



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 54

In XONTRO werden zum 28. November 2011 produktiv die folgenden Änderungen eingesetzt:

1. (Nur FIX Anbindung:) Änderungen in der Plausibilitäts-Prüfung bei übermittelten Order-Änderungen
2. (Nur FIX Anbindung:) Kennzeichnung „Orderlöschung wegen Jahresende“
3. (Nur FIX Anbindung:) Erweiterung des FIX Execution Report um „Stückzinstage“ (bei Renten) und „KZ (außer)börslich“
4. Änderungen im Schlussnoten-Datenträger (MT512) wegen „FIX OTC Schlussnoten“ und „Neue Börsenplätze für Scoach“

## 1. Änderungen in der Plausibilitäts-Prüfung bei übermittelten Order-Änderungen

Bei über FIX übermittelten Orderänderungen wird in Zukunft für XONTRO (nicht für andere Handelssysteme) geprüft, ob die OrderQty (Tag 38) identisch mit der ursprünglichen Ordernominale ist. Falls nein, wird die Orderänderung mit einer Fehlermeldung abgelehnt.

Ebenfalls abgelehnt wird in Zukunft eine formal korrekte über FIX übermittelte Orderänderung für XONTRO, wenn de facto in keinem der änderbaren Felder eine Änderung enthalten ist.

Diese Änderungen sind im XONTRO Test- und Abnahmesystem IMS27 bereits aktiv und können somit ab sofort von den Teilnehmern getestet werden.

## 2. Kennzeichnung „Orderlöschung wegen Jahresende“

Beginnend mit dem Jahreswechsel 2011/2012 werden in der XONTRO FIX Schnittstelle alle Nachrichten betreffend Orders, die wegen des Jahreswechsels gelöscht wurden, mit einem entsprechenden „Nebenrecht“ („Löschvermerk“) versehen. Die Kennzeichnung erfolgt als Textstring „YEAREND“ im Feld UpdateReason im Tag 5862. Somit ist für die Teilnehmer in der Nachricht zweifelsfrei erkennbar, dass diese Orderlöschung wegen des Jahreswechsels erfolgte, und nicht aus einem anderen Grund.

Diese Orderlöschung wird **am Abend des 27. Oktober 2011 in unserem Test- und Abnahmesystem IMS27 simuliert**. Das bedeutet: An diesem Tag werden abends im Batch alle XONTRO Orders, deren **Gültigkeit über den 31. Dezember 2011 hinaus geht**, systemseitig im IMS27 gelöscht, und es werden die entsprechenden FIX Orderlöschnachrichten erstellt und an die Teilnehmer ausgegeben. Diese Nachrichten sind dann entsprechend am Freitag, den 28. Oktober 2011, von den Teilnehmern zu verarbeiten. Banken, die bereits über FIX aktiv sind und die Orderlöschung zum Jahresende testen möchten, sollten deshalb vorab entsprechend befristete Orders ins IMS27 einstellen. Eine formale Anmeldung für diesen Test ist nicht erforderlich.

Diese Orderlöschung umfasst dabei alle in der Simulations-Umgebung (IMS27) vorhandenen XONTRO Orders, nicht nur die über FIX eingestellten.<sup>1</sup> Wir bitten Sie, diesen Umstand bei der Planung Ihrer Test- und Simulations-Aktivitäten im IMS27 zu berücksichtigen.

<sup>1</sup> Orders, die nach Xetra geroutet wurden, werden hierbei natürlich nicht gelöscht.

### 3. Erweiterung des FIX Execution Report um „Stückzinstage“ (bei Renten) und „KZ (außer)börslich“

Der FIX Execution Report wird – analog zum MT519 im SAKI – um folgende zwei Felder erweitert:

- Stückzinstage bei Renten (Tag 157 NumDaysInterest)
- Kennzeichen „(außer)börslich“ (Tag 7680 OTCInd)

Die Beschreibung wurde in der neuen FIX RoE Version 2.05 entsprechend aufgenommen bzw. geändert; diese Version ist unter [www.xontro.de](http://www.xontro.de) im Internet abrufbar. Der Test dieser geänderten Funktionalität ist in dem XONTRO Test- und Abnahme-System (IMS27) bereits heute möglich.

### 4. Änderungen im Schlussnoten-Datenträger (MT512)

Ebenfalls zum 28. November 2011 wird das Layout im Schlussnoten-Datenträger (MT512) geringfügig erweitert. Dies betrifft die folgenden beiden Punkte:

- Im Textfeld (4. Zeile) im Etikett 72 kann nun bei über FIX eingegebenen OTC Geschäften auch die Textkonstante „FIX/“ bzw. „FIXF/“ stehen.
- Das Feld „Börsenplatz“ im Etikett 31P: Abschlussangaben kann nun „technisch“ drei neue Werte für die neu einzurichtenden Börsenplätze bzw. Kontrollsegmentbörsen für Scoach („851“, „852“ und „853“) annehmen, da geplant ist, auch für Geschäfte von diesen neuen Börsenplätzen einen Schlussnoten-Datenträger-Bezug durch die Teilnehmer zu ermöglichen. Jedoch ist aus heutiger Sicht die Inbetriebnahme dieser neuen Börsenplätze frühestens für 2012 geplant; insofern handelt es sich bei dieser Erweiterung zunächst um eine rein technische Maßnahme. Bei der Einführung dieser neuen Börsenplätze wird eine diesbezügliche Teilnehmer-Simulation angeboten werden, über die wir die Teilnehmer dann entsprechend informieren werden.

Diese beschriebenen Änderungen sind bereits im IMS27 wirksam und auch in der neuesten Version der Schlussnoten-Datenträgerbeschreibung 21.2, gültig ab 28.11.2011, im Internet unter [www.xontro.de](http://www.xontro.de) abrufbar.