



XONTRO Schnittstellenanpassungen

CSDR & CBF SET-GO
Newsletter 03.01

BrainTrade GmbH
Börsenplatz 4
60313 Frankfurt/Main

- 04.12.2020 -

(Slides updated: 51, 52)

Verschiebung der geplanten CSDR Implementierung

- BrainTrade hat die Teilnehmer per Newsletter am 08.09.2020 darüber informiert, dass die im CSDR Newsletter 01 vom 22.05.2020 genannten Termine verschoben werden.
- Grund hierfür ist die am 28.08.2020 von der ESMA kommunizierte Verschiebung der Einführung der „CSDR RTS on Settlement Discipline“ um ein Jahr auf den 01.02.2022.
<https://www.esma.europa.eu/press-news/esma-news/esma-proposes-further-postpone-csdr-settlement-discipline>
- Ein weiterer Grund ist die Implementierung von Anforderungen des von der Clearstream Banking AG initiierten Projektes SET-GO , welches unter anderem die Migration der LION-Schnittstelle vorsieht. Projektdetails zum Themenkreis SET-GO erfragen Sie bitte direkt bei Ihren CBF Ansprechpartnern.
- Da im Rahmen des CBF-Projektes SET-GO Programmteile angepasst werden müssen, die bereits auf Grund der CSDR-Anforderungen zu erweitern sind, hat sich BrainTrade entschlossen, die Änderungen beider Themenkreise in einem Release zusammenzufassen.

XONTRO-Schnittstellenanpassungen für CSDR & CBF Projekt SET-GO

- Einführung
- Schnittstellenanpassungen - KI - SAKI-FIX CSDR
- Schnittstellenanpassungen - KI - SAKI-SWIFT CSDR
- Schnittstellenanpassungen - FDI - QSAM CSDR
- Systemanpassungen - KI - Dialog CSDR
- Systemanpassungen - FDI - Dialog CSDR
- Systemanpassungen - KI - Listen (Gedruckte SNO) CSDR
- Systemanpassungen - KI - Listen (CSV-Aufgabenfile) SET-GO
- Timeline der Schnittstellenanpassungen CSDR & SET-GO

Einführung

- Das Ziel dieses Dokumentes ist es, Kreditinstituten und Finanzdienstleistern in kompakter Form die im Rahmen der Realisierung der CSDR Anforderungen für XONTRO relevanten Schnittstellen- und Systemanpassungen aufzuzeigen.
- Das Dokument ist thematisch aufgebaut. Dies bedeutet, dass nach einer einführenden Darstellung der relevanten fachlichen Thematik (grau) die jeweilige Schnittstellenimplementierung für SAKI-FIX (gelb), SAKI-SWIFT (grün) und den Systemanschluss Makler-QSAM (violett) dargestellt wird. Die Darstellung der Dialog- und Listenanpassungen für Kreditinstitute (KI) bzw. Finanzdienstleister (FDI) und eine vorläufige Zeitplanung beschließen das Dokument.
- Die Definition der Schnittstellenformate wurde zwischen den Börsenträgern der XONTRO-Börsen, der Bayerische Börse AG, der Boerse Stuttgart GmbH, der Deutsche Börse AG und der Tradegate AG diskutiert. Unabhängig hiervon ist es möglich, dass die Implementierung spezifischer Details aus Gründen der jeweiligen Marktmodelle bzw. der zu Grunde liegenden technischen Infrastruktur unterschiedlich gehandhabt werden.
- Details hinsichtlich der Implementierung sind bitte den aktuellen Systemdokumentationen zu entnehmen, die unter www.xontro.de abgerufen werden können.

CSDR - Rechtsgrundlagen

- Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 zur Verbesserung der Wertpapierlieferungen und -abrechnungen in der Europäischen Union und über Zentralverwahrer („CSDR“)

sowie zur Änderung der Richtlinien 98/26/EG und 2014/65/EU und der Verordnung (EU) Nr. 236/2012

(ABl. Nr. L 257 S. 1, ber. 2016 Nr. L 349 S. 5)
Celex-Nr. 3 2014 R 0909

geändert durch Art. 3 ÄndVO (EU) 2016/1033 vom 23.6.2016 (ABl. Nr. L 175 S. 1)

und Verordnungen im Zusammenhang mit der Verordnung (EU) Nr. 909/2014, wie z.B. ESMA RTS (2018/1229 - Settlement Discipline) sowie ESMA's Q&As zur CSDR zuletzt geändert am 11 Juli 2019

CSDR - Gegenstand und Geltungsbereich

- Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 zur Verbesserung der Wertpapierlieferungen und -abrechnungen in der Europäischen Union und über Zentralverwahrer („CSDR“)

- Artikel 1 - Gegenstand und Geltungsbereich

(1) In dieser Verordnung werden einheitliche Anforderungen an die Lieferung und Abrechnung von Finanzinstrumenten in der Europäischen Union und Vorschriften für die Organisation und Führung von Zentralverwahrern zur Förderung einer sicheren, effizienten und reibungslosen Lieferung und Abrechnung festgelegt.

(2) Soweit in dieser Verordnung nichts anderes festgelegt ist, gilt sie für die Lieferung und Abrechnung sämtlicher Finanzinstrumente und die Tätigkeiten von Zentralverwahrern.

CSDR - Implementierung in XONTRO

- Die Implementierung der CSDR Anforderungen innerhalb von XONTRO beinhaltet im Wesentlichen die Aufnahme des Feldes „Segment-MIC“ sowohl über alle Teilnehmergruppen als auch über alle Trade Schnittstellen hinweg, bis hin zur Übergabe des Feldes via LION-File an Clearstream Banking (CBF).
- Obwohl es sich „nur“ um die Implementierung eines Datenfeldes handelt, sind nahezu die gesamten XONTRO Trade Funktionalitäten von der Anpassung betroffen.

CBF SET-GO Implementierung in XONTRO

- Die Implementierung der Anforderungen des CBF Projektes SET-GO innerhalb von XONTRO beinhaltet im Wesentlichen die Aufnahme des Feldes „WKN“ in die „Gedruckten Schlussnoten“ (in den SWIFT und Fix SNO-Nachrichten ist die WKN bereits enthalten).
- In diesem Zusammenhang wird die „WKN“ zusätzlich in dem von BrainTrade an CBF täglich übertragenen LION-File reaktiviert. Diese Maßnahme hat keinen Einfluss auf die XONTRO-Teilnehmerschnittstellen.
- Darüber hinaus ist die Bereitstellung eines CSV-Aufgabenfiles vorgesehen. Dieser File-Transfer löst eine Aufgabenliste ab, die derzeit von CBF erzeugt und an Kreditinstitute übermittelt wird. CBF hat angekündigt, diesen Service im Rahmen des SET-GO Projektes einzustellen.

CSDR und CBF SET-GO Implementierung in XONTRO

- Hinsichtlich der XONTRO Implementierung und zeitlichen Umsetzung beider Maßnahmen gehen wir derzeit von folgenden Terminen aus:
 - Bereitstellung im Simulationssystem (IMS27) 05.04.2021 (*geplant*)
 - Bereitstellung im Produktionssystem 24.05.2021
 - Anwendung des Settlement Discipline Regimes durch CBF 01.02.2022

Abkürzungen

- BT = BrainTrade
- CBF = Clearstream Banking (Frankfurt) AG
- CSDR = Central Securities Depositories Regulation
- FDI = Finanzdienstleister / Makler
- KI = Kreditinstitut
- MIC = Market Identifier Code (ISO 10383)
(insbesondere in der Ausprägung “market segment MIC”)
- SET-GO = Projekt der Clearstream Banking (Frankfurt) AG

XONTRO
Schnittstellenanpassungen

CSDR
Rahmenbedingungen

Erläuterungen zum MIC (ISO 10383)

- What is the purpose of the MIC?
The purpose of the MIC is to identify entities such as exchanges, trading platforms, regulated or non-regulated markets and trade reporting facilities as sources of prices and related information.
- What is a “market segment MIC”?
A market segment MIC is a MIC which identifies a section of one of the above entities that specialises in one or more specific instruments or that is regulated differently. Each market segment MIC has a parent MIC which is called the “operating MIC”.
- What is an “operating MIC”?
An operating MIC identifies the entity operating an exchange, trading platform, regulated or non-regulated market or a trade reporting facility in a specific country ; it is the ‘parent’ MIC

KI - Rahmenbedingungen

Eingabe von Geschäften

- Bei der OTC-Geschäftseingabe eines Kreditinstituts kann - unabhängig vom gewählten Eingabeweg (FIX, SWIFT oder Dialog) - ein Segment-MIC eines „nicht XONTRO Börsenplatzes“ erfasst werden; die Eingaben werden plausibilisiert. Der erfasste und formal geprüfte Segment-MIC wird unverändert via LION-File an CBF übermittelt.

CBF interpretiert und verarbeitet Geschäfte - die einen gültigen Segment-MIC beinhalten - als börslich im Sinne der CSDR.

FDI - Rahmenbedingungen

Eingabe von Geschäften

- Bei der Geschäftseingabe eines Finanzdienstleisters (FM oder SKM) kann - unabhängig vom gewählten Eingabeweg (QSAM oder Dialog) - ein Segment-MIC eines „nicht XONTRO Börsenplatzes“ nur bei einem „vollständigen Geschäft“ (Kauf- und Verkaufseite vorhanden; keine Aufgabenbeteiligung; Bankkontrahenten auf beiden Seiten) erfasst werden; die Eingaben werden plausibilisiert. In allen anderen Fällen wird die Eingabe eines Segment-MICs qualifiziert abgelehnt.

Der erfasste und formal geprüfte Segment-MIC wird unverändert via LION-File an CBF übermittelt. CBF interpretiert und verarbeitet Geschäfte, die einen gültigen Segment-MIC beinhalten, als börslich im Sinne der CSDR.

FDI - Rahmenbedingungen

Aufgabengeschäfte (SKM und FM)

- In XONTRO ist es nicht möglich, Aufgaben und halbe Geschäfte eines „nicht XONTRO Börsenplatzes“ zu erfassen. Aufgaben aus MAX-ONE werden jedoch wie XONTRO Aufgaben in der XONTRO Trade Verarbeitung behandelt.
- Geschäfte, die durch Schließung von Aufgabenpositionen in Gattungen entstanden sind, in denen der eingebende Makler Skontroführer ist, werden mit dem Segment-MIC des jeweiligen XONTRO-Börsenplatzes versehen.
- Geschäfte, die durch Schließung von Aufgabenpositionen in Gattungen entstanden sind, in denen der eingebende Makler Freimakler ist, werden ohne einen Segment-MIC an CBF weitergeleitet.

FDI - Rahmenbedingungen

Börsliche Geschäfte aus Preisfeststellung (SKM)

- Börsliche Geschäfte, die aus XONTRO-Preisfeststellungen stammen, werden automatisch vom XONTRO System mit dem entsprechenden Segment-MIC gekennzeichnet.

XONTRO
Schnittstellenanpassungen

SAKI-FIX - SAKI-SWIFT - QSAM

CSDR & CBF Projekt SET-GO

XONTRO – Schnittstellenanpassungen – Übersicht



Relevante Bereiche der CSDR und SET-GO Implementierung

- | | |
|---|--------|
| ▪ 1 - Trade-Eingangsschnittstellen | CSDR |
| ▪ 2 - Trade-Eingangsschnittstelle für Max-ONE | CSDR |
| ▪ 3 - Trade-Ausgangsschnittstellen | CSDR |
| ▪ 4 - Trade-Listen | |
| - Gedruckte Schlussnoten | CSDR |
| - CSV-Aufgabenfile | SET-GO |

1 - Trade-Eingangsschnittstellen

- CSDR

1 - KI - Erweiterung SAKI FIX (4.2)	TradeCaptureReport (UAE)
2 - KI - Erweiterung SAKI FIX (4.4)	TradeCaptureReport (AE)
3 - KI - Erweiterung SAKI SWIFT	Bankdirektgeschäft (MT511)
4 - KI - Erweiterung Dialog	BxEG EW
5 - FDI - Erweiterung QSAM	BC_ENTER_SINGLE_TRADE_RID
6 - FDI - Erweiterung Dialog	BxEM GE und PE

2 - Trade-Eingangsschnittstelle für Max-ONE

- CSDR

1 - FDI - Erweiterung QSAM

BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_RID

3 - Trade-Ausgangsschnittstellen

- CSDR

1 - KI - Erweiterung SAKI FIX (4.2)	TradeCaptureReportSno (USN)
2 - KI - Erweiterung SAKI FIX (4.4)	TradeCaptureReportSno (USN)
3 - KI - Erweiterung SAKI SWIFT	Schlussnote (MT512)
4 - KI - Erweiterung Dialog	BxAG AL
5 - FDI - Erweiterung QSAM	BC_INQUIRE_BROKER_DIARY_STREAM_TYPE
6 - FDI - Erweiterung Dialog	BxEM MT

CSDR & CBF Projekt SET-GO

XONTRO – Schnittstellenanpassungen – Detaildarstellung



4 - Trade-Listen

- CSDR

- 1 - KI - Bereitstellung „Gedruckte Schlussnoten“

- SET-GO

- 2 - KI - Bereitstellung CSV-Aufgabenfile via File-Transfer

5 - CBF-LION-File

- 1 - CBF - Erweiterung BT LION-File

Kein ToDo für die Marktteilnehmer und daher nur der Vollständigkeit halber erwähnt.

CSDR

Die CSDR Erweiterung des LION Files (Neuaufnahme des Feldes „Segment-MIC“) wurde zwischen BrainTrade und CBF abgestimmt, implementiert und bereits seit dem 14.03.2020 produktiv eingesetzt.

SET-GO

Die SET-GO Anpassung des LION Files (Reaktivierung des bestehenden Feldes „WKN“) wird derzeit zwischen BrainTrade, den Börsen und CBF abgestimmt.

Relevante Bereiche - KI - SAKI FIX (4.2)

- 1 - Trade-Eingangsschnittstelle

TradeCaptureReport (UAE)

CSDR - Strukturweiterung

- TradeInputSource (Tag = 578, Type: String)
Type of input device or system from which the trade was entered.
- Keine Erweiterung der Response *TradeCaptureReportAck (UAR)*

Relevante Bereiche - KI - SAKI FIX (4.2)

- 2 - Trade-Ausgangsschnittstelle

TradeCaptureReportSno (USN)

CSDR - Strukturweiterung

- TradeInputSource (Tag = 578, Type: String)

Type of input device or system from which the trade was entered.

Relevante Bereiche - KI - SAKI FIX (4.4)

- 1 - Trade-Eingangsschnittstelle

TradeCaptureReport (AE)

CSDR - Strukturweiterung

- TradeInputSource (Tag = 578, Type: String)
Type of input device or system from which the trade was entered.
- Keine Erweiterung der Response *TradeCaptureReportAck (AR)*

Relevante Bereiche - KI - SAKI FIX (4.4)

- 2 - Trade-Ausgangsschnittstelle

TradeCaptureReportSno (USN)

CSDR Strukturweiterung

- TradeInputSource (Tag = 578, Type: String)

Type of input device or system from which the trade was entered.

Relevante Bereiche - KI - SAKI SWIFT

- 1 - Trade-Eingangsschnittstelle

Bankdirektgeschäft MT511

CSDR - Strukturweiterung Etikett 31P:

- Segment-MIC der Handelsplattform /[4x]
- Börsenplatz des Meldewesens /[3x] *(Erweiterung; aber nicht CSDR relevant)*

Zukünftige MT511 Beschreibung

von Etikett 31P:

M	31P:	Börsenplatz	3x/[6n]/[6n]/[6n]
		Abschlussdatum (JJMMTT)	[/2a6n][2a][1x3n]
		Abschlussuhrzeit (HHMMSS)	[3n]/[4x]/[3x]
		(Abweichender) Schlusstag (JJMMTT)	
		Kennzeichen Festvaluta	
		FZ Valuta Zug-um-Zug	
		Datum Festvaluta	
		Kennzeichen Emissionsgeschäft	
		EM Emissionsgeschäft	
		Zinstage mit Vorzeichen	
		Diskonttage	
		Segment-MIC der Handelsplattform	
		Börsenplatz des Meldewesens	

Relevante Bereiche - KI - SAKI SWIFT

- 2 - Trade-Ausgangsschnittstelle

Schlussnote *MT512*

CSDR - Strukturweiterung Etikett 30:

- Segment-MIC der Handelsplattform /[4x]

Zukünftige MT512 Beschreibung

von Etikett 30:

M	30:	Weitere Abschlussangaben	6n/[6n]/[3x]/[2a]/[1a] /[4x]/[3x]/[4x]
		– Datum-Festvaluta (JJMMTT) oder <u>Dummywert</u> '000000', falls keine Eingabe erfolgt ist	6n
		– Eingabe-Uhrzeit (HHMMSS)	/[6n]
		– Börsenplatz des Meldewesens	/[3x]
		– Kennzeichen für Abweichendes Abschlussdatum 'AA'	/[2a]
		– Kennzeichen "Abwicklungsgeschäft"	/[1a]
		– MIC Venue	/[4x]
		– OTC Post-Trade Indikator	/[3x]
		– Segment-MIC der Handelsplattform	/[4x]

Relevante Bereiche - FDI - Systemanschluss Makler (QSAM)

- 1 - Trade-Eingangsschnittstelle

BC_ENTER_SINGLE_TRADE_RID

CSDR - Strukturweiterung - bc_request_enter_single_tradeT

- venueSegMic char[4]

- 2 - Trade-Eingangsschnittstelle (nur Max-ONE Specialist)

BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_RID

CSDR Strukturweiterung - bc_request_enter_exchange_tradeT

- venueSegMic char[4]

Relevante Bereiche - FDI - Systemanschluss Makler (QSAM)

- 3 - Trade-Ausgangsschnittstelle (Bestandstransfer)

BC_INQUIRE_BROKER_DIARY_STREAM_TYPE

CSDR - Strukturерweiterung - bc_diaryT

- venueSegMic char[4]

- 4 - Trade-Ausgangsschnittstelle (Broadcast)

BCBE_BROKER_DIARY

CSDR - Strukturерweiterung - bc_diaryT

- venueSegMic char[4]

Relevante Bereiche - FDI - Systemanschluss Makler (QSAM)

- *venueMic* char[4] - Bestandsfeld

Änderung der Feld-Erläuterung in der QSAM-API

MIC (Market Identifier Code) des Handelsplatzes bzw. des Handelssegmentes eines Handelsplatzes im Sinne der MiFID II Regulation.

- *venueSegMic* char[4] - neues Feld

Neuaufnahme des Feldes in der QSAM-API

MIC (Market Identifier Code) des Handelssegmentes eines Handelsplatzes im Sinne der CSDR Regulation.

XONTRO
Systemanpassungen
- Dialogfunktionalitäten -

KI - Eingabe von Geschäften

BxEG EW

- Die Eingabe des Segment-MICs erfolgt in den Zusatzangaben des Dialog-Kopfteils unter Voranstellung der Zeichenkette „MI“ gefolgt von einem vierstelligen Segment-MIC.

Der Eingabe ist für die Richtigkeit der Eingabe verantwortlich. Der eingegebene Segment-MIC wird daher nur formal auf die Länge von vier Stellen geprüft.

KI - Anzeige von Geschäften

BxAG AL

- Erweiterung um Ausgabefeld „Segment-MIC“

```
TRAN: BRAG FC: AL SB: J#G#####  
  
XONTRO / ANZEIGE NACHWEISE (LANGFORM)                4002/99 RUCKZUCK BAN  
VERKAUF - DIREKTGESCHAEFT                ABRUF-NR.:   G       1       US-ID: 192799  
                                           GNR         : D 191119 0000001  
  
DE0007100000 DAIMLER AG NA O.N.  
  
NOM.: ST          100                                V-ART:  GS  
  
KURS   : 50,0000          K-WERT: 5.000,00  
  
KONT.: 4015  HSBC TRINKAUS + BURKHARDT AG  
EING.: 4002  RUCKZUCK BANK AG  
  
ABR.-BETRAG: 5.000,00          EUR  
  
EINGABE: 19.11.19 14.48.03          COURT.:          0,00  
ABSCHLUSS: 19.11.19 12.00.00 AB  
  
MIC: xxxx
```

KI - Stornierung von Geschäften

Hinsichtlich der Stornierung von Geschäften gelten folgende Aussagen:

- Wenn im Rahmen der Stornierung von Geschäften der Segment-MIC verändert werden soll, so ist das Geschäft zunächst in BxEG ES zu stornieren und danach in BxEG EW mit dem angepassten Segment-MIC neu zu erfassen.

FDI - Eingabe von Geschäften

BxEM GE und PE

- Die Eingabe des Segment-MICs erfolgt in den Zusatzangaben des Dialog-Kopfteils unter Voranstellung der Zeichenkette „MI“ gefolgt von einem vierstelligen Segment-MIC.

Der Eingabe ist für die Richtigkeit der Eingabe verantwortlich. Der eingegebene Segment-MIC wird daher nur formal auf die Länge von vier Stellen geprüft.

FDI - Eingabe von Geschäften

BxEM GE - Eingabe von Geschäften

- Erweiterung um Eingabemöglichkeit „Segment-MIC“ in Zusatzangaben

```
TRAN: BREM FC: GE SB:

XONTRO TRADE / EINGABE VON GESCHAEFTEN                4123/00 DUESSELMAKLER
GATTUNG           KURS           ZUSATZANGABEN                SEITE 1
.....           .....
```

GA NOMINALE	KONT	AU	ZUSATZANGABEN
.....
.....
.....
.....
.....
.....
.....
.....
.....
.....
.....

```
DIFFERENZ:                 KAUF:                 VERKAUF:
```

FDI - Eingabe von Geschäften

BxEM PE - Eingabe von PUEV-Geschäften

- Erweiterung um Eingabemöglichkeit „Segment-MIC“ in Zusatzangaben

TRAN: BREM FC: PE SB:			
XONTRO TRADE / EINGABE VON PUEV-GESCHAEFTEN		4123/00 DÜSSELMAKLER	
GATTUNG	KURS	ZUSATZANGABEN	
.....	MIxxxx
GA NOMINALE	KONT	AU	ZUSATZANGABEN
.....
.....
.....
.....
.....
.....
.....
.....
.....
.....
DIFFERENZ:	KAUF:	VERKAUF:	

FDI - Anzeige von Geschäften - Maklertagebuch

BxEM MT

- Erweiterung um Ausgabefeld „Segment-MIC“

```
TRAN: BREM FC: MT SB: J#####D  
  
XONTRO TRADE / INFO-MAKLER-TAGESGESCHAEFTSLISTE 4123/00 DUESSELMAKLER  
  
DE0007664005 VOW VOLKSWAGEN AG ST O.N.  
  
GESCHAEFTSNUMMER    NOMINALE    AN    KURS    VON    KURS  
D 2607 1000003      300  4003    500,000  4001    500,000  
AUK1444 AUV1234 AB  MIxxxxx  
D 2607 1000004      200  4004    500,000  4001    500,000  
AUK1000 AUV1234 AB  
D 2607 1000005      100  4005    500,000  4002    500,000  
AU1234 AB  MIxxxxx  
  
KURS-DIFF.:          0,00  COURTAGE:          360,00  NOMINALE:
```

FDI - Anzeige von Geschäften - Maklertagebuch

Maklertagebuch Druckversion

- Hinweis:

Die Erweiterung um ein Ausgabefeld „Segment-MIC“ ist derzeit nicht vorgesehen.

FDI - Rahmenbedingungen - Stornierung von Geschäften

Hinsichtlich der Stornierung von Geschäften gelten folgende Aussagen:

- Wenn im Rahmen der Stornierung von Geschäften der Segment-MIC verändert werden soll, so ist das Geschäft zunächst in BxEM ST zu stornieren und danach in BxEM GE oder BxEM PE - mit dem angepassten Segment-MIC - neu zu erfassen.

FDI - Anzeige von Geschäften - Maklertagebuch

Maklertagebuch Druckversion

- Hinweis:

Die Erweiterung um ein Ausgabefeld „WKN“ ist derzeit nicht vorgesehen.

XONTRO
Systemanpassungen
- Listen & Files -

KI - Listen - Gedruckte Schlussnoten

Schlussnoten Druckversion

- Erweiterung um Ausgabefeld „Segment-MIC“

```
1234 RUCKZUCK BANK
ABRUF-NR.: G      1      US-ID: 192799
VERKAUF - DIREKTGESCHAEFT      GNR      : D 191119 0000001
DE0007100000 DAIMLER AG NA O.N.
NOM.: ST      100
KURS      : 50,0000      K-WERT: 5.000,00
KONT.: 1567 BAD-Bank GmbH
EING.: 1234 RUCKZUCK BANK AG
ABR.-BETRAG: 5.000,00      EUR
MIC: xxxx
EINGABE: 19.11.19 14.48.03      COURT.:      0,00
ABSCHLUSS: 19.11.19 12.00.00 AB
```

KI - CSV-Aufgabenfile

Bereitstellung eines CSV-Aufgabenfiles

- Dieser File-Transfer löst eine Aufgabenliste („Lieferliste offene Aufgaben“) ab, die derzeit von CBF erzeugt und an Kreditinstitute übermittelt wird. CBF hat angekündigt, diesen Service im Rahmen des SET-GO Projektes zum 14.06.2021 (NCSC) bzw. 22.11.2021 (CSC/NCSC-T) einzustellen. BrainTrade stellt eine alternative Datenquelle spätestens ab Anfang Juni 2021 bereit.
- Das File wird im CSV-Format mit Überschriftszeile erzeugt.
- Der Versand bzw. die Bereitstellung erfolgt über die bekannten File-Transfer-Verfahren (BT-Fileservice, CMA-Spool, connect:direct) und muss per Formular bei BrainTrade angefordert werden. Das Formular wird rechtzeitig bereitgestellt.

KI - CSV-Aufgabenfile

File-Aufbau

■ KV-NUMBER-OF-TRADING-PARTICIPANT		num	[4]
KZ-AUFGABEN-STATUS		char	[1]
ISIN		char	[12]
AUFGABEN-NR		num	[7]
SCHLUSSTAG		num	[8]
EINGEBER	[in Xitaro = KV-NUMBER-OF-QLP]	num	[4]
BOERSENPLATZ		char	[3]
KURS		snum	[13] *
NOMINALE		num	[17] **
AUSM-BETRAG		snum	[17] ***
WRG-AUSM-BETRAG-AUFG		char	[3]
KZ-AUFGABEN-ART		num	[3]
EINGABE-DATUM		num	[8]
TAGES-ZAEHLER		num	[3]
KZ-TAGESGESCHAEFT		num	[3] ****

* = Erläuterung siehe bitte folgendes Slide

KI - CSV-Aufgabenfile

File-Aufbau - Erläuterung * bis ***

- KURS snum[13]*
 13 Stellen insgesamt
 Vorzeichen, 7 Vorkommastellen, Dezimalpunkt, 4 Nachkommastellen

- NOMINALE num[17]**
 17 Stellen insgesamt
 12 Vorkommastellen, Dezimalpunkt, 4 Nachkommastellen

- AUSM-BETRAG snum[17]***
 17 Stellen insgesamt
 Vorzeichen, 13 Vorkommastellen, Dezimalpunkt, 2 Nachkommastellen

- KZ-TAGESGESCHAEFT
 num[3] ****
 nur von Xitaro belegt

**Timeline und
Ansprechpartner**

CSDR & CBF Project SET-GO

XONTRO – Schnittstellenanpassungen – Timeline



Timeline – SAKI SWIFT, SAKI FIX, SNO-DT, Dialog

Kundeninformation - CSDR NL 03			30.10.2020 ✓
XONTRO-SAKI-Fix – RoE – Planning	(Version 2.3.8)		30.10.2020 ✓
XONTRO-SAKI-SWIFT – TA – Planning	(Version 5.56)		30.10.2020 ✓
XONTRO-SAKI-SWIFT – SNO-DTA – Planning	(Version 21.6)		30.10.2020 ✓
XONTRO-SAKI-Fix – RoE – Planning	(Version 2.3.8)	<i>keine Änderungen</i>	04.12.2020 ✓
XONTRO-SAKI-SWIFT – TA – Planning	(Version 5.56)	<i>keine Änderungen</i>	04.12.2020 ✓
XONTRO-SAKI-SWIFT – SNO-DTA – Planning	(Version 21.6)	<i>keine Änderungen</i>	04.12.2020 ✓

Keine Auslieferung der SWIFT-Konverter Version an SAKI-TLN durch die Firma MSG

Start Simulation	XONTRO Release tbd	05.04.2021
Start Produktion	XONTRO Release tbd	24.05.2021
Anwendung des CSDR Settlement Discipline Regimes durch CBF		01.02.2022

CSDR & CBF Project SET-GO

XONTRO – Schnittstellenanpassungen – Timeline



Timeline – QSAM - Release 02

XONTRO Modification Announcement	(CSDR & SET-GO Newsletter 03)		30.10.2020 ✓
XONTRO Values API - Planning	(Version 02.01)		30.10.2020 ✓
XONTRO Member Simulation Guide	(Version 02.01)		04.12.2020 ✓
Security Administration Guide	(Version 01.01)	<i>keine Änderungen</i>	04.12.2020 ✓
XONTRO Values API - Programming	(Version 02.02)		04.12.2020 ✓
XONTRO Technical Description	(Version 01.06)	<i>keine Änderungen</i>	04.12.2020 ✓
XONTRO Header-Files			05.03.2021
XONTRO Values API - Final			05.03.2021
Start Simulation	XONTRO QSAM - Release 02		05.04.2021
Start Produktion	XONTRO QSAM - Release 02		24.05.2021
Anwendung des CSDR Settlement Discipline Regimes durch CBF			01.02.2022

CSDR & CBF Project SET-GO

BrainTrade – Team



CSDR - Team

- Dr. Sebastian Störmer
+49 (0)69 – 589978 – 140
sebastian.stoermer@xontro.de
- Markus Sperzel
+49 (0)69 – 589978 – 100
markus.sperzel@xontro.de
- Armin Latell (QSAM)
+49 (0)69 – 589978 – 170
sam@xontro.de