

XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 6

INHALTSVERZEICHNIS

1. Zusammenfassung	2
2. Börsenplatz Meldewesen	3
2.1. Regeln	3
2.2. Anzeige auf der Schlussnote	4
2.3. Schlussnotendatenträger MT 512	4
3. Kennzeichnung von Ausführungsbestätigungen als börslich oder außerbörslich	5
3.1. Regeln	5
3.2. Anzeige in BCIO AA	5
3.3. Systemanschluss für Kreditinstitute MT 519	5
4. Änderung einiger Eingabefelder und Anzeigen	6
5. Zusätzliche Änderungen in den Schlussnoten und im Schlussnoten-Datenträger für Xetra® Geschäfte	7
6. Test- und Simulationsmöglichkeiten	8
7. Änderungen im Schlussnotendruck für Xetra®	9
Hinweis: Einführung der ISIN	9
In eigener Sache	9

1. Zusammenfassung

In XONTRO werden folgende Änderungen wirksam:

zum 25. März 2002

- Einführung des „Börsenplatz Meldewesen“ (on line)
- Kennzeichnung der Ausführungsbestätigung als börslich oder außerbörslich (on line)
- Änderung einiger Eingabefelder und Anzeigen

zum 27. Mai 2002

- Neue Satzarten-Schlüssel für Xetra[®] Geschäfte in den Schlussnoten

zum 19. August 2002

- Weitere Satzarten-Schlüssel für Xetra[®] Geschäfte in den Schlussnoten
- Einfügen der „Best Executor ID“ in das Textfeld in den Schlussnoten

Zum 27. Mai 2002 werden außerdem die bereits im Newsletter Nr. 5 beschriebenen Änderungen im Systemanschluss für Kreditinstitute und im Schlussnoten-Datenträger eingesetzt.

2. Börsenplatz Meldewesen

Aufgrund von gesetzlichen Vorgaben benötigt das BaWe bei den Meldungen der Marktteilnehmer einen eindeutigen Hinweis, auf welchem Börsenplatz das Geschäft getätigt wurde. Wenn eine Börse zwei Plattformen betreibt - typischerweise eine Maklergestützte Plattform und eine rein elektronische -, muss zwischen diesen beiden Plattformen unterschieden werden. Hierfür wird die neue Zusatzangabe BM „Börsenplatz Meldewesen“ eingeführt.

2.1. Regeln

Bisher ist der Börsenplatz des Eingebers (= des Maklers) immer auch der Börsenplatz des Meldewesens. Im maklergestützten Handel gilt diese Regel unverändert weiter.

Wenn ein Makler aber ein Geschäft an einer elektronischen Plattform vermittelt und unter Verwendung von XONTRO-Trade erfasst, muss die elektronische Plattform separat erfasst und gemeldet werden.

Beispiel:

Ein Düsseldorfer Makler vermittelt ein Geschäft in Quotrix. Dieses Geschäft wird vom Makler in XONTRO Trade erfasst und mit der Zusatzinformation BMEDO versehen. BM steht für „Börsenplatz Meldewesen“ und EDO steht für „Quotrix“ (= elektronische Börse Düsseldorf).

2.2. Anzeige auf der Schlussnote

In der on-line-Anzeige der Schlussnoten BCAG¹ AL und in der gedruckten Schlussnote wird ab dem 25. März 2002 der „Börsenplatz Meldewesen“ wie folgt angezeigt:

```
TRAN: BCAG FC: AL SB: N#G#####  
  
XONTRO / ANZEIGE NACHWEISE (LANGFORM)                7009/99 FRANKFURTER  
ABRUF-NR.: G 4  
KAUF - SCHLUSSNOTE GNR : F 020219 0640002  
EB-NR : 020219 6920006  
534840 TV-LOONLAND O.N. V-ART: GS  
  
NOM.: ST 100  
KUNDENGESCHAEFT  
KURS : 16,0000 K-WERT: 1.600,00  
KO-KURS: 16,1000 DIF-MU: 10,00  
  
KONT.: 7010 LANDESBANK HESSEN-THUERINGEN  
EING.: 7854 FRITZ NOLS GLOBAL EQUITY  
  
ABR.-BETRAG: 1.600,00 EUR  
  
EINGABE: 19.02.02 18.08.28 COURT.: 1,28  
ABSCHLUSS: 19.02.02 17.00 AB BM: EDO  
-- ID-KZ: 7009192799 -- PW: ----- B999818M -- 20/02/02 -- 10:15:20 --  
  
BC0020I WEITERE DATEN VORHANDEN: PF8
```

2.3. Schlussnotendatenträger MT 512

Im Schlussnotendatenträger wird der „Börsenplatz Meldewesen“ ab dem 27. Mai 2002 angegeben (s. Newsletter Kreditinstitute Nr. 5).

¹ Hier und überall gilt das alles auch für die entsprechenden BR** Masken

3. Kennzeichnung von Ausführungsbestätigungen als börslich oder außerbörslich

3.1. Regeln

Das Kennzeichen wird nach den folgenden Regeln vom System vergeben:

- Ausführungen von Ordnern, die bei der Kursfeststellung dem Skontroführer vorgelegen haben, sind börslich. Dies gilt für Order, die direkt an den Skontroführer gerichtet wurden, und für Order, die vom Freimakler an den Skontroführer weitergeleitet wurden.
- Ausführungen von Ordnern, die an den Freimakler gerichtet und von diesem nicht an den Skontroführer weitergeleitet wurden, sind automatisch außerbörslich.

3.2. Anzeige in BCIO AA

Das Kennzeichen wird on line ab dem 25. März 2002 wie folgt dokumentiert:

```
TRAN: BCIO FC: AA SB: TVO#  
  
XONTRO / AUSFUEHRUNGSBESTAETIGUNG                7009/99 FRANKFURTER  
GATTUNG GA      STCK/NOM      LIMIT ZS  BI-(DWZ) ORDERNR.EMPF      SEITE:  1  
534840 K        201,000    BILLIGST   0202205900000    7641    15,30  BZ  
AU: 10:36                                     KZB: BS  
  
-- ID-KZ: 7009192799 -- PW:          ----- B999818K -- 20/02/02 -- 10:37:56 --  
  
BC0030I KEINE WEITEREN DATEN VORHANDEN
```

Bei börslichen Ausführungen lautet der Eintrag KZB: BS, bei außerbörslichen KZB: AB.

3.3. Systemanschluss für Kreditinstitute MT 519

Im Systemanschluss für Kreditinstitute - hier im MT 519 - wird die Kennzeichnung von Ausführungsbestätigungen als börslich oder außerbörslich ab dem 27. Mai 2002 angegeben (s. Newsletter Kreditinstitute Nr. 5).

4. Änderung einiger Eingabefelder und Anzeigen

In folgenden Masken wird das Eingabefeld für die Gattung auf 12 Stellen erweitert:

BCEB
BCEB EE / EG / EK / OB / OL
BCHI
BCHI OH
BCIO

In diesen Masken kann die 12-stellige ISIN oder die 6-stellige WKN oder das 3- bzw. 4-stellige Börsenkürzel eingegeben werden. Ausgegeben wird weiterhin bis zur endgültigen Einführung der ISIN die 6-stellige WKN.

In der on-line-Anzeige der Schlussnoten BCAG AL und in der gedruckten Schlussnote werden mehr Stellen für den Poolfaktor, den Devisenkurs und den Zinssatz vorgesehen. Außerdem wird für das Abschlussdatum ABSCHLUSS das Kennzeichen AA gesetzt, wenn es vom Schlusstag abweicht.

```
TRAN: BCAG FC: AL SB: J#G#####  
  
KONTRO / ANZEIGE NACHWEISE (LANGFORM) 7009/99 FRANKFURTER  
ABRUF-NR.: G 1  
KAUF - SCHLUSSNOTE GNR : F 020220 0640001  
  
534840 TV-LOONLAND O.N. V-ART: GS  
  
NOM.: ST 200  
KUNDENGESCHAEFT  
KURS : 14,5000 K-WERT: 2.900,00  
  
KONT.: 7010 LANDESBANK HESSEN-THUERINGEN  
EING.: 7854 FRITZ NOLS GLOBAL EQUITY  
  
ABR.-BETRAG: 2.900,00 EUR  
  
EINGABE: 20.02.02 10.20.35 COURT.: 2,32  
AA ABSCHLUSS: 17.02.02 10.00 AB BM: EDO  
-- ID-KZ: 7009192799 -- PW: ----- B999818M -- 20/02/02 -- 10:21:55 --  
  
BC0030I KEINE WEITEREN DATEN VORHANDEN
```

In der Kurzform der on-line-Anzeige der Schlussnoten BCAG AK wird der Poolfaktor entfernt.

In der on-line-Anzeige 'Storno Neugeschäft' BCEG SN werden mehr Stellen für den Poolfaktor, den Devisenkurs und den Zinssatz vorgesehen.

5. Zusätzliche Änderungen in den Schlussnoten und im Schlussnoten-Datenträger für Xetra® Geschäfte

Zusätzlich zu den im XONTRO Newsletter Kreditinstitute Nr. 5 vom 2. Januar 2002 zum 27. Mai 2002 angekündigten Änderungen im Layout des Schlussnoten-Datenträgers (MT512) werden auf Anforderung der Xetra Market Design Section der Deutsche Börse AG für das Xetra® Release 7.0 folgende Anpassungen in XONTRO vorgenommen:

1. Separate neue Satzarten-Schlüssel für Xetra® Geschäfte
2. Einfügen der „Executor ID“ in das Textfeld

zu:

1.: Für Geschäfte aus Xetra® werden im Etikett 23 („Geschäftsart“) folgende neue Satzarten-Schlüssel vergeben:

Satzart	Text-Bezeichner
112	Kauf - Xetra
122	Verkauf - Xetra
212	Kauf - Xetra OTC Trade
222	Verkauf - Xetra OTC Trade
312	Kauf - Xetra Best
322	Verkauf - Xetra Best

Die bisher (auch) für Xetra® Geschäfte verwendeten Satzarten-Schlüssel „012“ (Kauf – Direktgeschäft) und „022“ (Verkauf – Direktgeschäft) werden vom 27. Mai 2002 an nur noch für Bankdirektgeschäfte aus XONTRO benutzt.

Die neuen Satzarten 112, 122, 212 und 222 werden bereits zum **27. Mai 2002** produktiv verwendet. Die beiden restlichen neuen Satzarten 312 und 322 werden erst mit dem Produktionseinsatz des Xetra® Releases 7.0 (voraussichtlicher Einsatztermin: **19. August 2002**) verwendet.

Die neuen Text-Bezeichner werden in der online Anzeige der Schlussnoten (Transaktion BCAG) und in den gedruckten Schlussnoten verwendet.

2.: Mit dem Xetra® Release 7.0 (voraussichtlicher Einsatztermin: **19. August 2002**) wird die in Xetra eingegebene Executor ID als zusätzliche Information auf die Schlussnote aufgenommen. Dabei wird sie in das Textfeld (Etikett 72, 4. Zeile) des Schlussnoten-Datenträgers integriert, indem die Executor ID an das von Xetra übernommene Textfeld, durch ein Sonderzeichen getrennt, angehängt wird. Daraus ergibt sich für Schlussnoten, die für Xetra Geschäfte erstellt werden, das folgende Format für das Textfeld:

XETRA/Textfeldxxxx/ABCFR

Die Änderung für die Best Executor ID gilt für alle Schlussnotenbezugswege (online, Schlussnotendatenträger, gedruckte Schlussnote). Auf der Settlementschlussnote wird die Executor ID nicht angezeigt.

Die Executor ID wird bei einigen, aber nicht bei allen Xetra® Geschäften angezeigt. Sie kann jedoch nicht nur bei Xetra Best Trades, sondern auch bei Xetra Matched Trades auftauchen.

Die Anpassungen für die Aufnahme der Executor ID im Textfeld werden bereits zum 27. Mai 2002 erfolgen. Erzeugt und weitergegeben wird die Executor ID aber erst mit der Produktionsaufnahme vom Xetra® Release 7.0.

6. Test- und Simulationsmöglichkeiten

Um Ihnen die Gelegenheit zu geben, die hier und auch bereits im Newsletter Nr. 5 beschriebenen Änderungen im Systemanschluss für Kreditinstitute und im Schlussnoten-Datenträger zu testen, stellen wir die neuen Programme in den verschiedenen Systemen zu den folgenden Zeitpunkten zur Verfügung:

IMS 29 ab dem 01. März 2002
(nur Systemanschluss Kreditinstitute)

IMS 27 ab dem 15. April 2002
(Systemanschluss Kreditinstitute und Schlussnoten-Datenträger)

Vom 08. April 2002 bis zum 12. April 2002 steht das IMS 27 nur eingeschränkt zur Verfügung.

Produktion ab dem 27. Mai 2002

Eine ungeführte Simulation mit Kursfeststellung bieten wir an in der Woche

vom 29. April 2002 bis zum 3. Mai 2002.

7. Änderungen im Schlussnotendruck für Xetra^â

Wie schon bei den Schlussnotendatenträgern werden nun auch die Schlussnotendruckdateien nach Xetra- und Xontrogeschäften getrennt.

Die Xetra Druckschlussnoten stehen, wie die on-line-Anzeige auch, einen Tag nach dem Geschäftsabschluss zur Verfügung.

Wir bitten Sie uns mitzuteilen, ob Sie den Druck der Xetraschlussnoten weiterhin benötigen! Für Ihre Antwort haben wir diesem Schreiben einen Faxvordruck beigelegt.

Der Einsatztermin ist noch offen.

Hinweis: Einführung der ISIN

Die Einführung der ISIN ist für Mitte November 2002 vorgesehen. Dabei werden folgende Regeln gelten:

- Bei der Eingabe sind in allen Masken die 12-stellige ISIN oder die 6-stellige WKN oder das 3- bzw. 4-stellige Börsenkürzel erlaubt. Die 6-stellige WKN wird von numerisch auf alphanumerisch umgestellt.
- Bei der Anzeige wird in allen Masken und Drucklisten nur noch die ISIN ausgegeben, sortiert wird nach der ISIN.

Der Systemanschluss für Kreditinstitute und der Schlussnotendatenträger sind bereits ISIN-fähig. Soweit in diesen Systemen zusätzlich an wenigen Stellen noch die WKN mitgeführt wird, wird das Format ab dem 27. Mai 2002 auf alphanumerisch und das Feld auf optional umgestellt.

In eigener Sache

Wir haben im Januar an ausgewählte Ansprechpartner in jeder Bank einen Fragebogen zur Aktualisierung unserer Adressdaten versandt. Sofern die Empfänger noch keine Gelegenheit zur Bearbeitung hatten, möchten wir sie auch auf diesem Weg darum bitten.