



Xetra® Realtime Analytics

Xetra Datenfeeds jetzt mit exklusiven analytischen Orderbuchkennzahlen

Die Deutsche Börse erweitert ihre Xetra-Informationsprodukte mit exklusiven analytischen Kennzahlen. Diese basieren überwiegend auf unveröffentlichten Xetra-Orderbuchdaten. Die Informationen sind relevant für Market Maker, Algo Trader, Investoren, Smart Order Routing Applikationen, Analysten und Risikomanager. Sie dienen dazu, aktuelle Marktbedingungen und -trends zu erkennen.

Datenangebot

- Die analytischen Kennzahlen werden für die Aktien in den DAX®, MDAX®, TecDAX® und SDAX® Indizes (insgesamt 160 Instrumente) berechnet
- Zusätzlich werden Up/Down-Indikatoren für DAX, MDAX, TecDAX und SDAX Indizes verteilt
- Nur ausgewählte Order-Typen werden in die Berechnung aufgenommen, die Aktualisierung der Kennzahlen erfolgt in unterschiedlichen Zeitintervallen (in Echtzeit, pro Sekunde, alle fünf Sekunden und alle 60 Sekunden)
- Die Informationen werden aus den Xetra-Orderbuchdaten und Trade-Historien abgeleitet
- Die Kalkulation erfolgt nur während Continuous Trading-Phasen
- Die Order- und Handelsinformationen sind anonymisiert und aggregiert

Technische Informationen

- Die Daten werden über die Informationsprodukte Kassamarkt Deutschland und Xetra ultra zur Verfügung gestellt
- Kassamarkt Deutschland wird über CEF® Core und Vendoren verteilt
- Xetra ultra erhalten Sie über den Daten-Feed CEF ultra+ Xetra und Vendoren

Beispiele für analytische Kennzahlen

Aktuell werden mehr als 40 analytische Kennzahlen berechnet. Die nachfolgende Liste veranschaulicht die Bandbreite:

- Anzahl der eingegangenen Orders: Anzahl der Orders, die innerhalb der letzten 30 Sekunden auf Instrumentenebene eingegangen sind
- Anzahl der gelöschten Orders: Anzahl der Orders, die innerhalb der letzten 30 Sekunden auf Instrumentenebene gelöscht wurden
- VWAP der Agent Trades: Gleitender volumengewichteter Durchschnittskurs (VWAP) für ein 600-Sekunden-Intervall für alle Agent Trades auf einem Instrument
- Durchschnittliche Duration der Orders: Misst, wie lange die Orders der passiven Handelsseite über die letzten 300 Sekunden im Orderbuch verblieben sind
- Anzahl der durch Kauforders ausgelösten Trades: Misst die Anzahl der durch Kauforders ausgelösten Trades pro Instrument innerhalb der letzten 30 Sekunden
- Volatilität des eingegangenen Ordervolumens: Berechnet die Volatilität des eingegangenen Ordervolumens auf Instrumentenebene über die letzten 30 Tage

Eine vollständige Liste aller berechneten Xetra Realtime Analytics Kennzahlen mit Formeln und Beispielen wird auf Anfrage zur Verfügung gestellt.

Kontakt

Market Data + Services/Content
+49-(0) 69-2 11-1 34 40 (Frankfurt)
mds.frontoffice@deutsche-boerse.com
www.deutsche-boerse.com/mds