



XONTRO
Schnittstellenanpassungen

CSDR
Newsletter 04.00

BrainTrade GmbH
Börsenplatz 4
60313 Frankfurt/Main

- 31.03.2021 -
(update - QSAM Seite 24)

XONTRO-Schnittstellenanpassungen für CSDR

- Termine
- Schnittstellenanpassungen - KI - SAKI-FIX
- Schnittstellenanpassungen - KI - SAKI-SWIFT
- Schnittstellenanpassungen - FDI - QSAM
- Systemanpassungen - KI - Dialog
- Systemanpassungen - FDI - Dialog
- Systemanpassungen - KI - Listen - Gedruckte SNO
- Timeline der Schnittstellenanpassungen

CSDR Implementierung in XONTRO

- Hinsichtlich der XONTRO Implementierung und zeitlichen Umsetzung gehen wir derzeit von folgenden Terminen aus:
 - Bereitstellung im Simulationssystem IMS27
 - Schnittstellen (KI-Fix, KI-SWIFT, QSAM) 06.04.2021 (Di.)
 - 3270-Dialoge (KI, Makler) 19.04.2021
 - Bereitstellung im Produktionssystem 24.05.2021
 - Anwendung des Settlement Discipline Regimes durch die Clearstream Banking AG 01.02.2022

XONTRO
Schnittstellenanpassungen

CSDR
Rahmenbedingungen

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

Relevante Bereiche der CSDR Implementierung

- 1 - Trade-Eingangsschnittstellen
- 2 - Trade-Eingangsschnittstelle für Max-ONE
- 3 - Trade-Ausgangsschnittstellen
- 4 - Trade-Liste - Gedruckte Schlussnoten

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

4 - Trade-Listen

- CSDR

- 1 - KI - Liste - Gedruckte Schlussnoten

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] 6n
		- Datum-Festvaluta (JJMMTT) oder <u>Dummywert</u> '000000', falls keine Eingabe erfolgt ist	6n
		- Eingabe-Uhrzeit (<u>HHMMSS</u>)	/[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 - Strukturерweiterung - bc_request_enter_single_tradeT

- venueSegMic char[4]

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

BC_ENTER_EXCHANGE_TRADE_RID

CSDR Strukturерweiterung - 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.

Relevante Bereiche - FDI - Systemanschluss Makler (QSAM)

- XONTRO System Status News

Der Stream XONTRO System Status News erhält vom Back End alle relevanten Änderungen des Systemstatus der Back End Applikation und des Back End. Außerdem werden über diesen Stream alle eingegebenen Nebenrechte übermittelt.

Neue Nachricht

- BCBE_STARTOFDAY (Start Tagesverarbeitung)

Hinweis

Die Nachricht steht nicht im Zusammenhang mit der CSDR-Implementierung, sondern wurde auf Teilnehmerwunsch hinzugefügt.

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 - Eingabe von Geschäften - wertpapierbezogen

BxEG EW

- Erweiterung um Eingabemöglichkeit „Segment-MIC“ in Zusatzangaben

```
TRAN: BREG FC: EW SB:
XONTRO / EINGABE WERTPAPIERBEZOGEN                4002/99 RUCKZUCK BAN
GATTUNG      KURS      ZUSATZANGABEN
.....      .....      MIxxxx.....
GA NOMINALE  KONT  AU    ZUSATZANGABEN
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
. ....      . . . . .
```

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  
ABRUF-NR.: G      1      US-ID: 192799  
VERKAUF - DIREKTGESCHAEFT      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  
MIC: xxxx  
  
ABR.-BETRAG: 5.000,00      EUR  
  
EINGABE: 19.11.19 14.48.03      COURT.:      0,00  
ABSCHLUSS: 19.11.19 12.00.00 AB
```

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 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 MIxxxx  
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 MIxxxx  
  
KURS-DIFF.:           0,00  COURTAJE:           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.

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
V-ART: GS

KONT.: 1567 BAD-Bank GmbH
EING.: 1234 RUCKZUCK BANK AG
MIC: xxxx

ABR.-BETRAG: 5.000,00      EUR

EINGABE: 19.11.19 14.48.03      COURT.:      0,00
ABSCHLUSS: 19.11.19 12.00.00 AB
```



**Timeline und
Ansprechpartner**

CSDR

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 33.6	06.04.2021 (Di.)
-------------------------	---------------------	-------------------------

Start Produktion	XONTRO Release 33.6	24.05.2021
-------------------------	---------------------	-------------------

Anwendung des CSDR Settlement Discipline Regimes durch CBF	01.02.2022
---	-------------------

CSDR

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	06.04.2021 (Di.)
-------------------------	--------------------------	-------------------------

Start Produktion	XONTRO QSAM - Release 02	24.05.2021
-------------------------	--------------------------	-------------------

Anwendung des CSDR Settlement Discipline Regimes durch CBF		01.02.2022
---	--	-------------------

CSDR

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