



INVESTRO-Newsletter

Nr. 20

Dieser XONTRO Newsletter beinhaltet Informationen zu folgenden Punkten:

- Wie auch in XONTRO wird nun auch in INVESTRO eine Löschung der Aufträge durchgeführt, die älter sind als 360 Tage sind.
- Denken Sie bitte außerdem daran, den INVESTRO Feiertagskalender rechtzeitig für die Besonderheiten zum Jahresende zu pflegen.

Disclaimer:

Bei dem hier versendeten Newsletter handelt es sich um ergänzende Informationen zur Produktdokumentation hinsichtlich eines von der Firma BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH, Börsenplatz 4, 60313 Frankfurt am Main betriebenen oder technisch erreichbaren Systems.

Die Newsletter werden daher nur an BrainTrade Systemnutzer bzw. deren Dienstleister per E-Mail übermittelt. Der Newsletterversand kann jederzeit per Mail an "trade(at)xontro.de" oder telefonisch unter +49-(0)69-589978-110 widerrufen werden.

1 Maximale Ordergültigkeit

Derzeitige Verfahren

Bei der Auftragserfassung in INVESTRO wird jedes mitgelieferte Datum von INVESTRO auf Monatsultimo geändert. Das Datum wird bei der weiteren Verarbeitung in INVESTRO nicht berücksichtigt. Die Aufträge werden nicht gelöscht.

Neues Verfahren

Bei der Auftragserfassung in INVESTRO wird jedes mitgelieferte Datum von Investro auf ein Gültigkeitsdatum von 360 Tagen geändert. Ist das Gültigkeitsdatum erreicht, erhält der Auftrag den Status "verfallen", wird in der Orderhistorie protokolliert und aus den Datenbanken gelöscht. Dabei werden keine Nachrichten über die Systemanschlüsse SAKI bzw. FIX versendet.

Der Eingabetag gilt als erster Tag der Fristberechnung. Auch für einen Auftrag, der nach dem Annahmeschluss eingestellt wird (heute), gilt der Tag der Einstellung (heute) und nicht der erste Tag der Gültigkeit (morgen).

Behandlung bestehender Aufträge

Für die in INVESTRO befindlichen „alten Aufträge“ werden zum Eingabedatum 359 Tage hinzugezählt. Ist das so ermittelte Datum älter als das aktuelle Tagesdatum, erfolgt die Löschung der betroffenen Aufträge.

Erstmalige Löschung von Aufträgen

Ab dem 25. November 2013 werden die Aufträge gelöscht, die älter als 360 Tage sind.

Durch dieses Verfahren werden Alt-Aufträge in der Anzeige der „offenen Order“ entfernt und eine bessere Übersicht sichergestellt.

1.1 Messagetype und Satzformat

1.1.1 SWIFT

MT 500 und 501			
O / M	Etikett	Feldbezeichnung	Format
M	30:	Order gültig bis (JJMMTT)	6n

1.1.2 FIX

Request New Order Single / Execution Report

TAG	Feldname	RF	R	XEOMI	Kommentar
432	ExpireDate	C	C		<p>LocalMktDate Ordergültigkeit bis, muss bei Tag 59 = "6" angegeben sein, bei anderen Ausprägungen von TimelnForce nicht zulässig</p> <p>Besonderheiten:</p> <p>XONTRO <u>Zeichnungsaufträge</u> Bei Zeichnungsaufträgen wird die Angabe im Feld ExpireDate nicht berücksichtigt.</p> <p>Das Gültigkeitsdatum wird vom System zu dem kleinsten von folgenden Werten gesetzt: - maximale Ordergültigkeit (360 Tage) - Datum des letzten Tilgungstermins</p> <p><u>Fondssegment Hannover</u> Bei Orders im Fondssegment Hannover wird die Angabe im Feld ExpireDate nicht berücksichtigt. Das Gültigkeitsdatum wird vom System zu dem kleinsten von folgenden Werten gesetzt: - maximale Ordergültigkeit (360 Tage) - Datum des letzten Tilgungstermins</p> <p>Diese Fälle werden in der Response-Nachricht (Execution Report) über eindeutige Ausprägungen des Tags 9933 (CombinedOrderType) gekennzeichnet.</p> <p>INVESTRO / Vestima Bei Fondorders wird die Angabe im Feld ExpireDate nicht berücksichtigt. Das Gültigkeitsdatum wird vom System auf die maximale Ordergültigkeit (360 Tage) gesetzt.</p>

2 INVESTRO-Feiertagskalender

Soll kein Auftrag für die beiden Erfüllungstage eingestellt werden, können die Depotbanken im Feiertagskalender einen Geschäftsfeiertag definieren. Dadurch werden für die Erfüllungstage eingehende Aufträge auf den nächsten Börsentag vorgetragen.

Soll an den Erfüllungstagen keine Abwicklung stattfinden, kann im Feiertagskalender ein Valutafeiertag gepflegt werden. Es besteht auch die Möglichkeit, einen Geschäfts- und Valutafeiertag zu pflegen. Die Feiertage können von allen Teilnehmern unter der Transaktion BRFT AF eingesehen werden.

Bitte informieren Sie uns welche Feiertage für 2013 gepflegt werden!

Tabelle:

KVNR	Name	24.12.	31.12
3043	Donner und Reuschel	G	G
3048	Berenberg Bank	B	B
4011	APO		
6105	State Street	G	G
7030	DZ Bank	B	B
7057	Hauck & Aufhäuser	V	V
7297	BNY Mellon	G*	G*
7670	BHF		G

Angaben ohne Gewähr

Legende:

G = Geschäftsfeiertag

Für diesen Tag werden von der KAG keine Kurse gerechnet. Aufträge werden für den nächsten Tag eingestellt.

V = Valutafeiertag

An diesem Tag wird nicht gesettelt. Dieser Tag zählt bei der Valutaermittlung nicht mit.

B = Beides

Dieser Tag ist sowohl ein Geschäftsfeiertag als auch ein Valutafeiertag

*Ausnahme BNY: bei Invesco Funds wird „B“ für beides hinterlegt