



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 20

In XONTRO wird am 24. Oktober 2005 (unter anderem) folgende Änderung eingeführt:

- Möglichkeit des *realtime* Schlussnoten-Bezugs über den Systemanschluss für Kreditinstitute (SAKI)

Inhaltsverzeichnis:	Seite
1. Begriffsdefinition	2
2. Zusammenfassung	2
3. Details und Restriktionen	3
4. Einrichtung und Steuerung	4

Hinweis: Das XONTRO Release zum 24.10.2005 beinhaltet noch weitere Änderungen, über die Sie von BrainTrade in einem separaten späteren XONTRO Newsletter für Kreditinstitute informiert werden werden. Dieser XONTRO Newsletter Nr. 20 dient der Vorab-information über das Thema „Schlussnotenbezug *realtime* über SAKI“.

Schlussnotenbezug *realtime* über SAKI

1. Begriffsdefinition

Zur begrifflichen Unterscheidung der Funktionalitäten wird der Handelsteilnehmer, für den die Schlussnote erstellt wurde, weil er an dem Geschäft als Kontrahent beteiligt war, in diesem Dokument als „Schlussnoten-Empfänger“ bezeichnet; derjenige Teilnehmer, der über einen Systemanschluss für Kreditinstitute (SAKI) verfügt, über den die Schlussnoten *realtime* verschickt werden sollen, als „Schlussnoten-Bezieher“. Schlussnoten-Empfänger und Schlussnoten-Bezieher sind nur dann identisch, wenn der SAKI-Inhaber (bei dezentralem Systemanschluss) bzw. die SAKI-Zentrale (bei zentralem Systemanschluss) (auch) „seine eigenen“ Schlussnoten beziehen möchte.

2. Zusammenfassung

Es soll für Banken möglich werden, Schlussnoten *realtime* über den Systemanschluss Kreditinstitute (SAKI) zu beziehen. Primäre Zielgruppe sind hierbei die heutigen Bezieher des Schlussnotendatenträgers über *file transfer* (SNO-DTA), die gleichzeitig auch über einen SAKI verfügen. Der Schlussnotenbezug *realtime* über SAKI ist aber auch für solche Schlussnoten-Empfänger möglich und interessant, die bisher keine Schlussnoten über *file transfer* (SNO-DTA) beziehen.

Der Vorteil des Schlussnotenbezugs *realtime* über den SAKI besteht für die Banken zum einen darin, sowohl die hausinterne Geschäftsabstimmung als auch die Abrechnung gegenüber dem Bankkunden (z.B. Anleger) – einschliesslich der korrekten Abrechnung von Stückzinsen und Courtage – noch schneller und zeitnäher als bisher durchführen zu können; zum anderen können Unstimmigkeiten und Probleme in der Geschäftsabwicklung (z.B. bei Stückzinsdifferenzen oder abweichenden Ausführungspreisen) noch schneller und zeitnäher als bisher entdeckt, analysiert und ggf. bereinigt werden. Außerdem können so alle handelsrelevanten Informationen aus XONTRO über eine einheitliche technische Schnittstelle – den Systemanschluss für Banken – bezogen werden; ggf. kann auf den Bezug der Schlussnoten im SNO-DTA-Format sogar verzichtet werden.

Der Versand der *realtime* Schlussnoten über SAKI erfolgt dabei, je nach Parametrisierung beim „Schlussnoten-Bezieher“, ohne, mit DWZ- oder mit bankinterner Orderreferenz. Zusätzliche weitere Steuerungsparameter werden nicht unterstützt. Im Fall von Schlussnoten aus Bankdirektgeschäften (OTC) wird die so genannte „Bankinterne OTC Nummer“ – falls vorhanden – immer mitgeliefert. Die Option des Schlussnotenbezugs *realtime* über SAKI soll zunächst nur für Schlussnoten aus XONTRO und INVESTRO verfügbar sein.

Es wird dabei möglich sein, sowohl die „Schlussnoten-Bezieher“ als auch weitere „Schlussnoten-Empfänger“ (definiert über deren CBF-Kontonummern) für die Übermittlung ihrer Schlussnoten gezielt frei zu schalten.

Der Nachrichtenversand erfolgt in XONTRO im S.W.I.F.T. MT512 / MT599 Format, unter Beachtung der gültigen Regeln für den Nachrichtenaustausch im SAKI.

Als Einsatztermin für diese neue Funktionalität ist der 24. Oktober 2005 vorgesehen.

3. Details und Restriktionen

Banken können sich für den Bezug von Schlussnoten *realtime* via SAKI freischalten lassen. Unabhängig davon können die Banken wie bisher den Schlussnotendatenträger über *file transfer* empfangen. Die Übertragung der Schlussnoten im SAKI muss vom Schlussnoten-Bezieher bei BrainTrade beauftragt werden.

Bei der Erstellung der Nachricht wird ein neuer Parameter 'MIT ORDERNUMMER' – analog der SNO-Datenträgererstellung – berücksichtigt. Bei Wahl der bankinternen Orderreferenz und bei Nichtexistenz einer solchen Orderreferenz soll stattdessen – analog der SNO-Datenträgererstellung – die DWZ-Orderreferenz – falls vorhanden – mitgegeben werden. Weitere Parameter zur Steuerung des Schlussnotenversands über SAKI sind nicht vorgesehen.

Zusätzlich können für jeden Schlussnoten-Bezieher beliebig viele weitere „Banken“ (CBF Kontonummern der „Schlussnoten-Empfänger“) benannt werden, deren Schlussnoten dann ebenfalls an diesen Schlussnoten-Bezieher übermittelt werden. Als „Schlussnoten-Empfänger“ gilt in diesem Sinn dasjenige CBF Konto, das als (Kauf- oder Verkauf-) Kontrahent in dem zugrundeliegenden Geschäft benannt wurde. Der „Schlussnoten-Empfänger“ muss in keinem (organisatorischen, fachlichen, technischen, ...) Zusammenhang mit dem „Schlussnoten-Bezieher“ stehen.

Eventuell bestehende „Reg-Über“ oder sonstige Steuerungen, gemäß derer die Schlussnoten im bisher bestehenden Datenträgerformat an eine andere als die Kontrahenten-Adresse geschickt werden, bleiben hierbei generell unberücksichtigt, ebenso wie die Zuordnung einer SAKI-Filiale zu einer SAKI-Zentrale. Das bedeutet: An die Schlussnoten-Bezieher werden (falls gewünscht) ihre eigenen sowie die Schlussnoten derjenigen „Banken“ (= CBF Konten) *realtime* geschickt, die vom Beauftragter explizit benannt werden. Falls an einen Schlussnoten-Bezieher auch die Schlussnoten der zugehörigen SAKI-Filialen *realtime* gesendet werden sollen, so sind diese Filialen ebenfalls explizit zu benennen. Dies gilt auch für den Fall, dass Schlussnoten-Empfänger = Schlussnoten-Bezieher. Es ist also auch möglich, dass der Schlussnoten-Bezieher nur die Schlussnoten anderer Schlussnoten-Empfänger bezieht und nicht seine eigenen.

Die ausgehenden Nachrichten werden wie bisher mit einer eindeutigen Output-Sequence-Number (OSN) im Nummernkreis 600.001 bis 999.999 gespeichert. Es werden Schlussnoten der Abrufgruppen A (Aufgaben; diese erst aus dem Buchungsschnitt, ausgenommen Aufgaben aus Makler-PUEV), G (XONTRO-Geschäfte), S (Storni) und V (INVESTRO-Geschäfte) *realtime* übermittelt.

Die Folgesätze MT599 zu einem MT512 werden in der Regel ebenfalls mit aufsteigender OSN übermittelt. Sollte die Bank jedoch parallel Geschäfte (MT511) über den SAKI einstellen – oder aber aus anderen Grund –, so kann nicht garantiert werden, dass die (OSNs der) MT599-Sätze den (OSNs der) MT512-Sätze(n) unmittelbar hintereinander folgen, denn die OSNs der Bestätigungen (MT596) zu den MT511 werden (z. B.)

ebenfalls aus diesem Nummernkreis vergeben.

Die *realtime* erzeugten Schlussnoten werden gesondert gezählt und mit 0,06 € bepreist.

Die *realtime* Schlussnoten können nur „aktuell“ am Tag der Erzeugung mittels einer Retrieval-Anforderung vom Schlussnoten-Bezieher im SAKI nachgefordert werden.

Für *realtime* erzeugte Schlussnoten gibt es keine Kennzeichnung für die letzte erzeugte Schlussnote.

Nach Übertragung der letzten Schlussnoten wird der BOEND gesendet.

Eine spezielle proprietäre Steuerung der Schlussnoten *realtime* für den (CCP) Clearer analog SNO-DTA ist nicht vorgesehen.

4. Einrichtung und Steuerung

Die Schlussnoten-Bezieher müssen für die Nutzung der neuen Nachricht „Schlussnoten *realtime*“ eingerichtet werden. Der Auftrag für die Einrichtung hat schriftlich bei BrainTrade unter Angabe des gewünschten Stichtages zu erfolgen. Außerdem muss angegeben werden, ob in der *realtime* Schlussnote die DWZ-Ordernummer, die bankinterne Ordernummer oder keine Ordernummer enthalten sein soll. Bankinterne OTC-Nummern bei Bankdirektgeschäften werden – falls vorhanden – immer mit übermittelt.

Die Zuordnung wird nach erfolgter Einrichtung sofort wirksam. Bei „stichtagsbezogenen“ Änderungen am Morgen des gewünschten Änderungsdatums noch vor Beginn der Kursfeststellungszeiten besteht aber dennoch die Möglichkeit, dass zum Zeitpunkt des Eintrags der Zuordnung bereits Geschäfte (Banken OTCs oder maklervermittelte Direktgeschäfte) vorliegen, die von der Änderung der Zuordnung nicht mehr berücksichtigt werden.

Frankfurt Main, den 3. Juni 2005

BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH