X-pand into the Future

eurex rundschreiben 171/09

Datum: Frankfurt, 15. September 2009
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

⚠ **Aktion erforderlich** ⚠ **Hohe Priorität**

Eurex Release 12.0: Aktualisierung der Schnittstellendokumentation

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 134/09, 154/09

Kontakt: Customer Technical Support, Tel. +49-69-211-1 17 10, E-Mail: cts@eurexchange.com

Zielgruppe:	**Aktualisierte Dokumente:** (nur auf der Eurex-Website)
➲ IT/System Administration	1. Eurex Enhanced Transaction Solution – Programming Version 2. VALUES API Member Front End Development Guide – Programming Version 3. Technical Release Notes (Final Version)

Zusammenfassung:

Im Rahmen von Eurex Release 12.0, das am **16. November 2009** in Produktion eingeführt wird, sind die Dokumente „Eurex Enhanced Transaction Solution – Programming Version“ und „VALUES API Member Front End Development Guide – Programming Version“ aufgrund zusätzlicher Erweiterungen der Schnittstellen aktualisiert worden. Die Dokumente sind in der Member Section der Eurex-Website zum Download unter dem folgenden Pfad veröffentlicht worden:

www.eurexchange.com > Member Section > Releases > Eurex 12.0 > Interfaces

Weiterhin wurden infolge der zusätzlichen Erweiterungen die „Technical Release Notes (Final Version)“ aktualisiert. Dieses Dokument ist in der Member Section der Eurex-Website zum Download unter dem folgenden Pfad veröffentlicht worden:

www.eurexchange.com > Member Section > Releases > Eurex 12.0

Eurex Deutschland
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
customer.support@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Thomas Book, Thomas Lenz,
Michael Peters, Andreas Preuß,
Peter Reitz, Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

Eurex Release 12.0: Aktualisierung der Schnittstellendokumentation

Erweiterungen an den Schnittstellen

Die Enhanced Transaction Solution- und VALUES API-Schnittstellen wurden nochmals erweitert und die Schnittstellendokumentationen entsprechend aktualisiert. Im Folgenden finden Sie einen Überblick über die Änderungen. Eine vollständige Aufzählung der Änderungen ist in den „Modification Notes“ enthalten.

Enhanced Transaction Solution

- **Konfiguration**
  Die Definition der Schnittstelle basiert auf der Enhanced Transaction Solution-Konfiguration: Config ID E120.36.01.

- **Rückwärtskompatibilität**
  Um für die Enhanced Transaction Solution-Schnittstelle Rückwärtskompatibilität zu schaffen, werden die Eurex Release 11.0-Layouts *EntQuoteReq, DelQuoteReq* und *EntMassQuoteReq* in das XML-Datenmodell integriert und als veraltet gekennzeichnet. Für Eurex Release 12.0 werden diese Layouts in *EntQuoteV2Req, DelQuoteV2Req* und *EntMassQuoteV2Req* umbenannt. Sie erhalten außerdem neue IDs. Dementsprechend müssen die Teilnehmersysteme, die das Eurex Release 12.0 XML-Datenmodell nutzen, in der Lage sein, Requests mit multiplen Layouts zu verarbeiten.

  Zusätzlich erhält der Request *MassQuoteNotif* eine neue ID, während der Eurex Release 11.0-Request *EntMassQuoteNotif* in das Eurex Release 12.0 XML-Datenmodell übernommen und als veraltet gekennzeichnet wird.

- **Aggressor-Flag**
  In einigen Message Flows wird die Verwendung des Aggressor-Flag von „optional for order” in „only for immediate executions“ geändert. Des Weiteren wird der Aggressor-Flag auch in zusätzlichen Message Flows hinzugefügt.

- **Geänderte Kardinalitäten**
  Die Kardinalität der folgenden Message Flows wird geändert: (Foreign Event) Delete Order or Quote, (Foreign Event) Enter Order, (Foreign Event) Mass Delete, (Foreign Event) Modify Order, (User) Enter Order, (User) Modify Order, (User) Retransmission.

- **Erweiterte Nachrichten zum Orderstatus**
  Einige Responses werden um das zusätzliche Feld *TrnTypCode* erweitert: *Enter Order Response, Delete Order Response, Modify Order Response, Enter Quote Response, Modify Quote Response, Delete Quote Response, Enter Mass Quote Response, Modify Mass Quote Response.*

- **Verarbeitung von Market Reallocation-Ereignissen**
  Zur Unterstützung der Teilnehmer bei der Verarbeitung von Market Reallocation-Ereignissen wird der Beginn des Zeitintervalls für die Market Reallocation angezeigt. Zu diesem Zweck werden zwei neue Felder, *lastGuarTrnId* und *lastGuarTrnTime,* den Nachrichten „(User) Retransmission“ und „(Foreign Event) Delete Order or Quote“ und der zugrunde liegenden Struktur „Order Status – Notification“ hinzugefügt.

- **(Match Event) Order or Quote**
  Der Message Flow *(Match Event) Order or Quote* wurde herausgenommen und durch zwei einzelne Message Flows *(Match Event) Order* und *(Match Event) Quote* ersetzt.

- **Zusätzliche Fehler-Codes für MassQuoteErrorId**
  MassQuoteErrorId wurde um zusätzliche Fehler-Codes ergänzt.

- **Verbesserung der Performance**
  Die Encoding-IDs verschiedener neuer Datenfelder werden auf Werte unter 128 reduziert. Dadurch erhöht sich nochmals die Performance der Enhanced Transaction Solution bei der Übertragung von Massen-Quotes. Die folgenden Felder, die sowohl Kauf- als auch Verkaufvolumina enthalten können, sind hiervon betroffen: *CumExecutedBuyQty, CumExecutedSellQty, DelBuyQty, DelSellQty, LastCumExeBuyQty, LastCumExeSellQty, LastDelBuyQty, LastDelSellQty, TotalBuyQty, TotalSellQty*.

Detaillierte Informationen zu den Änderungen sind in den Dokumenten „Enhanced Transaction Solution Interface Specification – Programming Version“ und „Enhanced Transaction Solution Modification Notes – Programming Version“ enthalten. Aktualisierungen seit der ersten Programmierungsversion von August 2009 sind darin mit Unterstreichungen gekennzeichnet.

VALUES API

- **Konfiguration**
  Die Definition der Schnittstelle basiert auf der VALUES-Konfiguration:
  CONFIG_IDENTIFIER E120.37.01.

- **Erweiterte Feldlänge für Feld *undrFinSetlPrc***
  Das Feld *undrFinSetlPrc* wird auf neun Zeichen erweitert.

- **Enter Quote Hold**
  Der Request *Enter Quote Hold* wurde aus der Schnittstelle herausgenommen.

- **expTypCod**
  Die gültigen Werte für das Feld *expTypCod* werden geändert. Das Feld bezeichnet den Verfallzeitpunkt. Wert „1“ steht für einen Verfall während des angegebenen Monats, Wert „2“ zeigt an, dass der Verfall im vorausgehenden Monat stattfindet.

- **Broadcast-Ströme zu Matching-Ereignissen**
  Die privaten Broadcast-Datenströme *Trade Confirmation, Single Leg Matching Event, Double Leg Matching Event* und *Strategy Matching Event*, die an Nicht-Clearing-Mitglieder gesandt werden, können nun auch von den zugehörigen Clearing-Mitgliedern abonniert werden.

- **Modify EBI Trade**
  Die Verwendung verschiedener Felder in den EBI-Requests *Modify EBI EFP-Fin Trade, Modify EBI EFP-Index Future Trade* und *Modify EBI EFS Trade* wird von „mandatory“ in „fixed mandatory“ geändert.

- **Private Member Message Type Code**
  Das Feld *privMembMsgCod* wurde erweitert, um eine Unterscheidung zwischen Market Reset- und Market Reallocation-Ereignissen zu ermöglichen.

- **Platzhalter für Felder *trdEvntSeqNoMin* und *trdEvntSeqNoMax***
  Im Request *Inquire All Strategy Trades* können nun für die Felder *trdEvntSeqNoMin* und *trdEvntSeqNoMax* Platzhalter verwendet werden.

Detaillierte Informationen zu den Änderungen sind in den Dokumenten „VALUES API Member Front End Development Guide – Programming Version“ und „VALUES API Modification Notes – Programming Version“ enthalten. Aktualisierungen seit der ersten Programmierungsversion von Juli 2009 sind darin mit Unterstreichungen gekennzeichnet.

Frankfurt, 15. September 2009