



Ergänzung zu

XONTRO Newsletter

Kreditinstitute Nr. 49

Makler Nr. 42

Antworten
auf häufig gestellte Fragen
im Zusammenhang
mit der Migration von XONTRO auf Xetra Frankfurt 2

XONTRO / Kreditinstitute
XONTRO / Makler

Ergänzung zu Newsletter Nr. 49
Ergänzung zu Newsletter Nr. 42

Antworten auf häufig gestellte Fragen im Zusammenhang mit der Migration von XONTRO auf Xetra Frankfurt 2

Der XONTRO Newsletter für Kreditinstitute Nr. 49 bzw. XONTRO Newsletter für Makler Nr. 42 beschreibt die Änderungen, die sich durch die Migration des Börsenhandels von XONTRO Frankfurt auf Xetra Frankfurt 2 für die XONTRO Teilnehmer ergeben. In der derzeit laufenden Simulation wurden einige Fragen häufig gestellt, so dass wir sie in dieser Ergänzung zu den genannten Newslettern (nochmals) dokumentieren.

1. Zwangsschließung von Aufgaben am Abend des 20. Mai

Börsliche Aufgaben, die am Abend des 20. Mai noch offen sind, werden am Abend des 20. Mai zwangsgeschlossen. Das bedeutet, dass am gleichen Tag Aufgaben-Schlussnoten und Aufgabenschließungen für eben diese Aufgaben entstehen können und beide im letzten Schlussnotenlauf ausgeliefert werden. Im Makler-PÜEV ist das bisher schon möglich, nicht aber bei Platz-Aufgaben. Insbesondere Banken, die nicht am Makler-PÜEV teilnehmen, sollten sicher stellen, dass sie diese Variante verarbeiten können.

Außerbörsliche Aufgaben in migrierten und nicht-migrierten Gattungen bleiben bestehen und können weiterhin in XONTRO bearbeitet werden. Es können auch weiterhin außerbörsliche Aufgaben aus Geschäften außerhalb der Kursfeststellung entstehen.

2. Schlussnoten

Die XONTRO-Datenträger (Parkett) enthalten ab dem 23. Mai für den Börsenplatz Frankfurt keine börslichen Geschäfte mehr. Für die Handels-Schlussnoten aus Xetra Frankfurt 2 ist gegebenenfalls bis spätestens 11. Mai eine neue Übertragung zu beauftragen; diese läuft nur einmal täglich.

Außerdem können nun auch CCP Geschäfte auf Xetra Frankfurt 2 entstehen; daher ist auch der Bezug der so genannten „OLN“ („Order Level Netting“) Schlussnoten-Datenträger aus Xetra Frankfurt 2 als zusätzlicher, separater Dateilieferung möglich. Auch diese Übertragung ist bis spätestens 11. Mai zu beauftragen.

XONTRO / Kreditinstitute

Ergänzung zu Newsletter Nr. 49

XONTRO / Makler

Ergänzung zu Newsletter Nr. 42

3. Stornierung von Geschäften am 23. Mai

Am 23. Mai sind die Stornofunktionen für Makler bis 15:00 h gesperrt.

Daher können am 23. Mai keine Makler-vermittelten Geschäfte vom 20. Mai aus XONTRO Frankfurt mehr storniert werden. Geschäfte vom 23. Mai aus XONTRO Frankfurt können ab 15:00 h storniert werden.

Bankdirektgeschäfte sind dagegen wie gewohnt stornierbar.

4. Buchungsschnitt

Wegen der zusätzlichen Zwangsschließungen von Aufgaben rechnen wir damit, dass der Buchungsschnitt am 20. Mai etwa 15 Minuten länger dauert. Die entsprechenden Nachrichten und files werden daher etwa eine Viertelstunde später versandt.

5. Ablehnung von Kassa-Ordern in Xetra Frankfurt 2

Über den Systemanschluss Kreditinstitute (SAKI) eingestellte Kassa-Order werden in Xetra Frankfurt 2 abgelehnt. Die Kreditinstitute werden gebeten, ihre Verarbeitung entsprechend anzupassen.

6. Orderlöschung in XONTRO am 20. Mai 2011 abends

Alle in XONTRO Frankfurt am Abend des 20. Mai 2011 noch vorhandenen Orders werden im *end-of-day-batch* dieses Abends systemseitig gelöscht. Für Banken, die über einen „Systemanschluss für Kreditinstitute“ (SAKI) an XONTRO angebunden sind, und die die entsprechenden Nachrichtenströme – MT551 („Ereignis-Nachrichten zu Wertpapieren“) bzw. MT595 („Orderlösch-Nachrichten“) – eingeschaltet haben, werden an diesem Abend die entsprechenden Nachrichten vom System generiert und sind am Montag, den 23. Mai 2011, ab ca. 02:30 h per *retrieval* abrufbar. Die gelöschten Orders werden nicht per System wieder in Xetra Frankfurt 2 neu eingestellt; falls gewünscht, hat dies durch den Orderaufgeber selbst zu erfolgen.

Diese Vorgehensweise entspricht im Wesentlichen der bei der Einführung von Scoach bzw. der Übernahme der „Publikums-Fonds“ bereits praktizierten Methode; im Gegensatz zu früher werden nun aber alle auf XONTRO Frankfurt noch offenen Orders gelöscht. Daher ist an diesem Tag mit einem höheren Orderlöschaufkommen zu rechnen.

XONTRO / Kreditinstitute
XONTRO / Makler

Ergänzung zu Newsletter Nr. 49
Ergänzung zu Newsletter Nr. 42

7. Nutzung des Systemanschluss Makler und der XONTRO Dialog-Funktionen durch Frankfurter Makler

Im Gegensatz zu anders lautenden Behauptungen können Frankfurter Makler selbstverständlich den Systemanschluss weiter nutzen. Es entfallen nur die Funktionen, die von der Migration betroffen sind. Das heißt:

Die Order-relevanten Funktionen sind gesperrt. Quotieren über den Bypass und/oder Host nach Frankfurt wird ebenfalls nicht mehr möglich sein. Dazu werden die entsprechenden Kontingente auf 0 gesetzt. Außerdem werden die Profile für alle Order- und Ausführungsrelevanten Requests und dazugehörige Broadcasts sowie verschiedene Nachrichten des Stream 1 deaktiviert. Alle Teilnehmer müssen dafür sorgen, dass ihre entsprechenden Anwendungen gestoppt werden.

Alle übrigen Funktionen (Geschäftseingaben, Aufgabenbearbeitung...) des SAM bleiben auch für Frankfurter Makler offen.

Außerdem können auch die nicht-orderrelevanten XONTRO Dialog-Funktionen von Frankfurter Maklern weiter benutzt werden.