



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 32

Ergänzend zum Präsenzhandelsrundsreiben 24/2007 der Deutschen Börse vom 28. November 2007 möchten wir in diesem Newsletter noch einige technische Einzelheiten beschreiben.

## **1 Jahresende 2007 - Überblick**

Montag, der 24. Dezember, und Montag, der 31. Dezember, sind keine Börsentage, sondern nur Erfüllungstage. Die wesentlichen Besonderheiten an Erfüllungstagen werden im Folgenden unter 2) beschrieben.

Donnerstag, der 27. Dezember, und Freitag, der 28. Dezember 2007, sind Börsentage. Am Donnerstag sind keinerlei Besonderheiten zu beachten, am Freitag – Tag der Jahresschlussbörse – werden Kurse nur bis 14:00 festgestellt, der Buchungsschnitt wird auf 18:30 Uhr vorgezogen.

Folgetagsorder und die übliche Orderlöschung zum Jahresende werden unter 3) beschrieben.

Im Übrigen wird auf die angehängte Tabelle verwiesen.

## **2 Erfüllungstage**

### **2.1 Systemnutzung**

An den Erfüllungstagen findet an den XONTRO-Börsen kein Börsenhandel statt - die Kursfeststellung durch die Skontroführer wird technisch unterbunden. Im Übrigen steht XONTRO aus technischer Sicht praktisch uneingeschränkt zur Verfügung, der Buchungsschnitt wird aber vorgezogen.

Die Banken können alle Dialogmasken und das Orderrouting über den Systemanschluss nutzen. Order können daher eingestellt, geändert und gelöscht werden, jedoch sind auf keinen Fall Ausführungen möglich. Tagesgültige Order können an Erfüllungstagen eingestellt werden, verfallen aber am gleichen Tag.

An Erfüllungstagen können aber Schlussnoten entstehen - aus Storno, händischen Geschäftseingaben der Makler, Bankdirektgeschäften und aus Aufgabenschließungen. Zwangsschließungen von CCP-Aufgaben werden aber an Erfüllungstagen technisch unterbunden.

Systemanschlussbanken erhalten an Erfüllungstagen vor 9:00 Uhr die Nachricht "Unterbrechung der Börsenversammlung " (MT551 mit Ereignisschlüssel BOINT); die Wie-deraufnahme erfolgt am nächsten Börsentag ohne eine besondere Nachricht.

### **2.2 Eingabezeiten**

An den beiden Erfüllungstagen wird das Eingabeende für Bankdirektgeschäfte auf 18:30 Uhr vorgezogen, danach beginnt der Buchungsschnitt.

### **2.3 Abwicklung und Fristen**

Erfüllungstage zählen bei allen Fristberechnungen als normale Arbeitstage und zählen auch mit bei der Berechnung des Aufgabenalters.

Geschäfte vom Börsentag vor einem Erfüllungstag müssen spätestens am Erfüllungstag storniert werden.

### **2.4 Leerfiles**

Schlussnotendatenträger werden an Erfüllungstagen auf jeden Fall versandt, auch wenn sie bis auf Vor- und Endesatz leer sind.

Nach dem Buchungsschnitt werden zu den gewohnten Zeiten auch die dann noch fälligen stündlichen und viertelstündlichen Datenträger ausgeliefert; diese sind selbstverständlich leer.

Das Kennzeichen "L - letzte Übertragung vom Börsentag" im Feld 77E des Vorsatzes wird in dem aus dem Buchungsschnitt heraus generierten Datenträger ("Abräumer") ausgeliefert. Danach können nur noch leere files ausgeliefert werden.

### **2.5 Sonstiges**

Die Übergabe von OTC-Geschäften (MT511) ist an Erfüllungstagen möglich, die Übergabe von MiFID-Meldungen (MT513) und deren Stornierung nicht.

Der Schlussnotendruck, der üblicherweise erst am nächsten Morgen erfolgt, findet für Geschäfte vom 31. Dezember (nicht für Geschäfte vom 24. Dezember) bereits am Abend des gleichen Tages statt.

## **3. Tagesgültige Order / Folgetagsorder / Orderlöschung am Jahresende**

An Erfüllungstagen können Order eingestellt werden, tagesgültige Order verfallen aber am gleichen Tag.

**Für die Gültigkeit von Folgetagsordern wird auf die angehängte Tabelle verwiesen.**

Die übliche Orderlöschung am Jahresende findet am Montag, dem 31. Dezember, statt.

Folgetagsorder, die ab dem 02. Januar 2008 gelten sollen, können nur am Montag, dem 31. Dezember, eingestellt werden.

	20.12.	21.12.	22.12.	23.12.	24.12.	25.12.	26.12.	27.12.	28.12.	29.12.	30.12.	31.12.	01.01.	02.01.	03.01.
	Do	Fr	Sa	So	Mo	Di	Mi	Do	Fr	Sa	So	Mo	Di	Mi	Do
	Bö-Tag	Bö-Tag			Erf-Tag			Bö-Tag	Bö-Tag			Erf-Tag		Bö-Tag	Bö-Tag
Kursfeststellung	ja	ja			nein			ja	ja****)			nein		ja	ja
Buchungsschnitt*)	20:30	20:30			18:30			20:30	18:30			18:30		20:30	20:30
ZS CCP-Aufgaben**)	ja	ja			nein			ja	ja			nein		ja	ja
Fristen															
1)	ST	Sto			GV										
2)		ST			Sto			GV							
3)					ST			Sto	GV						
4)								ST	Sto			GV			
5)									ST			Sto		GV	
6)												ST		Sto	GV
Folgetagsorder															
1)	● →														
2)		● →													
3)					● →										
4)								● →							
5)									● →						
6)												● →			

ST = Schlusstag  
Sto = Storno  
GV = "Geldvaluta", Settlement

\*) zugleich Eingabeende für Geschäftseingaben  
\*\*) Zwangsschließung von CCP-Aufgaben  
\*\*\*) bis 14:00 Uhr

Folgetagsorder  
● →  
Tag der Einstellung      Gültig ab  
z.B. 21.12.                      24.12.