



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 56

In XONTRO werden **zum 26. März 2012** produktiv die folgenden Änderungen eingesetzt:

1. Die Gründe für Order-Änderungen bzw. -Löschungen werden nun im FIX Execution Report mit ausgegeben (Nur FIX Anbindung)
2. Der Bezug des „Files Historische Nachrichten“ ist nun auch im FIX Format möglich (Nur FIX Anbindung)
3. Der FIX Trade Capture Report SNO wird um die bisher noch fehlenden Schlussnoten-Felder aus dem MT512 erweitert (Nur FIX Anbindung)
4. Bankdirektgeschäfte werden vereinfacht: Wegfall der Standard-Provision, -Courtage und der so genannten „Wegen-Geschäfte“

Hinweis: Für die oben unter 1. bis 3. gelisteten Punkte existiert eine **neue FIX RoE Version 2.06**, die ab sofort auf der XONTRO Internet Seite www.xontro.de abgerufen werden kann.

1. Ausgabe der Gründe für Order-Änderungen bzw. –Löschungen im FIX Execution Report

Derzeit kann beim Löschen einer Order in vielen Fällen nicht erkannt werden, weshalb diese gelöscht wurde. Daher werden in Zukunft in den Ereignismitteilungen die Nebenrechte als Grund für die Änderung bzw. Löschung mit aufgenommen. Wird eine Order aufgrund eines Nebenrechtes oder wegen des Jahresendes gelöscht, so wird dies aus dem entsprechenden Execution Report ersichtlich sein.

Der FIX Execution Report wird um ein neues Tag 5862 erweitert, das nur bei Änderungen und Löschungen von Orders geliefert wird, die aus einem von folgenden Ereignissen bzw. Aktionen generiert werden:

- Kursaussetzung (AUSG)
- Nebenrecht (EXDI, EXDA,...)
- Stammdatenänderungen (ENOT, MSEG, ...)
- Orderverfall, Löschungen im Xetra-EOD-Batch
- Befristung (Löschungen zum Jahresende)
- Löschung nicht akzeptierter EG-Orders
- Löschung der nicht ausgeführten Nominalen bei FOK-, IOC- und MTL-Orders
- Kassaspitze bei einer Teilausführung in XONTRO

Für jeden der genannten Fälle enthält das Tag 5862 einen eindeutigen Wert.

2. Bezug des „Files Historische Nachrichten“ auch im FIX Format

Analog zum Angebot für den Systemanschluss für Kreditinstitute (SAKI) steht nun den FIX Kunden im Bedarfsfall ebenfalls eine tägliche Datei „File Historische Nachrichten“ im FIX Format zur Verfügung.

Der File enthält keinen Vor- und keinen Nachsatz, sondern nur eine Überschrift und - wenn vorhanden – Datensätze. Für jede FIX Zentrale wird ein File erstellt, d.h. es wird keine weitere Verarbeitungs-Steuerung – wie beim SAKI – benötigt.

Die Datei wird auf Wunsch einmal täglich abends im XONTRO EOD-Batch erstellt und versendet. Dieser zusätzliche Service kann von den XONTRO FIX Kunden mittels einer formlosen E-Mail an die Adresse saki@xontro.de beauftragt werden.

3. Erweiterung des FIX Trade Capture Report SNO um die bisher noch fehlenden Schlussnoten-Felder aus dem MT512

Die FIX-Nachricht Trade Capture Report SNO wird um ein neues Text-Feld erweitert, das alle für die Erstellung einer SWIFT-Nachricht (MT512) bisher noch fehlenden Felder enthält. Für das neue Text-Feld wird das folgende FIX-Tag vorgesehen:

- **6732 DealerNote:** Free-form text to be sent to the dealer(s) participating in the trade during negotiation

Die Felder werden im Tag 6732 in folgender Reihenfolge geliefert:

FIX	SAKI			
Trade Capture Report SNO		MT 512		
Tag	Feldname	Feldname	Feld	Format
6732	DealerNote			
	KZ-LF	Geschäftsart - Kennzeichen-Lieferfreigabe	23	X(01)
\	Abw.-Kontr-Kurs	Abschlussangaben - abweichender Kontrahentenkurs	31P	9(06),9(4)
\	KZ-AS	Abschlussangaben - Kennzeichen abweichender Schlusstag	31P	X(02)
\	WP-Art	Art des Wertpapiers	35A	X(03)
\	Verwahrart	Verwahrart	35B	9(03)
\	Z-Termin	Zinstermin	35B	X(08)
\	APMT	Käufer / Verkäufer - Konstante 'APMT'	87F	X(04)
\	AK-WHR	Abschlusskurs - Währungskennzeichen	33T	X(03)
\	KW-WHR	Kurswert - Währungskennzeichen	32M	X(03)
\	KDIFF-WHR	Kursdifferenz - Währungskennzeichen	32S	X(03)
\	STZ-WHR-KZ	Stückzinsen - Währungskennzeichen	34G/H	X(03)
\	FEES	Gebühren und Spesen - Konstante /BROK/, /FEES/, /MISC/, /COMM/	71C	6 * X(06)
\	FEES-WHR	Gebühren und Spesen - Währungskennzeichen bei BROK, MISC, FEES, COMM	71C	6* X(03)
\	KZ-WA	Gebühren und Spesen - Kennzeichen für Wiederanlagerabatt	71C	X(02)
\	KZ-Boni	Gebühren und Spesen - Kennzeichen für Bonifikation	71C	X(02)
\	BONI-Schlüssel	Gebühren und Spesen - Bonischlüssel	71C	X(02)
\	KZ-Boni-DIFF	Gebühren und Spesen - Kennzeichen Boni Differenzbetrag	71C	X(02)

Im Tag 6732 werden die Felder jeweils in voller Länge und zusätzlich mit '\ ' getrennt enthalten sein. Das Tag 6732 wird es nur in der jeweils ersten Nachricht geben.

4. Vereinfachung von Bankdirektgeschäften in XONTRO

Wie bereits vorab angekündigt, wird die Verarbeitungssteuerung für Bankdirektgeschäfte (Steuerung von Courtage und Provision) in der Dialogmaske BxIN EP abgeschaltet werden. Auswertungen der haben ergeben, dass es praktisch keine Bankdirektgeschäfte mit Provision oder Courtage mehr gibt.

Daher sind Bankdirektgeschäfte ab dem 26. März 2012 standardmäßig ohne Courtage und ohne Provision ausgestattet. Wenn im Einzelfall dennoch Courtage oder Provision berechnet werden soll, ist das weiterhin mit den Zusatzangaben AC „Abweichende Courtage“, PD „Abweichende Provision in EURO“ oder PM „Abweichende Provision in Promille“ möglich.

Da viele Banken den Bankdirektgeschäften zur Zeit die Zusätze „FC“ (Franco Courtage) oder „FR“ (Franco Alles) mitgeben, bleiben diese Zusatzangaben bis auf Weiteres erlaubt, obwohl sie ab dem 26. März 2012 unnötig sind. Das Gleiche gilt sinngemäß auch für den Zusatz „HC“ (Halbe Courtage).

Weitere Auswertungen haben gezeigt, dass auch die Funktion der sogenannten „Wegen-Geschäfte“ praktisch nicht mehr genutzt wird. Ab dem 26. März 2012 wird daher die Eingabe von Wegen-Ordern und damit die Erzeugung von Wegen-Geschäften nicht mehr möglich sein.