

### A.1.1.1 Wertpapierstammdaten (Segmentversion 4)

Realisierung Bank: optional

Realisierung Kunde: optional



Die Stammdaten sind so definiert, dass sie direkt vom liefernden Unternehmen (z.B. WM) übernommen werden können. Dabei ist kreditinstitutsseitig zu berücksichtigen, dass evtl. lizenzrechtliche Probleme bestehen können, falls diese Daten an Kunden weitergegeben werden.

#### a) Kundenauftrag

##### ◆ Beschreibung

Es können pro Segment nur die Stammdaten eines Wertpapiers erfragt werden. Falls die Stammdaten mehrerer Wertpapiere gewünscht werden, ist je Wertpapierreferenz ein Segment in die Nachricht einzustellen.

##### ◆ Format

Name: Wertpapierstammdaten anfordern

Typ: Segment

Segmentart: Geschäftsvorfall

Kennung: HKWSD

Bezugssegment: -

Version: 4

Sender: Kunde

Nr.	Name	Versi on	Typ	For- mat	Län- ge	Sta- tus	An- zahl	Restriktionen
1	Segmentkopf	1	DEG			M	1	
2	Depot	3	DEG	ktv	#	C	1	M: „Depot erforderlich“ (BPD) = „J“ O: sonst
3	Wertpapierreferenz	2	DEG			M	1	

##### ◆ Belegungsrichtlinien

##### Wertpapierreferenz

Es ist die Referenznummer des gewünschten Wertpapiers anzugeben. Falls dem Kunden für dasselbe Wertpapier mehrere verschiedene Referenzen (z.B. WKN und ISIN) mitgeteilt wurden, so ist es dem Kunden freigestellt, welche Referenz er angibt.

#### b) Kreditinstitutsrückmeldung

##### ◆ Beschreibung

Dem Kreditinstitut ist freigestellt, in welchem Umfang es dem Kunden Stammdaten zur Verfügung stellt.

◆ **Format**

Name: Wertpapierstammdaten rückmelden  
Typ: Segment  
Segmentart: Geschäftsvorfall  
Kennung: HIWSD  
Bezugssegment: HKWSD  
Version: [4](#)  
Anzahl: 1  
Sender: Kreditinstitut

Nr.	Name	Versi on	Typ	For- mat	Län- ge	Sta- tus	An- zahl	Restriktionen
1	Segmentkopf	1	DEG			M	1	
2	Wertpapierreferenz	2	DEG			M	1	
3	Wertpapierbezeichnung	2	DE	an	..99	M	1	
4	Einheit der Effektennotiz	2	DE	code	1	M	1	1, 2, 3, 4, 9
5	Wertpapierkategorie	2	DE	code	1	M	1	1, 2, 3, 4
6	Wertpapierart	1	DE	num	..3	O	1	
7	Wertpapiergruppe	2	DE	an	..2	O	1	
8	Wertpapierart, Text	1	DE	an	..99	O	1	
9	<a href="#">Kennzeichen komplexes Finanzinstrument</a>	<a href="#">1</a>	<a href="#">DE</a>	<a href="#">code</a>	<a href="#">1</a>	<a href="#">O</a>	<a href="#">1</a>	<a href="#">J,K,N</a>
10	<a href="#">Best-Execution-Börsenplatz</a>	<a href="#">1</a>	<a href="#">DE</a>	<a href="#">an</a>	<a href="#">4</a>	<a href="#">O</a>	<a href="#">1</a>	
11	<a href="#">Depot</a>	<a href="#">3</a>	<a href="#">DEG</a>	<a href="#">ktv</a>	<a href="#">#</a>	<a href="#">O</a>	<a href="#">1</a>	
12	<a href="#">Kennzeichen Execution-Only-Depot</a>	<a href="#">1</a>	<a href="#">DE</a>	<a href="#">in</a>	<a href="#">#</a>	<a href="#">O</a>	<a href="#">1</a>	
13	<a href="#">Direkthandel-Depot</a>	<a href="#">1</a>	<a href="#">DE</a>	<a href="#">in</a>	<a href="#">#</a>	<a href="#">O</a>	<a href="#">1</a>	
14	Depotwährung	1	DE	cur	#	O	1	
15	Abrechnungswährung	1	DE	cur	#	O	1	
16	Ordern möglich	2	DE	code	1	O	1	0, 1, 2, 3, 4
17	Risikoklasse des Wertpapiers	1	DE	an	..2	O	1	
18	Emittent	1	DE	num	6	O	1	
19	Weitere Informationen	1	DE	txt	.. 2048	O	1	
20	Stammdaten Aktien	2	DEG			C	1	M: „Wertpapierkategorie“=1 N: sonst
21	Stammdaten Renten	2	DEG			C	1	M: „Wertpapierkategorie“=2 N: sonst
22	<a href="#">Stammdaten Fonds</a>	<a href="#">2</a>	DEG			C	1	M: „Wertpapierkategorie“=3 N: sonst
23	Stammdaten Optionsscheine	1	DEG			C	1	M: „Wertpapierkategorie“=4 N: sonst
24	Börsenplatzinformation	3	DEG			O	99	

#### ◆ Belegungsrichtlinien

##### Wertpapierreferenz

Es wird dem Kunden diejenige Referenz zurückgemeldet, die er im Auftrag angegeben hat. Somit dient diese Information nur zur Zuordnung vom Auftrag zur Antwort und nicht der Übermittlung weiterer Referenzarten, wie bspw. bei der Abfrage der Referenznummern (vgl. Kap. xyz).

##### Einheit der Effektennotiz

Die Angabe ist verpflichtend, damit bei der Wertpapierorder die Information vorhanden ist, ob die Angabe in Feld B2:36B: in Stück („UNIT“) oder als Nennwert („FAMT“) erfolgen muss.

## Kennzeichen komplexes Finanzinstrument

Ist das Feld nicht oder mit „K“ belegt, so ist nicht ermittelbar, ob es sich um ein komplexes Finanzinstrument handelt.

### Weitere Informationen

Besonderer Belegung wegen gesetzlicher Anforderungen (siehe Herstellerhinweise unter C.4)

#### c) Bankparameterdaten

##### ◆ Format

Name: Wertpapierstammdaten Parameter  
Typ: Segment  
Segmentart: Geschäftsvorfall  
Kennung: HIWSDS  
Bezugssegment: HKVVB  
Version: 4  
Sender: Kreditinstitut

Nr.	Name	Versi on	Typ	For- mat	Län- ge	Sta- tus	An- zahl	Restriktionen
1	Segmentkopf	1	DEG			M	1	
2	Maximale Anzahl Aufträge	1	DE	num	..3	M	1	
3	Anzahl Signaturen mindestens	1	DE	num	1	M	1	0, 1, 2, 3
4	Sicherheitsklasse	1	DE	code	1	M	1	0, 1, 2, 3, 4
5	Parameter Wertpapierstammdaten	1	DEG			M	1	

#### A.1.1.1.2 Orderstatus (Segmentversion 5)

Mit diesem Geschäftsvorfall kann der Kunde die Stati aller Order zu seinen Depots, für die er legitimiert ist, abfragen. Es können sowohl die Order zu einem oder zu allen Depots abgefragt werden. Es ist dem Kreditinstitut freigestellt, ob es nur offene oder auch abgerechnete Order zurückmeldet.

Es wird eine genaue Eingrenzung der vom Kunden gewünschten Information ermöglicht. Mit dem Auftragsfilter kann z.B. spezifiziert werden, zu welchen konkreten Ordnern Informationen angefordert werden, der Zeitraum kann eingegrenzt oder die Auswahl kann unter dem Gesichtspunkt bestimmter Stati gesteuert werden.

Der Geschäftsvorfall kann ebenfalls dazu benutzt werden, die Auftragsidentifikation bzw. Ordnernummer für diejenigen Kundensysteme, die diese Nummer nicht lokal ablegen können, zu übermitteln, um diesen diese Möglichkeit zu geben, den Auftrag bei einer Änderung oder Streichung zu referenzieren.

Realisierung Bank: optional

Realisierung Kunde: optional

#### a) Kundenauftrag

Durch die Angabe von vorgesehenen Kriterien (z.B. Auftragsidentifikation, Zeitraum, Auftragsfilter) lassen sich die anzufordern Orders weiter einschränken.

◆ **Format**

Name: Orderstatus anfordern  
 Typ: Segment  
 Segmentart: Geschäftsvorfall  
 Kennung: HKWSO  
 Bezugssegment: -  
 Version: [5](#)  
 Sender: Kunde

Nr.	Name	Version	Typ	Format	Länge	Status	Anzahl	Restriktionen
1	Segmentkopf	1	DEG			M	1	
2	Depot	3	DEG	ktv	#	M	1	
3	Alle Depots	1	DE	jn	#	M	1	
4	Orderauskunft gewünscht		DE	jn	#	C	1	M: „Orderauskunft gewünscht erlaubt“ BPD = J N: sonst
5	Weitere Informationen gewünscht	1	DE	jn	#	M	1	
6	Nur selbst erteilte Aufträge	1	DE	jn	#	M	1	
7	Auftragsidentifikation	1	DE	an	..99	O	1	
8	Ordernummer	1	DE	an	..99	O	1	
9	Zeitraum von	1	DE	dat	#	O	1	
10	Zeitraum bis	1	DE	dat	#	O	1	
11	<a href="#">Auftragsfilter</a>	<a href="#">4</a>	DEG			O	1	
12	Maximale Anzahl Einträge	1	DE	num	..4	O	1	>0
13	Aufsetzpunkt	1	DE	an	..35	C	1	M: vom Institut wurde ein Aufsetzpunkt rückgemeldet N: sonst

◆ **Belegungsrichtlinien**

**Depot**

Hier ist die Nummer des Depots einzustellen, für das die Orderanzeige eingeholt werden soll. Wird die Abfrage über alle Depots gestellt, so ist ein beliebiges gültiges Depot des Kunden anzugeben.

b) **Kreditinstitutsrückmeldung**

◆ **Beschreibung**

Dieser Geschäftsvorfall dient gleichzeitig als Splittinginformation. Wird der Auftrag vom Ordersystem in mehrere Einzelorder gesplittet, werden auf diesem Weg die jeweilige Orderreferenz sowie die zugehörigen Informationen übermittelt.

Für jede Order und für jede Teilausführung wird ein Segment zurückgemeldet.

◆ **Format**

Name: Orderstatus  
 Typ: Segment  
 Segmentart: Geschäftsvorfall  
 Kennung: HIWSO  
 Bezugssegment: HKWSO  
 Version: [5](#)  
 Anzahl: n  
 Sender: Kreditinstitut

Nr.	Name	Version	Typ	Format	Länge	Status	Anzahl	Restriktionen
1	Segmentkopf	1	DEG			M	1	
2	Depot	3	DEG	ktv	#	M	1	
3	<a href="#">Wertpapierorderstatus</a>	<a href="#">3</a>	DE	code	..2	M	1	0- <a href="#">17</a>
4	Ordersplitt	1	DE	jn	#	M	1	
5	Order änderbar	1	DE	jn	#	M	1	
6	Auftragsidentifikation	1	DE	an	..99	C	1	M: „Ordernummer“ leer O: sonst
7	Ordernummer	1	DE	an	..99	C	1	M: „Auftragsidentifikation“ leer O: sonst
8	Vormerkungszeitpunkt	1	DEG	tsp	#	O	1	
9	Gültigkeitszeitpunkt	1	DEG	tsp	#	O	1	
10	Orderanzeigeinformation	1	DEG			C	1	M: „Orderauskunft gewünscht“ = J N: sonst
11	Ausführungsanzeige	1	DE	bin	..	C	1	O: Auftrag wurde ausgeführt bzw. teilausgeführt N: sonst
12	Wertpapierabrechnung	1	DE	bin	..	C	1	O: Auftrag wurde abgerechnet N: sonst

◆ **Belegungsrichtlinien**



Aufgrund neuer Ordertypen und anderer Anforderungen wurde das bisherige S.W.I.F.T.-Format MT 502 „SRG 2002“ so modifiziert, dass diese abgebildet werden können. Die betreffende Version findet sich im Band Finanzdatenformate [Datenformate] unter „MT 502(erweitert)“ beschrieben.



**Auftragsidentifikation**

Es kann die Auftragsidentifikation aus der Rückmeldung auf die Ordereinreichung angegeben werden.

**Ordernummer**

Es kann die Ordernummer aus der Rückmeldung auf die Ordereinreichung angegeben werden.

### Orderanzeigeinformation

Die Wertpapierorder ist im Format MT 502 (erweitert) in Version „SRG 2002“ (s. [Datenformate]) einzustellen. Es gelten die folgenden abweichenden Belegungsvorschriften:

- A:23G: Es ist „/COPY“ anzugeben.

### Ausführungsanzeige

Ausführungsanzeige im Format MT 513 in Version „SRG 1998“ (s. [Datenformate])



Das Kundensystem muss damit rechnen, dass mit identischer Referenz des Senders (Feld :20C: in Folge A) eine weitere Ausführungsanzeige bzw. Wertpapierabrechnung mit anderer Uhrzeit in Feld :98C: der Folge A empfangen werden kann, wobei es sich um eine Korrektur der ursprünglichen Nachricht handelt.

### Wertpapierabrechnung

Wertpapierabrechnung im Format MT 515 in Version „SRG 1998“ (s. [Datenformate])

#### ◆ Ausgewählte Beispiele für Rückmeldungscodes

Code	Beispiel für Rückmeldungstext
9010	Referenznummer falsch
9220	Es liegen keine Informationen für Order vor

### c) Bankparameterdaten

#### ◆ Format

Name: Orderstatus Parameter  
Typ: Segment  
Segmentart: Geschäftsvorfall  
Kennung: HIWSOS  
Bezugssegment: HKVVB  
Version: [5](#)  
Sender: Kreditinstitut

Nr.	Name	Version	Typ	Format	Länge	Status	Anzahl	Restriktionen
1	Segmentkopf	1	DEG			M	1	
2	Maximale Anzahl Aufträge	1	DE	num	..3	M	1	
3	Anzahl Signaturen mindestens	1	DE	num	1	M	1	0, 1, 2, 3
4	Sicherheitsklasse	1	DE	code	1	M	1	0, 1, 2, 3, 4
5	Parameter Orderstatus	3	DEG			M	1	

## B. DATA DICTIONARY

---

### Auftragsfilter

Filter zur Einschränkung der Auswahl der Aufträge anhand deren Status. Es gilt eine Oder-Verknüpfung, d.h. es werden alle Aufträge, die mindestens einem der angegebenen Stati entsprechen, zurückgemeldet.

Nr.	Name	Version	Typ	Format	Länge	Status	Anzahl	Restriktionen
1	<a href="#">Wertpapierorderstatus</a>	<a href="#">3</a>	DE	code	..2	M	1..9	1- <a href="#">17</a>

Typ: DEG  
Format:  
Länge:  
Version: [4](#)



Das Kundensystem sollte dem Kunden die Statuscodes aufbereitet anzeigen: z.B. Offene Aufträge (Codes 1, 2, 4 und 5), ausgeführte Order, abgerechnete Order und gestrichene Order).

### [Best-Execution-Börsenplatz](#)

[Gibt den Best-Execution-Börsenplatz als MIC-Code an.](#)

[Typ: DE](#)  
[Format: an](#)  
[Länge: 4](#)  
[Version: 1](#)

### [Direkthandel-Depot](#)

[Gibt an, ob es sich um ein Direkthandel-Depot handelt.](#)

[Typ: DE](#)  
[Format: in](#)  
[Länge: #](#)  
[Version: 1](#)

### [Kennzeichen komplexes Finanzinstrument](#)

[Gibt an, ob es sich um ein komplexes Finanzinstrument handelt.](#)

[Codierung:](#)

[J: Ja](#)

[K: Nicht ermittelbar](#)

[N: Nein](#)

[Typ: DE](#)  
[Format: code](#)  
[Länge: 1](#)  
[Version: 1](#)

### [Kennzeichen Execution-Only-Depot](#)

[Gibt an, ob es sich um ein Execution-Only-Depot handelt.](#)



Typ: DE  
Format: in  
Länge: #  
Version: 1

### Link Verkaufsunterlagen

Internet-URL zu den Verkaufsunterlagen eines Fonds. Die Angabe erfolgt inklusive des Dienstbezeichners (z.B. 'http://').

Typ: DE  
Format: txt  
Länge: ..2048  
Version: 1

### **Stammdaten Fonds**

Stammdaten für die Wertpapierkategorie „Fonds“.

Nr.	Name	Version	Typ	Format	Länge	Status	Anzahl	Restriktionen
1	Fälligkeit	1	DE	dat	#	O	1	
2	Wiederanlagerabatt von	1	DE	dat	#	O	1	
3	Wiederanlagerabatt bis	1	DE	dat	#	O	1	
4	Wiederanlagerabatt, Höhe	1	DE	wrt	#	O	1	
5	Ausgabeaufschlag	1	DE	wrt	#	O	1	
6	Verwaltungsgebühr	1	DE	wrt	#	O	1	
7	Depotbankgebühr	1	DE	wrt	#	O	1	
8	Bemerkungen	1	DE	txt	..2048	O	1	
9	<a href="#">Link Verkaufsunterlagen</a>	<u>1</u>	<u>DE</u>	<u>txt</u>	<u>..2048</u>	<u>O</u>	<u>1</u>	

Typ: DEG  
 Format:  
 Länge:  
 Version: 2

### **Wertpapierorderstatus**

Status eines Wertpapierauftrages.

Codierung:

0: Nicht verfügbar (Der Status für den Auftrag mit der angegebenen Referenz ist systemweit unbekannt.)

1: Auftrag zur Ausführung vorgemerkt (Der Auftrag wurde in einem der vorgelagerten Kreditinstitutssysteme zwischengespeichert. Der Auftrag ist auf dem Weg zum abwickelnden System, dessen Rückmeldung aber noch aussteht.)

2: Auftrag zur Ausführung angenommen (Der Auftrag wurde vom abwickelnden System zur Ausführung angenommen. Achtung: Wenn der Auftrag eine Änderung oder Streichung war, bedeutet dieser Status nicht, dass die Bezugsorder tatsächlich schon geändert bzw. gestrichen worden ist. Es kann vorkommen, dass die Bezugsorder im Zeitpunkt der Änderungs-/Streichungsannahme gerade an der Börse ausgeführt wird. Maßgeblich für den Kunden ist immer der jeweilige Orderstatus.)

3: Auftrag abgelehnt (Eines der Kreditinstitutssysteme hat aufgrund von Prüfungen den Auftrag abgelehnt. Auch im Nachhinein sollte der Grund hierfür rekonstruierbar sein. Informationen zu abgelehnten Aufträgen können mit dem Geschäftsvorfall „Orderstatus“ oder „Orderanzeige“ angefordert werden.)

4: Orderänderung vorgemerkt (Die Order wurde noch nicht ausgeführt. für den Auftrag liegt eine Änderungsvormerkung vor.)

5: Orderstreichung vorgemerkt (Die Order wurde noch nicht ausgeführt. für den Auftrag liegt eine Streichungsvormerkung vor.)

6: Order ausgeführt (Die Order wurde ausgeführt und kann daher nicht mehr geändert oder gestrichen werden. Dies bedeutet, dass auch eine Ausführungsanzeige (MT 513) abrufbar ist, wenn diese vom Kreditinstitut angeboten wird.)

7: Order teilausgeführt (In diesem Fall können dem Kunden weitere Informationen zur Teilausführung im DE „Auftragsbezogene Informationen“ mitgeteilt werden. Bei Änderungen und Streichungen kann das Kreditinstitut den Auftrag unter Vorbehalt annehmen, indem es das Kennzeichen „Erneutes Senden erforderlich“ setzt, um so vom Kunden eine Bestätigung der Teilausführung zu erhalten.)

8: Order abgerechnet (Die Order wurde abgerechnet. Dies bedeutet, dass auch eine Abrechnung (MT 515) abrufbar ist, wenn diese vom Kreditinstitut angeboten wird.)

9: Order gemäß Kundenwunsch gestrichen (Die Order wurde vom Kunden gestrichen.)

10: Order gemäß Usancen gestrichen (Die Order wurde vom Kreditinstitut bzw. von der Börse gelöscht.)

11: Order abgelaufen (Die Order wurde gelöscht, da der maximale Gültigkeitstermin der Order überschritten wurde.)

[12: gelöschte Direkthandelsorders \(Die Direkthandelsorder wurde durch den „Market Maker“ gestrichen\)](#)

[13: Überprüfung Orderbuch Direkthandel \(Der Auftrag \(Quoteannahme\) wurde seitens des Wertpapierabwicklers angenommen, konnte aber aufgrund eines technischen Problems nicht beantwortet werden. Dem Kunden wird empfohlen sein Orderbuch abzurufen.\)](#)

[14: alle Direkthandelsorders \(Im Orderbuch werden alle Direkthandelsorders nach Status „offen“, „ausgeführt“, „abgerechnet“ und „gelöscht“ ausgewiesen\)](#)

[15: offene Direkthandelsorder \(Im Orderbuch werden alle offenen Direkthandelsorders angezeigt\)](#)

[16: ausgeführte Direkthandelsorder \(Im Orderbuch werden alle ausgeführten Direkthandelsorders angezeigt.\)](#)

17: abgerechnete Direkthandelsorder (Im Orderbuch werden alle abgerechneten Direkthandelsorders angezeigt.)

Typ: DE  
Format: code  
Länge: ..2  
Version: 3



Welchen Informationsgehalt bzw. welche Rechtsfolgen die jeweiligen Statusmeldungen für den Kunden haben, sollte das Kreditinstitut in entsprechenden Kundenbedingungen festlegen.