

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

Inhaltsverzeichnis

1.	Allgemein	2
2.	Tabelle 1: Gemäß Artikel 3 Absatz 1 zu veröffentlichende Angaben – Art des Ausführungsplatzes	3
3.	Tabelle 2: Gemäß Artikel 3 Absatz 2 zu veröffentlichende Angaben – Art des Finanzinstruments	4
4.	Tabelle 3: Gemäß Artikel 4 Buchstabe a zu veröffentlichende Angaben	5
5.	Tabelle 4: Gemäß Artikel 4 Buchstabe b zu veröffentlichende Angaben	6
6.	Tabelle 5: Gemäß Artikel 5 zu veröffentlichende Kostenangaben	7
7.	Tabelle 6: Gemäß Artikel 6 zu veröffentlichende Angaben zur Ausführungswahrscheinlichkeit	8
8.	Tabelle 7: Gemäß Artikel 7 Absatz 1 zu veröffentlichende Angaben zur Ausführungswahrscheinlichkeit	9
9.	Tabelle 8: Gemäß Artikel 7 Absätze 2 und 3 zu veröffentlichende Angaben	10
10.	Dokumenteninformation	11
11.	Dokumentenhistorie	12

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

1. Allgemein

Aspekt	Umsetzung
Format	<ul style="list-style-type: none"> - csv - Pro Segment-MIC ein "Report" mit jeweils 8 csv-files zu den 9 Tabellen
Namenskonvention	Type_TableNo_MIC_Date
Beispiele Namenskonvention zum 03.01.2018	<p><u>Regulierter Markt:</u> RTS 27_table 1_STUA_2018-01-03 RTS 27_table 2_STUA_2018-01-03 RTS 27_table 3_STUA_2018-01-03 RTS 27_table 4_STUA_2018-01-03 RTS 27_table 5_STUA_2018-01-03 RTS 27_table 6_STUA_2018-01-03 RTS 27_table 7_STUA_2018-01-03 RTS 27_table 8_STUA_2018-01-03</p> <p><u>Freiverkehr:</u> RTS 27_table 1_STUB_2018-01-03 RTS 27_table 2_STUB_2018-01-03 RTS 27_table 3_STUB_2018-01-03 RTS 27_table 4_STUB_2018-01-03 RTS 27_table 5_STUB_2018-01-03 RTS 27_table 6_STUB_2018-01-03 RTS 27_table 7_STUB_2018-01-03 RTS 27_table 8_STUB_2018-01-03</p>
Namenskonvention zip Datei	Type_MIC_Date
Beispiele Namenskonvention zip Datei zum 03.01.2018	<p><u>Regulierter Markt:</u> RTS 27_STUA_2018-01-03</p> <p><u>Freiverkehr:</u> RTS 27_STUB_2018-01-03</p>
Veröffentlichung	Börsentäglich t+2
Art der Veröffentlichung	Auf Internetseite <ul style="list-style-type: none"> - Gezippt zum Download - Keine Restriktion (Firewall, Registrierung)
Dauer der Bereitstellung	- 2 Jahre
Struktur der Reports	<ul style="list-style-type: none"> - 8 csv-files zu den 8 relevanten Tabellen (entsprechend Struktur RTS 27) - Verknüpfungsmöglichkeit über ISIN - Spalten = Spalten - Zeilen = ISINs
Hinweis zu den Inhalten der Reports	- Kursiv hervorgehobene Bezeichnungen ohne Beispiele sind mangels Relevanz in den veröffentlichten Reports nicht enthalten
Link zum Download	https://www.boerse-stuttgart.de/de/unternehmen/rund-um-den-handel/mifid/rts27-dateien/

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

2. Tabelle 1: Gemäß Artikel 3 Absatz 1 zu veröffentlichende Angaben – Art des Ausführungsplatzes

No	Bezeichnung / name	Format	Beispiel / example
1	Platz_Bezeichnung VENUE_NAME	Text	BWWB
	Platz_Kennung VENUE_IDENTIFIER		
3	Land_BAB COUNTRY_CA	Text	DE
	Marktsegment_Bezeichnung MARKTSEGMENT_NAME		
4	Marktsegment_Kennung MARKTSEGMENT_IDENTIFIER	Text	Regulierter Markt
	Marktsegment_Kennung MARKTSEGMENT_IDENTIFIER		
6	Handelstag TRADING DAY	Datum / date (yyyy-mm-dd)	2018-06-21
	Ausfälle_Art OUTAGES_NATURE		
7	Ausfälle_Art OUTAGES_NATURE	Text	technischer Ausfall
	Ausfälle_Anzahl OUTAGES_NUMBER		
8	Ausfälle_Durchschnittsdauer OUTAGES_AVERAGE_DURATION	Zahl / number	0
	Ausfälle_Durchschnittsdauer OUTAGES_AVERAGE_DURATION		
9	Ausfälle_Durchschnittsdauer OUTAGES_AVERAGE_DURATION	Zeit / time (hh:mm:ss.fff)	00:00:00.000
	Ausfälle_Durchschnittsdauer OUTAGES_AVERAGE_DURATION		
10	TerminierteAuktion_Art SCHEDULED_AUCTION_NATURE		
	TerminierteAuktion_Art SCHEDULED_AUCTION_NATURE		
11	TerminierteAuktion_Anzahl SCHEDULED_AUCTION_NUMBER		
	TerminierteAuktion_Anzahl SCHEDULED_AUCTION_NUMBER		
12	TerminierteAuktion_Durchschnittsdauer SCHEDULED_AUCTION_NATURE_AVERAGE_DURATION		
	TerminierteAuktion_Durchschnittsdauer SCHEDULED_AUCTION_NATURE_AVERAGE_DURATION		
13	FehlgeschlageneGeschäfte_Anzahl FAILED_TRANSACTION_NUMBER	Zahl / number	1
	FehlgeschlageneGeschäfte_Anzahl FAILED_TRANSACTION_NUMBER		
14	FehlgeschlageneGeschäfte_AnteilWert FAILED_TRANSACTIONS_PERCENTAGE_VALUE	Zahl / number	0,236
	FehlgeschlageneGeschäfte_AnteilWert FAILED_TRANSACTIONS_PERCENTAGE_VALUE		
5	ISIN	Text	DE0007100000

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

3. Tabelle 2: Gemäß Artikel 3 Absatz 2 zu veröffentlichende Angaben – Art des Finanzinstruments

No	Bezeichnung / name	Format	Beispiel / example
1	Finanzinstrument_Bezeichnung	Text	Daimler AG NA o.N.
	FINANCIAL_INSTRUMENT_NAME		
2	Finanzinstrument_Kennung	Text	DE0007100000
	VENUE_IDENTIFIER		
3	Finanzinstrument_Klassifizierung	Text	DNFTFB
	INSTRUMENT_CLASSIFICATION		
4	Währung	Text	EUR
	CURRENCY		

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

4. Tabelle 3: Gemäß Artikel 4 Buchstabe a zu veröffentlichende Angaben

No	Bezeichnung / name	Format	Beispiel / example
1	Handelssystem	Text	Hybrid
	TRADING_SYSTEM		
2	Handelsmodus	Text	Unscheduled Auction
	TRADING_MODE		
3	Handelsplattform	Text	Electronic
	TRADING_PLATTFORM		
4	[Zeit]_[Größe]_DurchschnittlicherPreis	Zahl / number	73,465
	T1_K1_PRICE_AVG		
5	[Zeit]_[Größe]_AusgeführtesVolumen	Zahl / number	154359,15
	T1_K1_VOL		
6	[Zeit]_[Größe]_ErsterPreis	Zahl / number	73,4
	T1_K1_FIRST_PRICE		
7	[Zeit]_[Größe]_Ausführungszeit ErsterPreis	Zeit / time (hh:mm:ss.fff)	09:35:25.146
	T1_K1_FIRST_PRICE_TIME		
8	[Zeit]_[Größe]_Geschäftsgröße	Zahl / number	7340
	T1_K1_FIRST_VOLUMEN		
9	[Zeit]_[Größe]_BestesGebot	Zahl	73,4
	T1_K1_QUOTE_BID		
10	[Zeit]_[Größe]_BestesAngebot	Zahl	73,41
	T1_K1_QUOTE_ASK		
S	ISIN	Text	DE0007100000

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

5. Tabelle 4: Gemäß Artikel 4 Buchstabe b zu veröffentlichende Angaben

No	Bezeichnung / name	Format	Beispiel / example
1	Durchschnittspreis	Zahl / number	73,465
	DAILY_AVG_PRICE		
2	Durchschnittspreis_Gewichtet	Zahl / number	73,458
	DAILY_VOL_PRICE		
3	Höchstpreis_ausgeführt	Zahl / number	73,6
	DAILY_HIGH_PRICE		
3	Niedrigstpreis_ausgeführt	Zahl / number	73,25
	DAILY_LOW_PRICE		
S	ISIN	Text	DE0007100000

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

6. Tabelle 5: Gemäß Artikel 5 zu veröffentlichende Kostenangaben

No	Bezeichnung / name	Format	Beispiel / example
1	Ausführungsgebühren	Text	3E
	EXECUTION_FEES		
2	Gebühren für Zustellung/Änderung/Storno	Text	0
	FEES_SUBMISSIONS		
3	Marktdaten_Endstellen	Text	0
	MARKET_DATA_TERMINALS		
4	<i>AndereGebühren</i>		
	<i>OTHER_FEES</i>		
5	Rabatte	Text	0
	DISCOUNTS		
6	<i>Nichtmonetäre Leistungen</i>		
	<i>NON-MONETARY_BENEFITS</i>		
7	Steuern	Text	8,55
	TAXES		
8	Link	Text	www.boerse-stuttgart.de
	LINK		
9	Anteil_Rabatte	Zahl / number	0,005
	RATIO_DISCOUNT		
10	Anteil_Kosten	Zahl / number	0,123
	RATIO_COSTS		
S	ISIN	Text	DE0007100000

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

7. Tabelle 6: Gemäß Artikel 6 zu veröffentlichende Angaben zur Ausführungswahrscheinlichkeit

No	Bezeichnung / name	Format	Beispiel / example
1	Ordereinstellungen_Anzahl	Zahl / number	46
	RECEIVED_ORDERS_NUMBER		
2	Geschäfte_Anzahl	Zahl / number	35
	TRANSACTION_NUMBER		
3	Geschäfte_Kurswert	Zahl / number	246135,87
	TRANSACTION_VALUE		
4	Orderlöschungen_Anzahl	Zahl / number	7
	CANCELLED_ORDERS_NUMBER		
5	Orderänderungen_Anzahl	Zahl / number	23
	MODIFIED_ORDERS_NUMBER		
6	Kurswert_Median	Zahl / number	6615
	SIZE_MEDIAN		
7	Ordereinstellungen_WertMedian	Zahl / number	9250
	RECEIVED_ORDERS_VALUE_MEDIAN		
8	MarketMaker_Anzahl	Zahl / number	0
	MARKETMAKER_NUMBER		
S	ISIN	Text	DE0007100000

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

8. Tabelle 7: Gemäß Artikel 7 Absatz 1 zu veröffentlichende Angaben zur Ausführungswahrscheinlichkeit

No	Bezeichnung / name	Format	Beispiel / example
1	[Zeit]_BestesGebot	Zahl / number	73,43
	T1_BID		
2	[Zeit]_BestesAngebot	Zahl / number	73,446
	T1_ASK		
3	[Zeit]_Bestes GebotStückzahl	Zahl / number	138
	T1_BID_VOL		
4	[Zeit]_Bestes AngebotStückzahl	Zahl / number	138
	T1_ASK_VOL		
5	[Zeit]_Buchtiefe3		
	T1_Book_Depth3		
S	ISIN	Text	DE0007100000

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

9. Tabelle 8: Gemäß Artikel 7 Absätze 2 und 3 zu veröffentlichende Angaben

No	Bezeichnung / name	Format	Beispiel / example
1	Spread_Effektiv_Durchschnitt	Zahl / number	0,014
	SPREAD_EFFECTIVE_AVERAGE		
2	Volumen_Gebot_Angebot_Durchschnitt	Zahl / number	138
	VOLUME_BESTBID_BESTASK_AVERAGE		
3	Spread_Durchschnitt	Zahl / number	0,021
	SPREAD_AVERAGE		
4	Stornierung_BestesGebotBestesAngebot_Anzahl		
	CANCELLATION_BESTBID_BESTASK_NUMBER		
5	Änderung_BestesGebotBestesAngebot_Anzahl		
	CHANGE_BESTBID_BESTASK_NUMBER		
6	Buchtiefe3		
	MARKET_DEPTH3		
7	Ausführungszeit_AggressiveOrder_Durchschnitt		
	EXECUTION_TIME_AGGRESSIVE_ORDER_AVERAGE		
8	Ausführungszeit_UnlimitierteOrder_Median	Zeit / time (milliseconds)	5.000
	EXECUTION_TIME_MARKET_ORDER_MEDIAN		
9	Ausführungsgeschwindigkeit_PassivOrder_Durchschnitt		
	EXECUTION_SPEED_PASSIVE_ORDER_AVERAGE		
10	FoK_Anzahl_Kill		
	FOK_NUMBER_KILL		
11	IoC_Anzahl_Storniert		
	IOC_NUMBER_CANCELLED		
12	Geschäfte_LIS_Anzahl	Zahl / number	1
	TRANSACTION_LIS_NUMBER		
13	Geschäfte_LIS_Kurswert	Zahl / number	101000
	TRANSACTION_LIS_VALUE		
14	Geschäfte_Vorhandelswaiver_Anzahl		
	TRANSACTION_PRETRADE_WAIVER_NUMBER		
15	Geschäfte_Vorhandelswaiver_Kurswert		
	TRANSACTION_PRETRADE_WAIVER_VALUE		
16	Handelsunterbrechungen_Anzahl		
	TRADING_INTERRUPTION_NUMBER		
17	Handelsunterbrechungen_Dauer_Durchschnitt		
	TRADING_INTERRUPTION_DURATION_AVERAGE		
18	Handelsaussetzungen_Anzahl	Zahl / number	1
	TRADING_SUSPENSION_NUMBER		
19	Handelsaussetzungen_Art	Text	AmOL
	TRADING_SUSPENSION_NATURE		
20	Handelsaussetzungen_Dauer_Durchschnitt	Zeit / time (hh:mm:ss.fff)	01:00:02.843
	TRADING_SUSPENSION_DURATION_AVERAGE		
21	ZeitraumOhneAngebot_Anzahl		
	PERIOD_WITHOUT_QUOTE_NUMBER		
22	ZeitraumOhneAngebot_Dauer_Durchschnitt		
	PERIOD_WITHOUT_QUOTE_DURATION_AVERAGE		
23	Angebotspräsenz_Durchschnitt	Zahl / number (percentage)	99,8 QLP-A-Information (Taxe) veröffentlicht
	QUOTE_PRESENCE_AVERAGE		
S	ISIN	Text	DE0007100000

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

10. Dokumenteninformation

Dokumenteninformation	
Titel	Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting
Klassifizierung	Öffentlich
Version	1.0
Ansprechpartner	Michael Kieß Telefon +49 711 222985-546 michael.kiess@boerse-stuttgart.de

Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting

11. Dokumentenhistorie

Datum	Version	Bezeichnung
26.06.2018	1.0	Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting
10.09.2018	1.1	Benutzerhandbuch RTS 27 Reporting