

PMSinfo

Schnittstelle Reuters-DSS2PMS

Die Reuters-DSS2PMS-Schnittstelle dient der Datenintegration mittels Reuters Datascope Feed (XML)[®].

Innovative Funktionen von PMS wie Freifelder, Mehrfachkennungen, Liquiditätsrisiken oder zusätzliche Anwendungsbereiche wie Basel III, UCITS IV, Solvency II, AIFM usw. können zeitnah und automatisiert mit Daten versorgt werden.

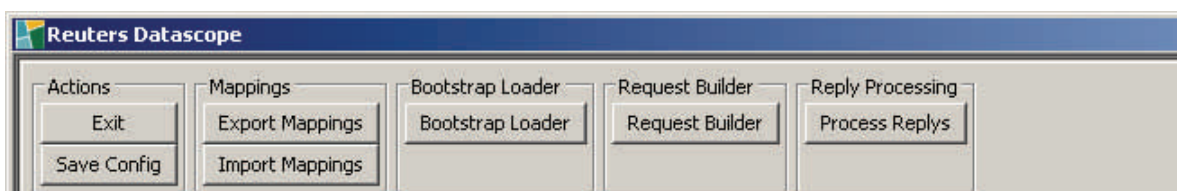
Informationen werden schnell und effektiv den jeweiligen Anwendungsprozessen zugeführt. Neartime-Aktualisierung und individuelle bestandsbezogene Abfragemöglichkeiten sind nur einige Vorteile von Datascope[®].

Die Referenzdaten von Finanzinstrumenten (Aktien, Fonds, Renten, Optionen, Futures, OTC Derivaten, Zertifikaten, Strukturen, Krediten, CDS, CDX, Commodities und Warrants) werden importiert und bewirken die vollständige Versorgung mit Marktdaten:

Aktien-, Inflations- und Verbraucherpreisindizes, Benchmarks, Bid-/Ask-Preise, Renditespannen von Bonds, Commodity Preise und Commodity Indizes, Credit Spreads und Indizes, Devisenkurse, Geldmarktsätze und –indizes (EONIA, ...), Handelsvolumen des Tages, Marktkurse und historische Kurszeitreihen, Ratings für Emittenten und Emissionen, Volatilitäten für Aktien, Indizes, Zinsen, Devisen, Zinsstrukturkurven.

Vorteile der DSS2PMS-Schnittstelle auf einen Blick →

- Schnelle und effektive Informationszufuhr
- Referenzdaten
- Versorgung mit Derivaten und Wertpapieren
- Neartime-Aktualisierungen
- Tagesendwerte (End-of-Day)
- Handelskurse (Intraday)
- Historische Kurszeitreihen
- Individuelle, bestandsbezogene Abfragemöglichkeiten
- Maschinengestützte Verarbeitung von Basiswerten und Cashflow-Strukturen
- Unterstützung neuer PMS Features wie Freifelder, Mehrfachkennungen usw.
- Voller Zugriff auf Datascope[®]



Bootstrap Loader

Der Bootstrap Loader identifiziert vorab den Instrumenten-Typ, wie beispielsweise eine Option auf einen Bond Future als ‚RdFOpt‘. ‚RdFOpt‘ ist die Abkürzung für ‚Reference data Future Option‘. Referenz- und Marktdaten sowie deren Basiswerte bilden eine fachliche Einheit.

| Identifier | Identifier Type |
|-------------|-----------------|
| AUB15100R2 | RIC |
| DJ63C2 | RIC |
| FEU39275O3 | RIC |
| RMY1165F2 | RIC |
| YR129500Y4F | RIC |

| Meta ID | Meta ID Type | MNType | Internal Id |
|--------------|--------------|-------------|-------------|
| ▼ AUB15100R2 | RIC | RdFOpt | 867 |
| AUB15100R2 | RIC | PriceS | |
| ▼ AUBM2 | RIC | RdFuture | 873 |
| AUBM2 | RIC | PriceS | |
| ▼ USDEUR=R | RIC | FXCrossRate | |
| USDEUR=R | RIC | PriceFX | |
| ▼ DJ63C2 | RIC | RdFOpt | 868 |
| ▼ 3DJH2 | RIC | RdFuture | 872 |
| ▼ .DJI | RIC | IdxEquity | 877 |
| .DJI | RIC | RateSI | |
| ▼ USDEUR=R | RIC | FXCrossRate | |
| USDEUR=R | RIC | PriceFX | |
| 3DJH2 | RIC | PriceS | |
| ▼ USDEUR=R | RIC | FXCrossRate | |
| USDEUR=R | RIC | PriceFX | |
| DJ63C2 | RIC | PriceS | |
| ▼ FEU39275O3 | RIC | RdFOpt | 869 |
| FEU39275O3 | RIC | PriceS | |
| ▼ FEU3H3 | RIC | RdFuture | 874 |
| ▼ EUREUR=R | RIC | FXCrossRate | |

| Asset_Category | BOP |
|-----------------------|------------|
| Asset_Status | ISS |
| Asset_SubType | FOP |
| Asset_Type | DERV |
| Callable_Flag | N |
| File_Code | 7501 |
| ISO_Currency | USD |
| Instrument_ID | AUB15100R2 |
| Instrument_ID_Type | RIC |
| META_CURRENCY | USD |
| META_MARKET | XCBT |
| META_PMS_SECID | AUB15100R2 |
| META_SECURITY_ID | AUB15100R2 |
| META_SECURITY_ID_TYPE | RIC |
| Market_MIC | XCBT |
| Putable_Flag | Y |
| RIC | AUB15100R2 |
| RIC_Root | AUB |

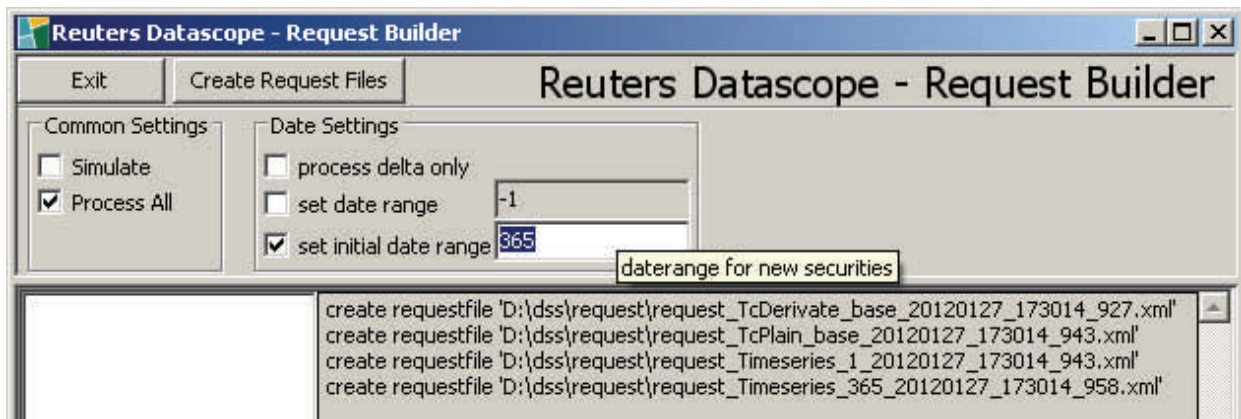
Bei den Marktdaten ist die Auswahl eines Preistyps beliebig konfigurierbar und davon abhängig, ob eine Börse den jeweiligen Preistyp bereitstellt. Je nach Kundenanforderung können die verschiedenen Preistypen wie Bid, Ask, Close, Settlement und Universal konfiguriert werden.

In einem Schritt mit der Typ-Erkennung werden vom Bootstrap Loader die Marktdaten zum Instrumenten-Typ bestimmt. Beispielsweise als ‚PriceS‘, wobei der Settlement Price einer Option bzw. eines Terminkontrakts gemeint ist. Für Bonds stehen Angebots- und Nachfrage-Preise als Bid/Ask bzw. für Aktien, unter anderem die Schlusskurse, als „Close“ zur Auswahl. Für Aktien können auch Bid und Ask ermittelt werden.

Zu jedem Instrumenten-Typ werden die dazugehörigen Basiswerte wie zur obigen Option ein Bond Future (RdFuture = Reference data Future) ermittelt. Usancekurse werden als Cross Rates (FXCrossRate, PriceFX) erkannt und automatisch beim ersten Auftreten aktiviert.

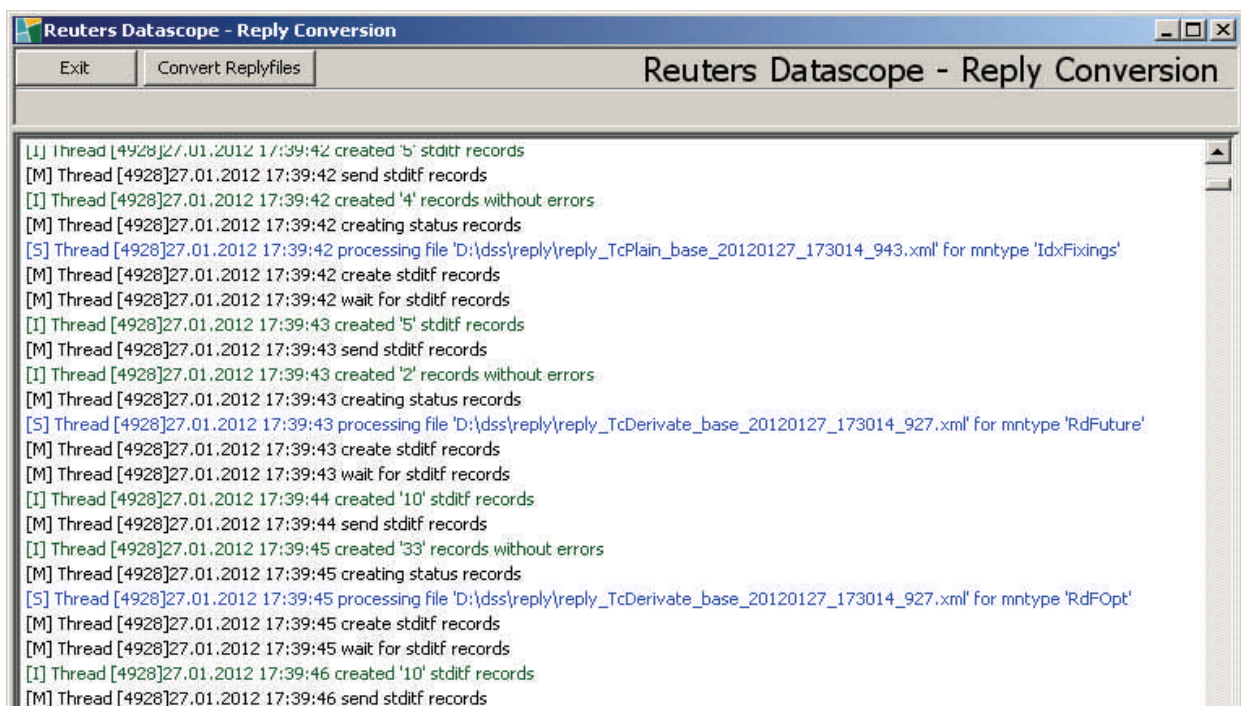
Request Builder

Der Request Builder erzeugt sämtliche Datenanfragen, die durch den Bootstrap Loader zuvor aktiviert wurden. Der Zeitraum von Kurszeitreihen kann über Parameter wie ‚date range‘ dynamisch gesteuert werden. Eine Deltaverarbeitung gestattet die Datenanfragen im Tagesbetrieb auf das Notwendige zu reduzieren; falls besonders umfangreiche Datenmengen bereits während der Nacht abgefragt wurden und diese im Tagesbetrieb nicht wiederholt werden sollen.



Interface Service

Anschließend sendet der Interface Service die Datenanfragen an den Filetransfer Server (FTP) von Reuters Datascope und wartet auf dessen Rückantworten in Form von Reply-Files. Diese Antwortdateien werden heruntergeladen und in die Standard-Schnittstellen-Formate von PMS umgewandelt. Die Standard-Schnittstelle von PMS führt eine Plausibilisierung und weitere Prüfungen der zu importierenden Daten durch. Bei Bedarf und im Fehlerfall können die Antwortdateien vom Interface Service wiederholt verarbeitet werden.

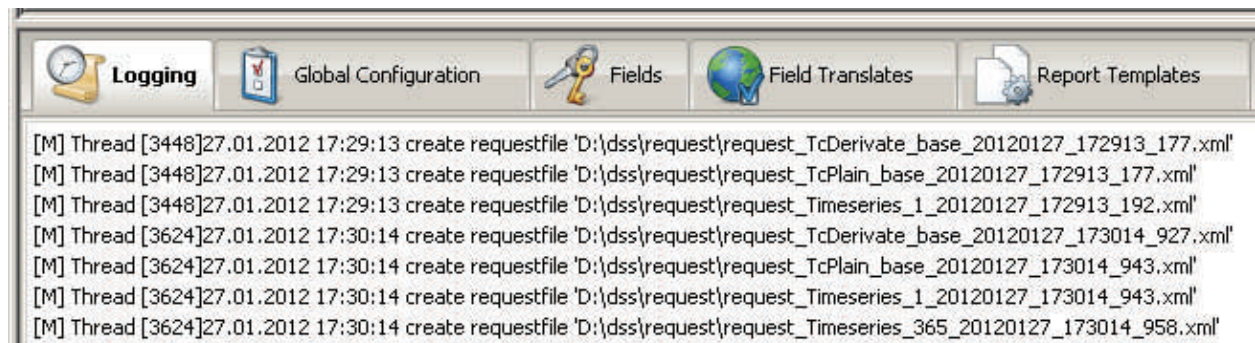


XML Mapping Engine

Die XML Mapping-Engine wendet vordefinierte Mapping- und Übersetzungsregeln auf serialisierte XML-Dokumente an. Die Mapping-Regeln legen fest, wie jedes Datenfeld einer relationalen Datenbanktabelle zugewiesen wird. Felder können mit einem Datentyp angegeben werden: STRING, FLOAT, INTEGER, DATE, PRICE oder STRIKE. Daten-, String- und arithmetische Operationen sind ausführbar. Logische Operatoren wie „UND“, „ODER“, „Gleich“, „Größer-als und/oder Kleiner-als“ lassen sich mit bedingten Operationen zu Filter- und Mapping-Regeln kombinieren. Die feldspezifischen Übersetzungsregeln ändern die Werte zum Beispiel für eine Interbankenrate und adaptieren diese an das Zielsystem. Alle diese Features bewirken eine effiziente Datenintegration.

Protokollierung und Automatisierung

Sämtliche Vorgänge und Aktivitäten werden protokolliert. Die Reihenfolgen beim Ladevorgang werden nach Prioritäten gesteuert, wodurch unter anderem die Referenzdaten (Wertpapiere) immer vor den Marktdaten geladen werden. Sämtliche Arbeitsvorgänge können sowohl manuell als auch automatisiert erfolgen. Tägliche Routineaufgaben werden automatisiert. Einmalaktionen sind manuell jederzeit ausführbar.



The screenshot shows a software interface with a menu bar at the top containing icons and labels for 'Logging', 'Global Configuration', 'Fields', 'Field Translates', and 'Report Templates'. Below the menu bar is a list of log entries, each starting with '[M] Thread [ID] [Date] [Time] create requestfile' followed by a file path.

```
[M] Thread [3448]27.01.2012 17:29:13 create requestfile 'D:\dss\request\request_TcDerivate_base_20120127_172913_177.xml'
[M] Thread [3448]27.01.2012 17:29:13 create requestfile 'D:\dss\request\request_TcPlain_base_20120127_172913_177.xml'
[M] Thread [3448]27.01.2012 17:29:13 create requestfile 'D:\dss\request\request_Timeseries_1_20120127_172913_192.xml'
[M] Thread [3624]27.01.2012 17:30:14 create requestfile 'D:\dss\request\request_TcDerivate_base_20120127_173014_927.xml'
[M] Thread [3624]27.01.2012 17:30:14 create requestfile 'D:\dss\request\request_TcPlain_base_20120127_173014_943.xml'
[M] Thread [3624]27.01.2012 17:30:14 create requestfile 'D:\dss\request\request_Timeseries_1_20120127_173014_943.xml'
[M] Thread [3624]27.01.2012 17:30:14 create requestfile 'D:\dss\request\request_Timeseries_365_20120127_173014_958.xml'
```

much-net AG

Kennedyallee 1-5
53175 Bonn
Telefon (02 28) 9 11 46-0
Telefax (02 28) 9 11 46-46
E-Mail office@much-net.de

Gerne beantworten wir Ihre Fragen:

Andreas Siebert - 34
Eduard Tolmatschjow - 58

SIE FINDEN UNS AUCH IM WEB:

WWW.MUCH-NET.DE

