



Release 33

Systemanschluss Makler

Security Administration Guide

Stand: 31.05.2017

Version 17.00

Inhalt

1	Einleitung.....	4
2	Berechtigungskonzept.....	5
2.1	ID-Kennzeichen.....	5
2.1.1	ID-Kennzeichen mit voller Berechtigung.....	5
2.1.2	ID-Kennzeichen mit eingeschränkter Berechtigung.....	5
2.2	Zulassung zum Quoting	6
2.3	KV-Nummern spezifisches Profiling.....	7
3	Einrichten der ID-Kennzeichen	8
3.1	ID-Kennzeichen mit voller Berechtigung.....	8
3.2	ID-Kennzeichen mit eingeschränkter Berechtigung.....	8
4	Hinweise.....	9
5	Beispiele Berechtigungsvergabe	10

1 Einleitung

Dieses Dokument enthält grundlegende Informationen:

1. die zur Einrichtung von ID-Kennzeichen¹, für einen Zugang zu XONTRO über den Systemanschluss für Makler (SAM), benötigt werden
2. über die Auswahl "Profiling" des Funktions- und Informationsangebots des XONTRO Systemanschluss Makler.

Damit der Kunde ID-Kennzeichen für den Systemanschluss Makler einrichten kann, muss er einen Systemanschluss Makler Zugang bei BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH beantragen. Der vom Teilnehmer benannte Kunden-Security-Beauftragte richtet im Rahmen seiner Tätigkeit dann die benötigten ID-Kennzeichen und Berechtigungen ein.

Das Securitykonzept für die Vergabe der XONTRO SAM ID-Kennzeichen setzt auf dem bestehenden IMS-Security-System auf, das für alle MVS/IMS-Anwendungen, die von der Deutsche Börse AG betrieben werden, eingesetzt wird.

Im Folgenden wird deshalb vorausgesetzt, dass der Leser mit diesem System vertraut ist, und dass der Teilnehmer bereits einen Kunden-Security-Beauftragten benannt hat. Für jede dem Teilnehmer zugeordnete Kassenvereinsnummer (KV-Nummer) wird ein ID-Kennzeichen für den Kunden-Security-Beauftragten benötigt.

Für eine Darstellung der Aufgaben des Kunden-Security-Beauftragten und der Funktionalitäten, welche die spezifische Berechtigung enthält, wird auf das IMS-Security-Handbuch "Online-Pflege der Security-DB" verwiesen.

Bei Fragen wenden Sie sich bitte an:

BRAINTRADE Gesellschaft für Börsensysteme mbH unter der Rufnummer
0049 (0)69 – 58 99 78 – 170.

Die erforderlichen Formulare „Anmeldung-Profiling“ bzw. „Anmeldung-Profiling-Update“ finden Sie unter www.xontro.de im Pfad "XONTRO / Anmeldung".

¹ 10 Stellige XONTRO Benutzernummer

2 **Berechtigungskonzept**

Der von XONTRO angebotene Systemanschluss für Makler stellt ein API zur Verfügung, das auf der GATE Architektur basiert (VALUES API). XONTRO bietet jedoch keine Front End-Anwendung an, so dass die Teilnehmer zwingend eine eigene Anwendung zur Nutzung des Systemanschlusses einsetzen müssen.

Eine solche Anwendung kann sich mit einem oder mehreren ID-Kennzeichen beim XONTRO Back End anmelden (Login). Ist diese Anmeldung erfolgreich, dann ist die Anwendung entweder zur Nutzung der gesamten oder einer eingeschränkten Funktionalität berechtigt.

Das Profiling kann eingesetzt werden, um den Nachrichtenaustausch zwischen dem Back End und einer MISS-Gruppe für alle ID-Kennzeichen einer KV-Nummer zu filtern und die Nutzung auf bestimmte Requests und Broadcasts einzuschränken. Siehe Abschnitt 2.3 „KV-Nummern spezifisches Profiling“.

2.1 **ID-Kennzeichen**

Ein ID-Kennzeichen wird bei der Anmeldung über die XONTRO VALUES API verwendet. Mittels des beim Login angegebenen ID-Kennzeichens und Passworts wird der Benutzer bzw. die Anwendung am XONTRO BE authentifiziert. Ein authentifizierter Benutzer kann voll oder eingeschränkt berechtigt sein, Informationen über den Systemanschluss auszutauschen. Weitere Differenzierungen der Zugriffsberechtigung sind auf der Ebene eines ID-Kennzeichens nicht möglich.

Darüber hinausgehende ID-Kennzeichen spezifische Berechtigungen für die einzelnen Requests des Systemanschlusses muss eine Teilnehmer Anwendung selbst verwalten.

Ab Release 22 werden am XONTRO SAM zwei Gruppen von ID-Kennzeichen unterschieden:

- ID-Kennzeichen mit voller Berechtigung
- ID-Kennzeichen mit eingeschränkter Berechtigung²

Einzelheiten über die Einrichtung von ID-Kennzeichen für den SAM ist dem Abschnitt 3 „Einrichten der ID-Kennzeichen“ zu entnehmen.

2.1.1 **ID-Kennzeichen mit voller Berechtigung**

Ein ID-Kennzeichen mit voller Berechtigung kann alle innerhalb des SAM für die KV-Nummer angebotenen Funktionen nutzen. Die angebotenen Funktionen werden durch das vom Teilnehmer beantragte Profil festgelegt. Siehe Abschnitt 2.3 „KV-Nummern spezifisches Profiling“.

2.1.2 **ID-Kennzeichen mit eingeschränkter Berechtigung**

Ein ID-Kennzeichen mit eingeschränkter Berechtigung kann folgende Funktionen des SAM nutzen:

- Quote Requests einstellen
- Datenströme subscribieren
- Retransmission Requests absetzen

² Quote-User aus Release 21.2 werden ab Release 22 als ID-Kennzeichen mit eingeschränkter Berechtigung weitergeführt.

- Inquire Requests absetzen
- Passwort per Request ändern

Für alle anderen Requests ist das ID-Kennzeichen nicht berechtigt. Weitere Einschränkungen können durch das vom Teilnehmer beantragte Profil festgelegt werden. Siehe Abschnitt 2.3 „KV-Nummern spezifisches Profiling“.

2.2 Zulassung zum Quoting

Jede Börse stellt ihren Teilnehmern ein Quote Kontingent zur Verfügung, das nach ihren Vorgaben auf einzelne KV-Nummern verteilt wird. Das Quote Kontingent einer KV-Nummer stellt die maximale Anzahl Quotes dar, die an einem Börsentag eingestellt werden können.

Quote Requests für eine KV-Nummer können nur über eine ausgewählte MISS-Gruppe in XONTRO eingestellt werden. Diese MISS-Gruppe erhält das Quote Kontingent der KV-Nummer. Die Quoting MISS-Gruppe für eine KV-Nummer wird im Rahmen der „Anmeldung-Profiling“ festgelegt.

Es ist möglich, mehrere Quote Machines für eine KV-Nummer zu betreiben. Dabei können die Quote Machines auf unterschiedlichen Workstations zur besseren Lastverteilung über unterschiedliche MISS-Server der gleichen Miss Gruppe betrieben werden. Dieser MISS-Gruppe muss das Quote Kontingent der KV-Nummer zugeordnet sein. Es ist Sache des Anwenders, dafür zu sorgen, dass für eine ISIN nur eine Quote Machine Quotes erzeugt.

Für das Einstellen von Quotes können sowohl ID-Kennzeichen mit voller Berechtigung als auch ID-Kennzeichen mit eingeschränkter Berechtigung verwendet werden. In jedem Fall gilt weiter die Restriktion, dass ein ID-Kennzeichen, da es einer KV-Nummer zugeordnet ist, den Systemanschluss für genau einen Börsenplatz nutzen kann.

2.3 KV-Nummern spezifisches Profiling

Seit Release 20 ist ein KV-Nummern spezifisches Verhalten des Systemanschluss Makler implementiert. Auf Antrag der Teilnehmers (Anmeldung Profiling) können einzelne Bestandsinformationen, Broadcastnachrichten oder Requests an- bzw. abgeschaltet werden.

Die angebotene Funktionalität wird in unterschiedliche Gruppen aufgeteilt:

- Leistungen für alle KV-Nummern, wiederum unterteilt in
 - verbindliche Anteile (nicht ab- bzw. zuschaltbar)
 - und
 - optionale Anteile (ab- bzw. zuschaltbar)

sowie

- Leistungen für einzelne Börsenplätze (ab- bzw. zuschaltbar)

Seit Release 20 können nicht nur vollständige Broadcastströme unterdrückt werden. Die Filterungsmöglichkeit steht auch für die nächste Gliederungsebene ("Subtype") zur Verfügung. Will ein Teilnehmer z.B. alle am Back End eingegebenen Taxen und Spannen ausblenden, so kann er dieses tun. Die Verantwortung für eine sinnvolle Zusammensetzung des Nachrichtenstroms liegt vollständig bei ihm.

Welche Leistungsauswahl im Einzelnen getroffen werden kann, ist im Formular „Anmeldung-Profiling“ beschrieben. Die Auswahl ist im Rahmen der Anmeldung zu beantragen. Das Anmeldeformular steht auf www.xontro.de zum Download bereit.

3 Einrichten der ID-Kennzeichen

Der Haupt-Security-Beauftragte der Deutsche Börse AG richtet für die Kunden-Security-Beauftragten der Teilnehmer die Möglichkeit zur Vergabe von Berechtigungen für folgende Transaktionen ein:

- Für Makler am Börsenplatz Frankfurt: BCTL
- Für Makler an Regionalbörsen: BRTL

Die Einrichtung der Berechtigung erfolgt auf Antrag des SAM Teilnehmers.

Sobald der Kunden-Security-Beauftragte die Berechtigung zur Vergabe der oben genannten Transaktionen erhalten hat, kann er seinerseits ID-Kennzeichen seines Hauses für die Benutzung des Systemanschlusses Makler autorisieren. Hierzu ist die Transaktion SECU zu verwenden. Ein Beispiel befindet sich hierzu in Abschnitt 6.

Nachfolgende ID-Kennzeichen können eingerichtet werden.

3.1 ID-Kennzeichen mit voller Berechtigung

ID-Kennzeichen, welche die gesamte Funktionalität des XONTRO Systemanschlusses Makler nutzen dürfen, sind für die Transaktion BCTL (Frankfurt) oder BRTL (Region) ohne Funktionscode zuzulassen. Neben der Einrichtung der Transaktion BCTL bzw. BRTL empfehlen wir aus Sicherheitsgründen, dem entsprechenden ID-Kennzeichen auch die Transaktion der Orderhistorie BRHI zuzuordnen, um im Fall von undefinierten Passwörterzuständen über einen Zugang zum Dialogsystem zu verfügen.

3.2 ID-Kennzeichen mit eingeschränkter Berechtigung

ID-Kennzeichen mit eingeschränkter Berechtigung, etwa für Quotes erzeugende Anwendungen, sind für den Funktionscode Q zuzulassen. Dazu ist beim dem Transaktionscode BCTL bzw. BRTL in der ersten Stelle des Felds „TRAN-CODE SCHLUESSELUNGEN“ der Funktionscode Q einzugeben.

Die bis Release 21.2 verwendeten Funktionscodes Q1-Q5 werden ab Release 22 als Funktionscode Q interpretiert. Die eingetragenen Funktionscodes Q1-Q5 sollten sukzessive vom Kunden-Security-Beauftragten im Rahmen seiner Pflegeverantwortung auf den Funktionscode Q umgestellt werden.

4 Hinweise

Wie bereits erwähnt, gelten die Richtlinien des IMS-Security-Systems der Deutsche Börse AG auch für den XONTRO Systemanschluss Makler.

Auf folgende Besonderheiten wird jedoch explizit hingewiesen:

Wird ein Benutzer über eine teilnehmereigene Anwendung mit einem gültigen ID-Kennzeichen bei der XONTRO Back End Applikation angemeldet und ist das ID-Kennzeichen dort bereits als angemeldet vermerkt, dann wird die Anmeldung **nicht** abgewiesen. Dieses Verhalten ist grundsätzlich durch die Konstruktion der Client-Server Anwendung bedingt.

Der Systemanschluss Makler bietet zur Zeit keine Möglichkeit der Userverwaltung über die XONTRO VALUES API Schnittstelle an. Die Userverwaltung muss per IMS-Dialoganwendung (3270-Emulation) durchgeführt werden:

- SECU: Anlegen von neuen Usern, Vergabe von Berechtigungen durch den Kunden-Security-Beauftragten

Seit Release 19.1 ist eine Passwortänderung sowohl über den Systemanschluss Makler (Request „XONTRO Change Password“, siehe XONTRO VALUES API) als auch über die IMS-Dialoganwendung mit der Transaktion „PWAD Passwortänderungen“ möglich.

Es wird empfohlen, die Passworte in regelmäßiger Frequenz von ca. 25 Kalendertagen zu ändern, um unerwünschte Blockierungen von Systemanschlüssen zu vermeiden (Die Passworte müssen zwingend nach 30 Tagen geändert werden).

Eine Teilnehmer-Anwendung kann sich für mehrere ID-Kennzeichen über den Systemanschluss Makler anmelden. Die Berechtigung für einzelne Funktionalitäten oder Instrumente sind ggfs. innerhalb der Teilnehmer-Anwendung zu verwalten.

Es ist auch möglich, generell nur ein ID-Kennzeichen an den Systemanschluss Makler anzumelden und die einzelner Nutzer lediglich in der teilnehmereigenen Anwendung zu verwalten.

Einschränkend ist jedoch zu bemerken, dass im Rahmen der Nutzung der umsatzbehafteten, dezentralen Kursfeststellung erkennbar und nachvollziehbar sein muss, welche Person für einen Kurs verantwortlich ist. Das Front End muss sicherstellen, dass der Kursfeststellungs-Request eindeutig einem XONTRO-ID-KZ (10-stellig) aus dem LOGIN zugeordnet werden kann.

5 Beispiele Berechtigungsvergabe

Nachfolgend die Dialog Maske zum Einrichten der ID-Kennzeichen. Hier wird das ID-Kennzeichen 7777000001 mit voller Berechtigung in Frankfurt konfiguriert.

```
TRAN: SECU FC: ET SB: 7777000001

----- PFLEGE SECURITY-DATENBANK -- TRANSAKTIONSBERECHTIGUNGEN -----

BENUTZER:          7777000001

TRAN-CODE          SCHLUESSELUNGEN
                   9   5   0   5   0   5   0   5   0   5   0

1. BCTL

2.
```

Nachfolgend die Dialog Maske zum Einrichten der ID-Kennzeichen. Hier wird das ID-Kennzeichen 7777000002 mit eingeschränkter Berechtigung in Frankfurt konfiguriert. Das eingetragene Q beschränkt die Berechtigung.

```
TRAN: SECU FC: ET SB: 7777000002

----- PFLEGE SECURITY-DATENBANK -- TRANSAKTIONSBERECHTIGUNGEN -----

BENUTZER:          7777000001

TRAN-CODE          SCHLUESSELUNGEN
                   9   5   0   5   0   5   0   5   0   5   0

1. BCTL          Q

2.
```