Für einen Stornosatz ist dieselbe Meldenummer nochmals zu verwenden

Fehlermeldungen:

0390 - Feld 39: Meldenummer darf nicht leer sein

0391 - Feld 39: Meldenummer wurde schon verwendet¹¹

0392 - Feld 39: Meldenummer hat ungültiges Format (A25)

¹¹ Diese Meldung hat nur Informationscharakter und verlangt eine Überprüfung der Meldenummer durch den Melder.

• Spezielle Prüfungen

1. Allgemeine Prüfung des Meldesatzes

Fehlermeldungen:

0601 - Meldesatz hat ungültige Anzahl von Feldern

0900 - Meldesatz kann nicht verarbeitet werden

2. Prüfung der Felder zu den Stammdaten des Finanzinstruments

0700: Bei Anleihen/Zertifikaten in Prozent-Notiz müssen die Felder 29,30,32,33,37 leer sein

0701: Bei Aktien müssen die Felder 29,30,32,33,36,37 leer sein

0702: Bei Optionsscheinen müssen die Felder 29,32,33,36 befüllt, **Feld 30 muss leer** sein

0703: Bei Zertifikaten in Stück-Notiz müssen die Felder 33,36 befüllt sein

0704: Bei Optionen müssen die Felder 29,30,32,33,36,37 befüllt sein

0705: Bei Futures/Forwards müssen die Felder 29,30,33,36,37 befüllt, **Feld 32 muss leer** sein

0706: Die Befüllung der Derivatefelder stimmt nicht mit dem Gattungsstamm des in Feld 20 angeführten Derivats überein

0707: Das in Feld 20 angegebene Derivat bzw. angegebenen Derivatsstammdaten konnten nicht gefunden werden

0708: Die Befüllung der Felder 29,32,33,36 stimmt nicht mit dem Gattungsstamm des in Feld 20 angeführten Optionsscheines überein

0709: Der in Feld 20 angegebene Optionsschein bzw. dessen Stammdaten konnten nicht gefunden werden

0710: Die Befüllung der Felder 33,36 stimmt nicht mit dem Gattungsstamm des in Feld 20 angeführten Zertifikats überein

0711: Das in Feld 20 angegebene Zertifikat bzw. dessen Stammdaten konnten nicht gefunden werden

0712: Die Befüllung des Feldes 36 stimmt nicht mit dem Gattungsstamm der in Feld 20 angeführten Anleihe/Zertifikats in Prozent-Notiz überein

0800: Die Referenzdaten zum angelieferten Finanzinstrument sind nicht korrekt

3. Prüfung auf Gültigkeit des gemeldeten Geschäftsfalls

Bei der Übernahme der Meldesätze in die Datenbank werden die Meldesätze auf die möglichen Geschäftsarten überprüft. Kann keine Geschäftsart identifiziert werden, so bekommt der Meldende folgende Fehlermeldungen retourniert:

0500: Die Kombination aus MP, Kunde, Kontrahent, KZ_Eigenbestand, KZ_Effektengeschäft ist nicht zulässig

4. Fehlercase

0999: Kein Standardtext; es erfolgt eine individuelle inhaltliche Prüfung durch die FMA

Folgende Geschäftsfälle sind möglich:

a. Direktes Börsengeschäft: Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde

Folgende Felder werden geprüft:

Feldnr.	Feldbezeichnung	Wert	Prüfung auf Gültigkeit
3	Art der Identifikation des Auftraggebers	I	
4	Identifikation des Auftraggebers	siehe V/4	
5	Art der Identifikation der Gegenpartei	NULL	
6	Identifikation der Gegenpartei	NULL	
14	Handelsplatz	Not NULL	MIC
15	Börsliches Geschäft	J	
18	Kennzeichen Eigenbestand	N	
28	Kennzeichen Effektengeschäft	K	
38	Market Maker Kennzeichen	N	

b. Direktes Börsengeschäft: Auftraggeber ist Bank/WP-Firma

Folgende Felder werden geprüft:

Feldnr.	Feldbezeichnung	Wert	Prüfung auf Gültigkeit
3	Art der Identifikation des Auftraggebers	B;S;N	
4	Identifikation des Auftraggebers	Not NULL	BLZ; SWIFT; FMA-ID
5	Art der Identifikation der Gegenpartei	NULL	
6	Identifikation der Gegenpartei	NULL	
14	Handelsplatz	Not NULL	MIC
15	Börsliches Geschäft	J	
18	Kennzeichen Eigenbestand	N	
28	Kennzeichen Effektengeschäft	K	
38	Market Maker Kennzeichen	N	

c. Kommissionsgeschäft: Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde

Folgende Felder werden geprüft:

Feldnr.	Feldbezeichnung	Wert	Prüfung auf Gültigkeit
3	Art der Identifikation des Auftraggebers	I	
4	Identifikation des Auftraggebers	siehe V/4	
5	Art der Identifikation der Gegenpartei	B;S;N	
6	Identifikation der Gegenpartei	Not NULL	BLZ; SWIFT; FMA-ID
14	Handelsplatz	NULL ¹²	
15	Börsliches Geschäft	N	
18	Kennzeichen Eigenbestand	N	
28	Kennzeichen Effektengeschäft	K	
38	Market Maker Kennzeichen	N	

d. Kommissionsgeschäft: Auftraggeber ist Bank/WP-Firma

Folgende Felder werden geprüft:

Feldnr.	Feldbezeichnung	Wert	Prüfung auf Gültigkeit
3	Art der Identifikation des Auftraggebers	B;S;N	
4	Identifikation des Auftraggebers	Not NULL	BLZ;SWIFT; FMA-ID
5	Art der Identifikation der Gegenpartei	B;S;N	
6	Identifikation der Gegenpartei	Not NULL	BLZ; SWIFT; FMA-ID
14	Handelsplatz	NULL ¹³	
15	Börsliches Geschäft	N	
18	Kennzeichen Eigenbestand	N	
28	Kennzeichen Effektengeschäft	K	
38	Market Maker Kennzeichen	N	

¹² Ausgenommen, wenn das Feld 19 (Kennzeichen der Nummernart) den Wert A oder R hat

¹³ Ausgenommen, wenn das Feld 19 (Kennzeichen der Nummernart) den Wert A oder R hat

e. Kommissionsgeschäft mit Selbsteintritt: Auftraggeber ist Nichtbank-Kunde

Folgende Felder werden geprüft:

Feldnr.	Feldbezeichnung	Wert	Prüfung auf Gültigkeit
3	Art der Identifikation des Auftraggebers	I	
4	Identifikation des Auftraggebers	siehe V/4	
5	Art der Identifikation der Gegenpartei	B;S;N	
6	Identifikation der Gegenpartei	Not NULL	BLZ; SWIFT; FMA-ID
14	Handelsplatz	NULL ¹⁴	
15	Börsliches Geschäft	N	
18	Kennzeichen Eigenbestand	J	
28	Kennzeichen Effektengeschäft	K	
38	Market Maker Kennzeichen	N	

Bei diesem Geschäftsfall sind die Felder 5 und 6 analog zu Feldern 1 und 2 zu befüllen. (Gegenpartei ist gleich dem Meldepflichtigen)

f. Kommissionsgeschäft mit Selbsteintritt: Auftraggeber ist Bank/WP-Firma

Folgende Felder werden geprüft:

Feldnr.	Feldbezeichnung	Wert	Prüfung auf Gültigkeit
3	Art der Identifikation des Auftraggebers	B;S;N	
4	Identifikation des Auftraggebers	Not NULL	BLZ;SWIFT; FMA-ID
5	Art der Identifikation der Gegenpartei	B;S;N	
6	Identifikation der Gegenpartei	Not NULL	BLZ; SWIFT; FMA-ID
14	Handelsplatz	NULL ¹⁵	
15	Börsliches Geschäft	N	
18	Kennzeichen Eigenbestand	J	
28	Kennzeichen Effektengeschäft	K	
38	Market Maker Kennzeichen	N	

Bei diesem Geschäftsfall sind die Felder 5 und 6 analog zu Feldern 1 und 2 zu befüllen. (Gegenpartei ist gleich dem Meldepflichtigen)

¹⁴ Ausgenommen, wenn das Feld 19 (Kennzeichen der Nummernart) den Wert A oder R hat

¹⁵ Ausgenommen, wenn das Feld 19 (Kennzeichen der Nummernart) den Wert A oder R hat

g. Echtes Eigengeschäft: Ausführung über Börse

Folgende Felder werden geprüft:

Feldnr.	Feldbezeichnung	Wert	Prüfung auf Gültigkeit
3	Art der Identifikation des Auftraggebers	B;S	
4	Identifikation des Auftraggebers	Not NULL	BLZ, SWIFT
5	Art der Identifikation der Gegenpartei	NULL	
6	Identifikation der Gegenpartei	NULL	
14	Handelsplatz	Not NULL	MIC
15	Börsliches Geschäft	J	
18	Kennzeichen Eigenbestand	J	
28	Kennzeichen Effektengeschäft	K	
38	Market Maker Kennzeichen	J; N	

Bei diesem Geschäftsfall sind die Felder 3 und 4 analog zu Feldern 1 und 2 zu befüllen. (Auftraggeber ist gleich dem Meldepflichtigen)

h. Echtes Eigengeschäft: Ausführung über Broker

Folgende Felder werden geprüft:

Feldnr.	Feldbezeichnung	Wert	Prüfung auf Gültigkeit
3	Art der Identifikation des Auftraggebers	B;S;	
4	Identifikation des Auftraggebers	Not NULL	BLZ; SWIFT
5	Art der Identifikation der Gegenpartei	B;S,N	
6	Identifikation der Gegenpartei	Not NULL	BLZ; SWIFT; FMA-ID
14	Handelsplatz	NULL ¹⁶	
15	Börsliches Geschäft	N	
18	Kennzeichen Eigenbestand	J	
28	Kennzeichen Effektengeschäft	E	
38	Market Maker Kennzeichen	N	

Bei diesem Geschäftsfall sind die Felder 3 und 4 analog zu Feldern 1 und 2 zu befüllen. (Auftraggeber ist gleich dem Meldepflichtigen)

¹⁶ Ausgenommen, wenn das Feld 19 (Kennzeichen der Nummernart) den Wert A oder R hat

• Reihenfolge der Prüfungen

Die einzelnen Prüfungen werden in folgender Reihenfolge durchgeführt:

1. Anzahl der Felder pro Meldesatz und Länge eines Meldesatzes
2. Identifizierung des Meldesatzes
3. Berechtigungsprüfung
4. Stornologik
5. Eindeutigkeit (inkl. Änderungssätze)
6. Syntaktische Prüfung der restlichen Felder
7. Logische Prüfung der Felder
8. Prüfung der Felder zu den Stammdaten des Finanzinstruments
9. Prüfung auf Gültigkeit des gemeldeten Geschäftsfalles



Anhang

Anleitung zum Aufbau der EUREX-ID¹⁷

Futures

[Symbol-Code][expiry month][expiry year]

Options

[Symbol-Code][Put or Call][expiry month][expiry year][exercise price][control version number]

Defintion der Abschnitte

Description	Type / Length	Applicable for	Comments
Symbol-Code	char(4)	Futures, Optionen	<ul style="list-style-type: none"> Index-Futures beginnen immer mit 'F' Single-Stock-Futures enden immer mit '[F-Z]'. Index-Options haben ein 'O' am Anfang Stock-Optionen bestehen nur aus dem Symbol / der product ID.
put or call	char(1)	Nur Optionen	'P' oder 'C'
expiry month	char (3)	Futures, Optionen	
expiry year	numeric(4)	Futures, Optionen, Combos	
exercise price	numeric(6)	Nur Optionen	
control version number	numeric(1)	Nur Optionen	Dieser Zähler gibt die Anzahl der Kapitalveränderungen an. „0“ bedeutet nicht kapitalverändert.
control generation number	numeric(1)	Nur Optionen	Dieser Zähler wird für neu eingeführte Serien um eins erhöht. Startwert „1“

Erklärung zu ControlVersionNumber und GenerationNumber:

Bei kapitalveränderten Serien wird die ControlVersionNumber erhöht, die ControlGernerationNumber bleibt unverändert. Bei den dabei neu eingeführten Serien ist die ControlVersionNumber 0, die ControlGernerationNumber wird erhöht. Die ControlGenerationNumber startet bei 1.

¹⁷ Quelle: WBAG.



Beispiele

Future: BWTFMAR2010 oder EBSFMAR2010

Option: AGR_CJAN201000000101 oder AGR_CJAN201000580001