

A.1 MT 502 (erweitert)

Version: SRG 2002

„Order to Buy or Sell“; ; entspricht der Market Practice Deutschland auf Basis des S.W.I.F.T. Standards Release Guide 2002.

◆ Übersicht

(ohne konstante Felder)

Folge	Sub-folge	Tag	Sta-tus	Inhalt
A			M	Allgemeine Information
	:23G:		M	Funktion der Nachricht (Neue Nachricht bzw. Kopie)
	:22F:		M	Transaktionstyp (Order bzw. Zeichnung)
B			M	Einzelheiten über die Order
	:94B:		M	Börsenplatz, an dem die Order gehandelt werden soll
B1			C	Preis
	:90a:		M	Limit bzw. Abschlusspreis
B1			C	Preis
	:90a:		M	Stop-Preis
<u>B1</u>			<u>C</u>	<u>Preis</u>
	:90a:		<u>M</u>	<u>Zweites Preislimit bzw. Trailingabstand</u>
	:22H:		M	Indikator für Kauf/Verkauf
	:22F:		M	Art der Kursfeststellung
	:22F:		M	Art des Limits
	:22F:		O	Sonderbedingungen
	:22F:		O	Limitgültigkeit (Zeitlimit)
	:98A:		C	Verfallsdatum der Order
B2			M	Handelsparteien
	:95R:		M	Bankleitzahl des kontoführenden Kreditinstituts
	:97A:		M	Depotkonto für Wertpapiere
	:97A:		O	Verrechnungskonto (Konto für die Geldzahlung)
	:70C:		O	Telefonnummer für Rückfragen
	:70C:		O	Depotschlüssel (nur bei Verkäufen)
	:70C:		O	Incentive-Merkmal (nur bei Zeichnungen)
	:36B:		M	Stückzahl des geordneten Wertpapiers
	:36B:		C	Höchstzahl bei Stückelung
	:35B:		M	Referenznummer des geordneten Wertpapiers

◆ **Belegungsrichtlinien**

Folge	Sub-folge	Tag	Name	For-mat	Län-ge	Sta-tus	An-zahl	Inhalt/Bemerkungen
A			Allgemeine Information			M	1	
A	:16R:		Blockanfang			M	1	
			Konstante			M	1	„:16R:GENL“
A	:20C:		Referenzbegriff des Senders			M	1	
			Konstante			M	1	„:20C::SEME//NONREF“
A	:23G:		Funktion der Nachricht			M	1	
			Konstante			M	1	„:23G:NEWM“
			Konstante			C	1	„/COPY“ (nur in den Geschäftsvorfällen „Orderanzeige“ und „Orderhistorie“)
A	:22F:		Indikator			M	1	Transaktionstyp
			Konstante			M	1	„:22F::TRTR/“
			Sender-Code			C	1	„ZEKR“ (nur bei SUBS)
			Konstante			M	1	„/“
			Transaktionstyp			M	1	„TRAD“ = Wertpapierkauf/-verkauf „SUBS“ = Zeichnung Neuemission
A	:16S:		Blockende			M	1	
			Konstante			M	1	„:16S:GENL“
B			Einzelheiten über die Order			M	1	
B	:16R:		Blockanfang			M	1	
			Konstante			M	1	„:16R:ORDRDET“
B	:94B:		Ort des Handels			M	1	Börsenplatz
			Konstante			M	1	„:94B::TRAD/“
			Sender-Code			C	1	„ZEKR“ (nur bei FREE)
			Konstante			M	1	„/“
			Ort	c	4	M	1	„EXCH“ = Börse (bei börslich gehandelten Wertpapieren) „OTCO“ = außerbörslich (z.B. bei Investmentfonds, Zeichnung oder Festpreisgeschäft) „FREE“ = Börsenplatz soll vom ausführenden Institut bestimmt werden (im Heimatmarkt)
			Konstante			C	1	„/“ (nur, wenn Freier Text belegt)
			Freier Text	x	..30	C	1	Bei EXCH: Kennungscode der Börse (codiert als MIC) (verpflichtend) (Zulässige Codes werden in den BPD mitgeteilt) Bei OTCO: Name des Systems (optional) Bei FREE wird das Feld nicht belegt.

Folge	Subfolge	Tag	Name	Format	Länge	Status	Anzahl	Inhalt/Bemerkungen
	B1		Preis			C	1	Der Status wird durch den Qualifier in B:22F: (Indikator für Art des Limits) festgelegt: „MAKT“: Die Subfolge B1 darf nicht belegt werden. „LMTO“, „STOP“, „MTLO“: Die Subfolge B1 muss mit dem Limitpreis (LIMI) bzw. dem Abschlusskurs (DEAL) belegt werden. „STLI“: Die Subfolge B1 muss mit dem Limitpreis (LIMI) belegt werden. <u>„OCOO“, „TRST“: Die Subfolge B1 kann mit einem Limitpreis (LIMI) belegt werden.</u>
	B1	:16R:	Blockanfang			M	1	
			Konstante			M	1	„:16R:PRIC“
	B1	:90a:	Preis			M	1	
			Option A:			C		falls der Preis ein Prozentsatz ist
			Konstante			M	1	„:90A:“
			Qualifier	c	4	M	1	„DEAL“ = Abschlusskurs (z.B. bei Festpreisgeschäft) „LIMI“ = Limitpreis <u>„STOP“ = Stop-Preis</u>
			Konstante			M	1	„//PRCT/“
			Preis	d	..15	M	1	
			Option B:			C		falls der Preis ein Betrag ist
			Konstante			M	1	„:90B:“
			Konstante			M	1	„“
			Qualifier	c	4	M	1	„DEAL“ = Abschlusskurs (z.B. bei Festpreisgeschäft) „LIMI“ = Limitpreis „STOP“ = Stop-Preis
			Konstante			M	1	„//ACTU/“
			Währung	a	3	M	1	ISO 4217-Währungscode
			Preis	d	..15	M	1	
	B1	:16S:	Blockende			M	1	
			Konstante			M	1	„:16S:PRIC“
	B1		Preis			C	1	Stop-Preis Folge B1 darf nur belegt werden, wenn B:22F: (Indikator für Art des Limits) = „STLI“ <u>„OCOO“, „TRST“</u>
	B1	:16R:	Blockanfang			M	1	
			Konstante			M	1	„:16R:PRIC“
	B1	:90a:	Preis			M	1	Stop-Preis
			Option A:			C		falls der Preis ein Prozentsatz ist
			Konstante			M	1	„:90A::STOP//PRCT/“
			Preis	d	..15	M	1	

Folge	Sub-folge	Tag	Name	For-mat	Län-ge	Sta-tus	An-zahl	Inhalt/Bemerkungen
			Option B:			C		falls der Preis ein Betrag ist
			Konstante			M	1	„:90B::STOP//ACTU/“
			Währung	a	3	M	1	ISO 4217
			Preis	d	..15	M	1	
	B1	:16S:	Blockende			M	1	
			Konstante			M	1	„:16S:PRIC“
	B1		Preis			C	1	Zweites Preislimit bzw. Trailingabstand Folge B1 darf nur belegt werden, wenn B:22F: (Indikator für Art des Limits) = „OCOO“, „TRST“
	B1	:16R:	Blockanfang			M	1	
			Konstante			M	1	„:16R:PRIC“
	B1	:90a:	Preis			M	1	
			Option A:			C		falls der Preis ein Prozentsatz ist
			Konstante			M	1	„:90A::LIMI//PRCT/“
			Preis	d	..15	M	1	
			Option B:			C		falls der Preis ein Betrag ist
			Konstante			M	1	„:90B::LIMI//ACTU/“
			Währung	a	3	M	1	ISO 4217
			Preis	d	..15	M	1	
	B1	:16S:	Blockende			M	1	
			Konstante			M	1	„:16S:PRIC“
B		:22H:	Indikator			M	1	Indikator für Kauf/Verkauf
			Konstante			M	1	„:22H::BUSE//“
			Indikator	c	4	M	1	„BUYI“ = Kauf „SELL“ = Verkauf
B		:22F:	Indikator			M	1	Art der Kursfeststellung
			Konstante			M	1	„:22F::TRSE//“
			Indikator			M	1	„AUCT“ = Handel zum Kassakurs (Präsenzbörse) bzw. nächste Auktion (XETRA) „CONT“ = Variabler Handel (Präsenzbörse) bzw. Continuous Trading (XETRA) „DIHA“ = Direkthandel
B		:22F:	Indikator			M	1	Art des Limits (Zulässige Codes werden in den BPD mitgeteilt)
			Konstante			M	1	„:22F::TOOR/“
			Sender-Code			C	1	„ZEKR“ (nur bei MTLO ₁ OCOO, TRST und institutsindividuellen Codes)
			Konstante			M	1	„/“
			Indikator	c	4	M	1	„MAKT“ = billigst (bei Kauf) bzw. bestens (bei Verkauf) „LMTO“ = Limitierte Order „STOP“ = Stop Buy-Order (bei Kauf) bzw. Stop Loss-Order (bei Verkauf)

Folge	Sub- folge	Tag	Name	For- mat	Län- ge	Sta- tus	An- zahl	Inhalt/Bemerkungen
								<p>„STLI“ = Stop-Limit „MTLO“ = Market-to-Limit-Order (Teil der Order wird ausgeführt und der Rest limitiert) (nur XETRA) <u>„OCOO“=</u> One Cancels Other-Order „TRST“ = Trailing Stop-Order (siehe Belegungsrichtlinien für die verschiedenen Ausprägungen von OCOO und TRST) oder ein institutsindividueller Code im Format a4, sofern sich dieser nicht mit den oben genannten Codes abbilden lässt.</p>
B		:22F:	Indikator			O	1	Sonderbedingungen (Zulässige Codes werden in den BPD mitgeteilt)
			Konstante			M	1	„:22F::TOOR/“
			Sender-Code			C	1	„ZEKR“ (nur bei ICEB, XBST und institutsindividuellen Codes)
			Konstante			M	1	„/“
			Indikator	c	4	M	1	<p>„ALNO“¹ = All or None (Auftrag muss als Ganzes ausgeführt werden, keine Teilausführung, bei Nichtausführung am Eingangstag bleibt die Order bestehen) „CARE“ = Carefully (interessewährend) „ICEB“ = Iceberg (stückweiser Kauf bzw. Verkauf) (nur XETRA) „XBST“ = XETRA Best-Order oder ein institutsindividueller Code im Format a4, sofern sich dieser nicht mit den oben genannten Codes abbilden lässt</p>
B		:22F:	Indikator			O	1	Limitgültigkeit (Zulässige Codes werden in den BPD mitgeteilt)
			Konstante			M	1	„:22F::TILI/“
			Sender-Code			C	1	„ZEKR“ (nur bei institutsindividuellen Codes)
			Konstante			M	1	„/“
			Indikator	c	4	M	1	<p>„GTMO“ = Good for the month (gültig bis Ultimo) „GDAY“ = Good for the day</p>

¹ Dieser Code entspricht nicht der deutschen Market Practice und ist daher nur im Zusammenhang mit ausländischen Börsenplätzen sinnvoll.

Folge	Sub- folge	Tag	Name	For- mat	Län- ge	Sta- tus	An- zahl	Inhalt/Bemerkungen
								(tagesgültig) „GTCA“ ² = Good until canceled (gültig bis Ausführung bzw. Stornierung) „GTHD“ = Good through date (gültig bis zum Ende des in Feld B:98A: angegebenen Tages) „OPEN“ = Handel zum Eröffnungskurs (Präsenzbörse) bzw. in Opening Auction (XETRA) „CLOS“ = Handel zum Schlusskurs (Präsenzbörse) bzw. Closing Auction (XETRA) „FIKI“ = Fill or Kill (sofortige Ausführung als Ganzes) (nur XETRA) „IOCA“ = Immediate or Cancel (sofortige Ausführung auch in Teilen) oder ein institutsindividueller Code im Format a4, sofern sich dieser nicht mit den oben genannten Codes abbilden lässt
B		:22H:	Indikator			M	1	
			Konstante			M	1	„:22H::PAYM//APMT“
B		:98A:	Datum/Uhrzeit			C	1	Verfallsdatum der Order Feld darf nur belegt werden, wenn auch B:22F:TILI belegt ist Feld muss belegt werden, wenn B:22F:TILI = „GTHD“ Ansonsten kann das Feld belegt werden, um den Kundenwunsch eindeutig darzustellen.
			Konstante			M	1	„:98A:“
			Konstante			M	1	„:“
			Qualifier	c	4	M	1	„EXPI“
			Konstante			M	1	„//“
			Datum	n	8	M	1	JJJJMMTT
	B2		Handelsparteien			M	1	
	B2	:16R:	Blockanfang			M	1	
			Konstante			M	1	„:16R:“
			Code	c	..16	M	1	„TRADPRTY“
	B2	:95R:	Partei			M	1	
			Konstante			M	1	„:95R::INVE/DEBL/“
			BLZ	x	..34	M	1	BLZ des kontoführenden Kreditinstituts

² In Deutschland sind Aufträge i.d.R. maximal gültig bis Jahresende (Präsenzbörse) bzw. 90 Kalendertage (XETRA).

Folge	Sub- folge	Tag	Name	For- mat	Län- ge	Sta- tus	An- zahl	Inhalt/Bemerkungen
B	B2	:97A:	Konto			M	1	Depotkonto
			Konstante			M	1	„:97A::SAFE//“
			Konto	x	..35	M	1	BLZ gefolgt von „/“ und der Kontonummer
	B2	:97A:	Konto			O	1	Konto für die Geldzahlung
			Konstante			M	1	„:97A::CASH//“
			Konto	x	..35	M	1	BLZ gefolgt von „/“ und der Kontonummer
	B2	:70C:	Freier Text			C	1	Kontaktpartei (Angabe verpflichtend, falls in BPD gefordert)
			Konstante			M	1	„:70C::PACO//“
			Freier Text	x	..35	M	1	Telefonnummer für Rückfragen
	B2	:70C:	Freier Text			O	1	Depotdetails
			Konstante			M	1	„:70C::SKDE//“
			Freier Text	x	..35	M	1	Depotschlüssel des zu verkaufenden Wertpapiers (nur bei Verkäufen) Dieser ist z.B. bei gesperrten Depotpositionen notwendig. Wenn in der Depotanzeige im MT 535 ein Depotschlüssel mitgeliefert wird, sollte dieser bei einer Verkauforder eingestellt werden.
	B2	:70C:	Freier Text			O	1	Incentive-Merkmal
			Konstante			M	1	„:70C::INCE//“
			Freier Text	x	..35	M	1	z.B. AIF-Kennzeichen Feld darf nur bei Zeichnungen belegt werden
	B2	:16S:	Blockende			M	1	
			Konstante			M	1	„:16S:TRADPRTY“
	B	:36B:	Stückzahl des Finanzinstruments			M	1	
			Konstante			M	1	„:36B::ORDR//“
			Typ			M	1	„FAMT“ = Die Stückzahl wird als Nennbetrag ausgedrückt „UNIT“ = Die Stückzahl wird als Zahl (Zähler) ausgedrückt
			Konstante			M	1	„/“
			Stückzahl	d	..15	M	1	
	B	:36B:	Stückzahl des Finanzinstruments			C	1	
			Konstante			M	1	„:36B:“
Konstante					M	1	„:“	
Qualifier			c	4	M	1	„MAXF“: Höchstzahl bei Stückelung darf nur bei Iceberg-Order (B:22F:TOOR = ICEB) belegt werden. „ORDU“: Ursprungsmenge der Order	
Konstante					M	1	„//“	

Folge	Sub- folge	Tag	Name	For- mat	Län- ge	Sta- tus	An- zahl	Inhalt/Bemerkungen	
B			Typ			M	1	„FAMT“ = Die Stückzahl wird als Nennbetrag ausgedrückt „UNIT“ = Die Stückzahl wird als Zahl (Zähler) ausgedrückt	
			Konstante			M	1	„/“	
			Stückzahl	d	..15	M	1		
		:35B:		Kennung des Finanzinstruments			M	1	
		Konstante				M	1	„:35B:“	
		Konstante				C	1	„ISIN“ (nur, wenn ISIN angegeben wird)	
		Konstante				C	1	„ „ (Leerzeichen; nur, wenn ISIN angegeben wird)	
		ISIN-Kennung		x	..12	O	1		
		Konstante				C	1	<CR><LF> (nur, wenn ISIN angegeben wird)	
		Freier Text		x	..35	C	4	Wird keine ISIN angegeben, so ist in der ersten Zeile „/DE/“ gefolgt von der deutschen Wertpapierkennnummer (WKN) anzugeben. In den nicht belegten Zeilen kann die Wertpapierbezeichnung angegeben werden. Bei der Ordereinreichung darf im Gegensatz zur Orderanzeige keine Bezeichnung angegeben werden. Bei der Ordereinreichung darf im Gegensatz zur Orderanzeige nur entweder ISIN oder WKN angegeben werden. Falls ISIN und WKN gemeinsam angegeben werden, ist die WKN in die erste Zeile und die Bezeichnung in die Zeilen 2-4 einzustellen. Die Zeilen werden mit <CR><LF> getrennt.	
B		:16S:	Blockende			M	1		
			Konstante			M	1	„:16S:ORDRDET“	

◆ **Belegung der Preise in Subfolge B1 für OCOO und TRST**

▪ **Ordertyp „One-Cancels-Other“**

Folge B :22F: (Art des Limits): „:22F::TOOR/ZEKR/OCOO“

• **OCO mit Limit Verkauf und Stop-Loss-Market**

Subfolge B1 :90A: bzw. :90B: (Limit)

<u>Position 1</u>	<u>Position 2</u>	<u>Position 3</u>
<u>leer</u>	<u>Stop-Loss</u> <u>(Aktivierungslimit) als</u> <u>Prozentsatz oder Betrag</u> <u>(Stop-Loss-Order)</u>	<u>Limit als Prozentsatz</u> <u>oder Betrag (Limitorder)</u>

• **OCO mit Limit Verkauf und Stop-Loss-Limit**

Subfolge B1 :90A: bzw. :90B: (Limit)

<u>Position 1</u>	<u>Position 2</u>	<u>Position 3</u>
<u>Limit als Prozentsatz</u> <u>oder Betrag (Stop-</u> <u>Limit-Order)</u>	<u>Stop-Loss</u> <u>(Aktivierungslimit) als</u> <u>Prozentsatz oder Betrag</u> <u>(Stop-Limit-Order)</u>	<u>Limit als Prozentsatz</u> <u>oder Betrag (Limitorder)</u>

• **OCO mit Limit Kauf und Stop-Buy-Market**

Subfolge B1 :90A: bzw. :90B: (Limit)

<u>Position 1</u>	<u>Position 2</u>	<u>Position 3</u>
<u>leer</u>	<u>Stop-Buy (Aktivierungslimit)</u> <u>als Prozentsatz oder Betrag</u> <u>(Stop-Buy-Order)</u>	<u>Limit als Prozentsatz</u> <u>oder Betrag (Limitorder)</u>

• **OCO mit Limit Kauf und Stop-Buy-Limit**

Subfolge B1 :90A: bzw. :90B: (Limit)

<u>Position 1</u>	<u>Position 2</u>	<u>Position 3</u>
<u>Limit als Prozentsatz</u> <u>oder Betrag (Stop-</u> <u>Limit-Order)</u>	<u>Stop-Buy (Aktivierungslimit)</u> <u>als Prozentsatz oder Betrag</u> <u>(Stop-Limit-Order)</u>	<u>Limit als Prozentsatz</u> <u>oder Betrag (Limitorder)</u>

▪ **Ordertyp „Trailing-Stop“**

Folge B :22F: (Art des Limits): „:22F::TOOR/ZEKR/TRST“

• **Trailing Stop bei einer Stop-Market-Order**

Subfolge B1 :90A: bzw. :90B: (Limit)

<u>Position 1</u>	<u>Position 2</u>	<u>Position 3</u>
<u>leer</u>	<u>Stop-Limit</u> <u>(Aktivierungslimit) als</u> <u>Prozentsatz oder Betrag</u>	<u>Trailingabstand als</u> <u>Prozentsatz oder Betrag</u>

• **Trailing Stop bei einer Stop-Limit-Order**

Subfolge B1 :90A: bzw. :90B: (Limit)

<u>Position 1</u>	<u>Position 2</u>	<u>Position 3</u>
<u>Limitaufschlag/-</u> <u>abschlag als Betrag</u>	<u>Stop-Limit</u> <u>(Aktivierungslimit) als</u> <u>Prozentsatz oder Betrag</u>	<u>Trailingabstand als</u> <u>Prozentsatz oder Betrag</u>

◆ **Beispiel**

Einfaches Beispiel für Kauf eines Aktienpapiers:

Folge Sub- folge	Beispiel
A	:16R:GENL :20C::SEME//NONREF :23G:NEWM :22F::TRTR//TRAD :16S:GENL
B	:16R:ORDRDET :94B::TRAD//EXCH/XFRA :22H::BUSE//BUYI :22F::TRSE//AUCT :22F::TOOR//MAKT :22H::PAYM//APMT
B2	:16R:TRADPRTY :95R::INVE/DEBL/10020030

Folge	Sub- folge	Beispiel
		:97A::SAFE//10020030/1234567 :70C::PACO//030/1234567 :16S:TRADPRTY :36B::ORDR//UNIT/100, :35B:ISIN DE0123456789 :16S:ORDRDET -

◆ **Beispiel**

Beispiel für Verkauf eines Rentenpapiers mit Angabe von Stop-Limit und Sonderbedingungen:

Folge	Sub- folge	Beispiel
A		:16R:GENL :20C::SEME//NONREF :23G:NEWM :22F::TRTR//TRAD :16S:GENL
B		:16R:ORDRDET :94B::TRAD//EXCH/XFRA
	B1	:16R:PRIC :90A::LIMI//PRCT/99,75 :16S:PRIC
	B1	:16R:PRIC :90A::STOP//PRCT/97,25 :16S:PRIC :22H::BUSE//SELL :22F::TRSE//CONT :22F::TOOR//STLI :22F::TOOR//CARE :22F::TILI//GTHD :22H::PAYM//APMT :98A::EXPI//19990331

Folge	Sub- folge	Beispiel
	B2	:16R:TRADPRTY :95R::INVE/DEBL/10020030 :97A::SAFE//10020030/1234567 :97A::CASH//10020030/987654321 :70C::PACO//030/1234567 :70C::SKDE//9876543210 :16S:TRADPRTY :36B::ORDR//FAMT/50000, :35B:/DE/987654 :16S:ORDRDET -

◆ **Beispiel**

Beispiel für Zeichnung einer Neuemission:

Folge	Sub- folge	Beispiel
A		:16R:GENL :20C::SEME//NONREF :23G:NEWM :22F::TRTR//SUBS :16S:GENL
B		:16R:ORDRDET :94B::TRAD//OTCO
	B1	:16R:PRIC :90B::LIMI//ACTU/EUR52,7 :16S:PRIC :22H::BUSE//BUYI :22F::TRSE//AUCT :22F::TOOR//LMTO :22H::PAYM//APMT
	B2	:16R:TRADPRTY :95R::INVE/DEBL/10020030 :97A::SAFE//10020030/1234567

Folge	Sub- folge	Beispiel
		:70C::INCE//12345678901234567890
		:16S:TRADPRTY
		:36B::ORDR//UNIT/100,
		:35B:ISIN DE9876543210
		:16S:ORDRDET
		-

