# Xetra-Rundschreiben 193/08

BÖRSE FRANKFURT

## Aktion erforderlich!

**An die Xetra®-Teilnehmer und Vendoren**

Empfänger: Technik, Handel, Projektkoordinatoren, Systemadministratoren


Geschäftsführung

Frankfurter Wertpapierbörse

Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt am Main

Postanschrift
60485 Frankfurt am Main

Telefon
+49-(0) 69-2 11-1 16 40

Fax
+49-(0) 69-2 11-1 16 41

Internet
deutsche-boerse.com


10. November 2008

**Xetra Release 9.1:**
**Produktionsstart und Vorbereitungen bei den Teilnehmern sowie Bereitstellung des Xetra J-Trader User Manual (finale Version)**

Sehr geehrte Damen und Herren,

mit dem vorliegenden Rundschreiben möchten wir Sie, zur Vorbereitung auf den bevorstehenden Produktionsstart von Xetra Release 9.1 am 24. November 2008, auf die notwendigen Aktivitäten vor und während der Release-Einführung hinweisen. Sie finden dazu die folgenden Informationen in diesem Rundschreiben:

1) Versand der Xetra Release 9.1 Frontend Software-Kits
2) Installation der Xetra Release 9.1 Frontend Software-Kits
3) Verteilung der @Xetra Release 9.1 Produktionssoftware über Java Web Start
4) Zeitablauf vor Einführung von Xetra Release 9.1
5) Notfallplanung für den Produktionsstart von Xetra Release 9.1
6) Trading on Behalf
7) Verfügbarkeit der Simulation
8) Produkteinführung Fonds

Zusätzlich mit diesem Schreiben möchten wir Sie informieren, dass die finale Version des Xetra J-Trader User Manual für Xetra Release 9.1 ab sofort auf der Website der Gruppe Deutsche Börse www.deutsche-boerse.com zum Download zur Verfügung steht. Der Pfad lautet:

Trading & Clearing > Members Only > Xetra/Floor > Xetra Information > Xetra Documentation > Xetra 9.1 > Funktional


Geschäftsführung
Frank Gerstenschläger
(Vorsitzender)
Rainer Riess
(stv. Vorsitzender)
Roger Müller
Jürgen Röthig

Das Xetra Release 9.1 Xetra J-Trader User Manual richtet sich an die Xetra-Händler und dient als detailliertes Nachschlagewerk bezüglich der Xetra J-Trader-Benutzeroberfläche und ihrer Funktionalitäten sowie der zur Verfügung stehenden Reports.

## 1) Versand der Xetra Release 9.1 Frontend Software-Kits

Am Freitag, dem **14. November 2008** erhalten Sie nach Handelsende die Kits mit der neuen Xetra Release 9.1-Produktionssoftware. Die Übertragung findet per FTP über das Xetra-Netzwerk auf Ihre Report-Knoten statt.

Xetra Release 9.1 ist nicht abwärtskompatibel. Daher ist die Installation des Xetra Release 9.1-Kit verpflichtend. Die bisher eingesetzten Applikationen müssen entsprechend angepasst werden. Mit Xetra Release 9.1 bleibt die GATE-Software unverändert, d.h. die Installation von GATE 3.5 ist Voraussetzung. Optional kann aber die GATE Update Version 2 verwendet werden.

Mit der Einführung von Xetra Release 9.1 sind keine neuen USIM-Dateien für die Windows- und SUN Solaris-MISSes erforderlich.

Die Zielverzeichnisse auf den Xetra Release 9.1 Produktions-MISSes lauten wie folgt:

**Für Xetra Frankfurt:**

**SUN Solaris 10:** **/opt/gate/transferdir/release51**
**Windows Server 2003:** **<ftp-root directory>\release51**

**Für Xetra Frankfurt 2:**

**SUN Solaris 10:** **/opt/gate/transferdir/release61**
**Windows Server 2003:** **<ftp-root directory>\release61**

Jeder Teilnehmer erhält beide Produktions-Kits, das für SUN Solaris 10 und das für Windows Server 2003/Windows XP.

Um einen reibungslosen Versand der Kits zu gewährleisten, beachten Sie bitte folgende Punkte:

- Stellen Sie sicher, dass auf jeder Produktions-MISS jeweils mindestens **120 MB** freie Speicherkapazität im Transferverzeichnis verfügbar sind.
- Damit die Datenübertragung stattfinden kann, bitten wir Sie sicherzustellen, dass die Xetra Produktions-MISSes von Freitagabend, **14. November 2008** bis Dienstagmorgen, **18. November 2008** ohne Unterbrechung über das Xetra-Netzwerk erreichbar sind.
- Bitte achten Sie ebenfalls darauf, dass die erforderlichen Lese- und Schreibberechtigungen für Dateien und Ordner richtig gesetzt sind.

Die Deutsche Börse AG wird den erfolgreichen Versand der Xetra Release 9.1 Frontend-Software-Kits überwachen und bei Übertragungsproblemen automatisch eine weitere Übertragung für den nächsten Tag veranlassen. Zusätzlich steht die Software ab dem 17. November 2008 zum Download auf der Website der Gruppe Deutsche Börse Börse www.deutsche-boerse.com unter folgendem Pfad zur Verfügung:

Trading & Clearing > Members Only > Xetra/Floor > Xetra Information > Xetra Software > Xetra 9.1

## 2) Installation der Xetra Release 9.1 Frontend-Software-Kits

Um einen reibungslosen Release-Start zu gewährleisten, bitten wir Sie, folgende Aktivitäten zu berücksichtigen und rechtzeitig durchzuführen:

- Die Installation der Xetra Release 9.1 Produktionssoftware ist für alle Teilnehmer verpflichtend.
- Der letzte Handelstag von Xetra Release 9.0 endet am Freitag, dem 21. November 2008 gegen 20.30 Uhr MEZ nach dem Posttrading. Die Installation der Xetra Release 9.1 Produktions-Kits darf erst nach dem Ende der Batch-Verarbeitung und dem Versand der Reports an diesem Handelstag erfolgen.

Details können dem Dokument „Xetra Release 9.1 Front End Installation Guide“ (veröffentlicht mit Xetra-Rundschreiben 174/08) entnommen werden. Bitte machen Sie sich mit allen Installationsprozeduren frühzeitig vertraut und planen Sie genügend Zeit für die Installationen ein. Weitere Informationen können auch der Datei “Installation Notes (readme file)“ entnommen werden, welche zusammen mit dem Kit ausgeliefert wird.

Teilnehmern die zusammen mit der Installation der Produktionssoftware ein Betriebssystem-Upgrade vornehmen möchten, empfehlen wir dringend, vor der Installation ein „Full Backup“ der installierten Release-Software (Xetra Release 9.0) inklusive des Betriebssystems durchzuführen, um im Notfall schnellstmöglich auf den alten Stand migrieren zu können.

## 3) Verteilung der @Xetra Release 9.1 Produktionssoftware über Java Web Start

Die Xetra Release 9.1 Produktionssoftware für Handelsteilnehmer, die @Xetra nutzen, ist ab **22. November 2008, 14:00 Uhr** über die Java Web Start-Technologie verfügbar.

An die @Xetra-Kunden werden alle Xetra Release 9.1 Frontend-Software-Komponenten über die von der Deutsche Börse Systems AG betreuten Web Start-Server verteilt.

@Xetra-Teilnehmer können über das Einloggen auf

http://atxetra.deutsche-boerse.com/xetra/prod/

die Installation automatisch starten. Ab dem 22. November 2008, 14.00 Uhr MEZ, können Konnektierungstests durchgeführt werden.

Bitte beachten Sie, dass das Herunterladen der @Xetra-Software bis zu 20 Minuten in Anspruch nehmen kann, je nach Bandbreite der Internetverbindung. Wir empfehlen daher dringend, die Software am Samstag, dem 22. November 2008 herunterzuladen. @Xetra-Kunden können sich am **24. November 2008** in das Xetra-Produktions-Backend einloggen.

Für @Xetra Release 9.1 ist es zwingend erforderlich, Java-Version **jre 1.6.0_05** zu installieren. Des Weiteren ist es unbedingt notwendig, nach Handelsschluss am Freitag, 21. November 2008 und vor dem Xetra Release 9.1-Konnektierungstest (Beginn: 22. November 2008, 14.00 Uhr MEZ)

- den Java-Cache und den Browser-Cache zu leeren und
- die Desktop Icons zu löschen.

Details zur Vorgehensweise können dem Dokument „@Xetra Release 9.1 Front End Installation & Operations Guide“ entnommen werden.

## 4) Zeitablauf der Einführung von Xetra Release 9.1

**Samstag, 22. November 2008 – Konnektierungstest**
Die Installation der Xetra Release 9.1 Produktions-Kits soll am Samstag, dem 22. November 2008 erfolgen. Die Xetra- und Eurex®-Backends (für MultiMarket-MISSes) stehen Ihnen am Samstagnachmittag zwischen 14.00 Uhr und 17.00 Uhr MEZ für den Konnektierungstest zur Verfügung. Um mögliche Risiken oder Ver-spätungen bei der Konnektierung zu Xetra am ersten Produktionstag zu vermeiden, empfehlen wir den Teilnehmern nachdrücklich, diesen Zeitraum zum Testen der Konnektierung wahrzunehmen.

Der Konnektierungstest kann als erfolgreich angesehen werden, wenn die Xetra-Nachricht **„Xetra Release 9.1“** im „Message Log“-Fenster erscheint. Bitte stellen Sie sicher, dass ein berechtigter Mitarbeiter Ihres Unternehmens verfügbar ist, der sich in das Xetra-Handelssystem einloggen kann.

Für Rückfragen hinsichtlich des Konnektierungstests steht Ihnen das Team vom Customer Technical Support Xetra am 22. November 2008 zwischen 14.00 Uhr und 17.00 Uhr MEZ zur Verfügung:

Telefon +49-(0) 69-2 11-1 84 00
Fax +49-(0) 69-2 11-1 84 01
E-Mail: xetra-help@deutsche-boerse.com

**Testen des automatischen Reconnect-Mechanismus**

Am Samstag, dem 22. November 2008, nach Abschluss des Konnektierungstests für Xetra Release 9.1, wird die Deutsche Börse die Unterbrechung der Verbindung der MISSes zu den Kommunikations-Servern (CS) simulieren, um den automatischen Reconnect-Mechanismus zu testen. Der Test wird zwischen 17.00 Uhr und 17.30 Uhr MEZ durchgeführt.

**Wir bitten alle Teilnehmer, die am Konnektierungstest für Xetra Release 9.1 teilnehmen, in jedem Fall ihre MISS-Architektur bis 17.30 Uhr MEZ an das Netzwerk angeschlossen zu lassen, andernfalls ist die Deutsche Börse nicht in der Lage, den Reconnect-Mechanismus zu testen.**

**Unter keinen Umständen darf die MISS-Architektur während des Reconnect-Tests manuell gestartet werden.**

**Wichtig:**
Ein automatischer Reconnect kann durch die Deutsche Börse nur dann erfolgreich durchgeführt werden, wenn die Netzwerkports 15107 (Xetra), 16107 (Xetra Frankfurt 2) und 16807 (Xetra-Wien) der Gruppe der Produktions-MISSes zugänglich sind. Deshalb ist es unbedingt erforderlich, dass diese Ports **nicht** durch Firewall- und/oder Router-Einstellungen gesperrt werden.

Zusatzinformationen
Der Netzwerkport 1@@07 ist ein Listening-Port auf der MISS. Dieser Port wird nach einer Unterbrechung der Verbindung der MISS zum Kommunikations-Server genutzt, wenn die MISS in den „reconnect-wait"-Status übergegangen ist. In solchen Fällen kann der Kommunikations-Server den Reconnect-Request über diesen Port an die MISS übertragen. **Wenn der Netzwerkport 1@@07 auf der MISS nicht für den Reconnect-Versuch des Kommunikations-Servers erreichbar ist, kann die MISS nicht wieder an Xetra angeschlossen werden. Dadurch kann sich die Ausfallzeit der MISS unnötig verlängern.** Wir möchten Sie deshalb daran erinnern, im Zusammenhang mit Firewall- und Router-Konfigurationen die Erreichbarkeit dieses Ports zu gewährleisten.

Wie im Teilnehmerdokument „Network Access to Exchange Applications" dargestellt, müssen für die Netzwerkverbindung zwischen teilnehmerseitiger MISS und dem börsenseitigen Kommunikations-Server (CS) verschiedene Netzwerkports auf den MISSes zugänglich sein.

Das Dokument „Network Access to Exchange Applications" ist auf der Website der Gruppe Deutsche Börse www.deutsche-boerse.com unter folgendem Pfad verfügbar:

Trading & Clearing > Members Only > Xetra/Floor > Xetra Information > Xetra Documentation > Xetra 9.1 > Technisch

Diese Ports sind:

| Port | Verwendung | Richtung |
|---|---|---|
| 1@@03 | Listen-Port auf CS | bi-direktional CS <==> MISS |
| 1@@05 | Listen-Port auf CS | bi-direktional CS <==> MISS |
| 1@@06 | Listen-Port auf CS | bi-direktional CS <==> MISS |
| 1@@07 | Listen-Port auf MISS | uni-direktional CS ==> MISS |

Das verwendete Netzwerkprotokoll ist TCP/IP. Der Platzhalter „@@" muss durch die Xetra-Umgebungsnummern ersetzt werden, das heißt „51“ für die Xetra-Produktion, „61“ für die Xetra Frankfurt 2-Produktion, „68“ für die Xetra Wien-Produktion.

**Montag, 24. November 2008 – Produktionsstart**

Am Montag, dem 24. November 2008 werden die Xetra-Backends Frankfurt und Frankfurt 2 um 02:30 Uhr MEZ gestartet. Der Handelstag mit Xetra Release 9.1 wird wie üblich um 7:30 Uhr MEZ eröffnet. Eine Änderung der Handels-parameter wird zum Produktions-Start von Xetra Release 9.1 lediglich für den folgenden Handelsparameter erfolgen:

- Minimum Midpoint Order Value:
  Dieser Wert wird für Aktien im fortlaufenden Handel (Xetra Frankfurt) für Instrumente in der Instrumentgruppe DAX1 (d.h. Aktien des DAX®-Index inklusive Vorzüge und ADRs) auf 25.000 € und für Nicht-DAX Instrumente auf 10.000 € gesetzt.

Orders, die bis zum 21. November 2008 (Handelsschluss) auf Xetra Frankfurt oder Xetra Frankfurt 2 eingegeben, aber nicht ausgeführt wurden, stehen am 24. November 2008 weiterhin zur Verfügung, sofern keine anders lautende Gültigkeitsbeschränkung gesetzt wurde.

Im Rahmen der Migration wurden die Händlerprofile von Xetra Release 9.0 kopiert. Bitte überprüfen Sie Ihre Händlerprofile und nehmen Sie gegebenenfalls Anpassungen vor.

Der Zugriff auf historische Geschäfte im „Back Office Information"-Fenster ist auf Grund der Release-Einführung nicht möglich. Die Bereitstellung historischer Xetra Release 9.0-Reports muss bei Customer Technical Support Xetra angefordert werden.

Eine Liste mit Punkten, die zum Start der Produktion für Xetra Release 9.1 von Interesse sind und Ihrer Aufmerksamkeit nicht entgehen sollten, wird ab dem 20. November 2008 zur Verfügung gestellt. Diese „Points of Interest" stehen im Internet auf der Website der Gruppe Deutsche Börse www.deutsche-boerse.com neben der bereits vorhandenen und regelmäßig aktualisierten FAQ-Liste zum Download zur Verfügung. Der Pfad lautet:

Trading & Clearing > Members Only > Xetra/Floor > Xetra Information > Xetra Documentation > Xetra 9.1 > Funktional

**5) Notfallplanung für den Produktionsstart von Xetra Release 9.1**

Für den Fall, dass ein ordnungsgemäßer Handel auf Xetra nach Einsatz von Xetra Release 9.1 am 24. November 2008 nicht möglich sein sollte, sind Vorbereitungen getroffen worden, um den Handel auf Xetra Release 9.0 zu ermöglichen. Sollte ein solcher „Fall-Back" am 24. November 2008 untertägig notwendig sein, werden wir die von Ihnen benannten Notfallansprechpartner über die weiteren Details informieren.

Die Notfallansprechpartner sollten zu diesem Zweck am Montag, dem 24. November 2008, zwischen 7.00 Uhr und 20.30 Uhr MEZ erreichbar sein. Für den Fall, dass es schon am Konnektierungswochenende zu einem „Fall-Back" kommen sollte, bitten wir Sie, sicherzustellen, dass Ihre Notfallansprechpartner am Samstag, dem 22. November 2008, von 14.00 Uhr bis 19.30 Uhr MEZ sowie gegebenenfalls am Sonntag, dem 23. November 2008, in der Zeit von 9.00 Uhr bis 14.30 Uhr MEZ erreichbar sind. Die maßgeblichen Auswirkungen eines „Fall-Back" auf die Teilnehmer sind wie folgt:

- Die Teilnehmer werden in der Lage sein, einen „Fall-Back" zu Xetra Release 9.0 ohne Installation von zusätzlicher Software durchzuführen. Diese notwendigen Aktivitäten werden detailliert in den Installationshinweisen, die zusammen mit dem Xetra Release 9.1 Produktions-Kit ausgeliefert werden, beschrieben. Zusätzlich finden Sie diese Beschreibung in dem Dokument „Xetra Release 9.1 Front End Installation Guide". Sofern das Xetra Release 9.1 Produktions-Kit noch nicht installiert wurde, sind diese Aktivitäten nicht notwendig.

- Die Einstellungen des letzten Handelstages (21. November 2008) der Xetra Release 9.0-Produktion werden wiederhergestellt. In Xetra Release 9.1-Produktion vorgenommene Veränderungen, die zum Beispiel Zugriffsrechte oder die Definition von Fenstereinstellungen betreffen, müssen nach der Wiederaufnahme von Xetra Release 9.0 erneut eingegeben werden.
- Bereits in Xetra Release 9.1 getätigte Geschäfte werden an XONTRO Trade übermittelt. Aufgrund des notwendigen „Fall-Back" werden diese Geschäfte nicht in den Xetra XML- und Text-Reports, sondern ausschließlich in XONTRO Trade-Schlussnoten dokumentiert. Gebühren werden für diese Geschäfte nicht erhoben.
- Orders und Stop-Orders, die nicht vor Beendigung der Xetra Release 9.1-Produktion ausgeführt wurden sowie nicht bestätigte außerbörsliche Geschäfte müssen neu eingegeben werden.
- Wichtige und für den Handel relevante Informationen werden in das Xetra-Newsboard eingestellt und können dort von Ihnen abgerufen werden.

## 6) Trading on Behalf

Im Falle eines technischen Problems, aufgrund dessen ein Handelsteilnehmer nicht mehr am Handel in Fondsanteilen auf Xetra Frankfurt 2 teilnehmen kann, bietet die Geschäftsführung der Frankfurter Wertpapierbörse die Möglichkeit eines „Trading on Behalf" (Handel im Auftrag des Börsenteilnehmers). Ein Händler kann Aufträge seines Hauses telefonisch an Market Supervision Xetra Frankfurt 2 (Telefon +49-(0) 69-2 11-1 93 33) weiterleiten, deren Mitarbeiter dann nach dem im Folgenden beschriebenen Verfahren für den betroffenen Handels- teilnehmer und in dessen Namen Systemeingaben vornehmen können, bis die hauseigenen Systeme wieder zur Verfügung stehen.

Hierbei ist zu beachten, dass folgende Aufträge nicht „on behalf" durchgeführt werden können:

- Eingabe oder Modifikation von Stop-Orders
- Eingabe oder Modifikation von Quotes
- Aufträge im Zusammenhang mit L-Konten (Xetra Account Type L)

### Ablauf des „Trading on Behalf"

Das „Trading on Behalf"-Verfahren wird durch den telefonischen Antrag des Handelsteilnehmers eingeleitet. Der Service des „Trading on Behalf" kann hierbei nur solange angeboten werden, wie eine hinreichende Mitarbeiterkapazität zur Ausführung der Aufträge bei der Market Supervision Xetra Frankfurt 2 verfügbar ist.

Der Antragsteller benennt einen Händler nebst zugehöriger aktiver Trader-ID, welche durch die Mitarbeiter der Market Supervision Xetra Frankfurt 2 auf Gültigkeit geprüft wird. Nachdem die Prüfung positiv abgeschlossen wurde, kann

der Antragsteller Aufträge (z.B. Enter Order, Order Deletion, Order/Quote Mass Deletion) erteilen.

Die Aufträge werden von den Mitarbeitern der Market Supervision Xetra Frankfurt 2 nach ihrer Erteilung unverzüglich eingegeben. Jede Eingabe/Löschung wird telefonisch bestätigt. Die Transaktionen werden dokumentiert; das Telefonat wird aufgezeichnet.

**7) Verfügbarkeit der Simulation**

Die Simulationsumgebung für Xetra Frankfurt und Frankfurt 2 steht nach dem Ende der Release-Simulation am 14. November 2008 weiter zur Verfügung. Es werden jedoch ab dem 15. November keine Fokustage mehr angeboten. Die CEF®-Umgebung wird ebenfalls verfügbar sein, jedoch nicht im Zeitraum vom 24. November bis 28. November 2008.

**8) Produkteinführung Fonds**

Die Einführung der Fondsinstrumente findet erst zum 1. Dezember 2008 statt. Details zur Umstellung finden Sie im Dokument „Migration Description Funds“, welches am 25. August 2008 veröffentlicht wurde und in der Member Section (Trading & Clearing > Members Only > Xetra/Floor > Xetra Information > Xetra Documentation > Xetra 9.1 > Funktional) zu finden ist.

Orders für die zu migrierenden Instrumente, die am Freitagabend, 28. November 2008 noch offen sind, werden von XONTRO im nächtlichen Batch gelöscht. Diese gelöschten Orders müssen gegebenenfalls am Montagmorgen, dem 1. Dezember 2008 neu für Xetra Frankfurt 2 eingegeben werden.

Eine spezielle Vorbereitung für den Fall-Back der Produkteinführung ist nicht notwendig. Wir werden Sie über evtl. notwendige Aktivitäten im Falle eines Fall-Back entsprechend informieren.

Für technische Rückfragen steht Ihnen der Customer Technical Support Xetra unter der Telefonnummer +49-(0) 69-2 11-1 84 00 zur Verfügung. Funktionale Fragen können an die Xetra Frankfurt Trading Helpline, Telefon +49-(0) 69-2 11-1 14 00, oder die Xetra Frankfurt 2 Trading Helpline, Telefon +49-(0) 69-2 11-1 93 33, adressiert werden. Für sonstige Fragen wenden Sie sich bitte an das Member Services & Admission Team unter der Telefonnummer +49-(0) 69-2 11-1 16 40.

Mit freundlichen Grüßen

i.A. Axel Birk

i.A. Holger Patt