



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 48

Dieser Newsletter informiert über

- einige technische Einzelheiten, die an den letzten Tagen des Jahres 2010 zu beachten sind.
- die Angabe der Valuta auf der Ausführungsbestätigung im Handel per Erscheinen
- die Erweiterung der Fixanbindung
- die geplante Verschiebung des Buchungsschnittes um 10 Minuten

1 Jahresende 2010

1.1 Überblick

Freitag, der 24. Dezember 2010, und Freitag, der 31. Dezember 2010, sind keine Börsentage, sondern nur Erfüllungstage. Die wesentlichen Besonderheiten an Erfüllungstagen werden im Folgenden unter 1.2 beschrieben.

Montag, der 27. Dezember, Dienstag, der 28. Dezember, Mittwoch, der 29. Dezember und Donnerstag, der 30. Dezember 2010, sind Börsentage. Am Montag, Dienstag und Mittwoch sind keinerlei Besonderheiten zu beachten; am Donnerstag – Tag der Jahresabschlussbörse – werden Kurse nur bis 14:00 Uhr festgestellt, der Buchungsschnitt wird auf 18:30 Uhr vorgezogen.

Folgetagsorder und die übliche Orderlöschung zum Jahresende werden unter 1.3 beschrieben.

Im Übrigen wird auf die angehängte Tabelle verwiesen.

1.2 Erfüllungstage

1.2.1 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 8:30 Uhr die Nachricht "Unterbrechung der Börsenversammlung " (MT551 mit Ereignisschlüssel BOINT); die Wiederaufnahme erfolgt am nächsten Börsentag ohne eine besondere Nachricht.

1.2.2 Eingabezeiten

An den beiden Erfüllungstagen wird das Eingabeende für Bankdirektgeschäfte auf 18:30 Uhr vorgezogen, dann beginnt der Buchungsschnitt. Danach sind auch keine Ordereingaben mehr möglich.

1.2.3 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.

1.2.4 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.

1.2.5 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.

1.3 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 Freitag, dem 31. Dezember 2010, statt.

Folgetagsorder, die ab dem 03. Januar 2011 gelten sollen, können nur am Freitag, dem 31. Dezember 2010, eingestellt werden.

1.4 Eingeschränkte Testmöglichkeiten “über die Feiertage”

Von Montag, dem 20. Dezember 2010, bis Freitag, dem 31. Dezember 2010, unterstützen wir keine Tests in XONTRO (weder im IMS27 noch im IMS29).

2. Valuta auf der Ausführungsbestätigung im Handel per Erscheinen

Mit Wirkung zum 31.01.2011 wird die Emissionsvaluta auch in der Ausführungsbestätigung MT519 mitgegeben werden. Hierzu wird bei Zeichnungen und im ordergetriebenen Handel per Erscheinen das - bisher in XONTRO nicht genutzte - Feld "Versionsnummer" im Etikett 3B, 3. Zeile genutzt. Dabei wird das Datum 8-stellig in die ersten Stellen eingefügt und der Rest des Feldes mit Nullen aufgefüllt.

Beispiel:

:35B:ISIN DE0005492862
ARTSTOR AG
201010220000000000

Mit dieser Maßnahme werden in erster Linie die immer häufigeren Zeichnungen in XONTRO unterstützt; die Änderungen gelten aber unabhängig von einer Zeichnung immer im Handel per Erscheinen.

Der Emissionstermin = Emissionsvaluta wird aus dem WM-Feld GD660 übernommen.

Testeingaben im IMS27 sind ab dem 13.12.2010 möglich.

Mustergattungen:

ISIN	Börsenplatz	Beginn Zeichnung	Ende Zeichnung	Verwahrmöglichkeit	Emissionstag
DE000TB9N8H6	EDS	25. Nov 2010	16. Dez 2010	GS	23. Dez 2010
AT0000A0LWM6	EDS	29. Nov 2010	17. Dez 2010	AKV	21. Dez 2010
DE000MQ29999	EDS	29. Nov 2010	17. Dez 2010	GS	22. Dez 2010
DE000MQ29999	EDF	29. Nov 2010	17. Dez 2010	GS	22. Dez 2010
DE000HV5CMX7	EDS	29. Nov 2010	21. Dez 2010	GS	23. Dez 2010
DE000HV5CMX7	EDF	29. Nov 2010	21. Dez 2010	GS	23. Dez 2010
DE000LB0DNH5	EDS	29. Nov 2010	04. Jan 2011	AKV	07. Jan 2011
DE000LB0DNG7	EDS	29. Nov 2010	04. Jan 2011	GS	07. Jan 2011
DE000LB0DNF9	EDS	29. Nov 2010	04. Jan 2011	GS	07. Jan 2011
DE000RYB0AR2	EDF	29. Nov 2010	11. Jan 2011	AKV	14. Jan 2011
DE000RYB0AQ4	EDF	29. Nov 2010	11. Jan 2011	GS	14. Jan 2011
DE000RYB0AU6	EDF	29. Nov 2010	11. Jan 2011	GS	14. Jan 2011
DE000RYB0AT8	EDF	29. Nov 2010	11. Jan 2011	GS	14. Jan 2011
DE000RYB0AS0	EDF	29. Nov 2010	11. Jan 2011	AKV	14. Jan 2011
DE000HV5CME7	EDS	29. Nov 2010	25. Jan 2011	AKV	28. Jan 2011
DE000HV5CME7	EDF	29. Nov 2010	25. Jan 2011	AKV	28. Jan 2011
DE000HV5CMW9	EDS	29. Nov 2010	26. Jan 2011	GS	28. Jan 2011
DE000HV5CMW9	EDF	29. Nov 2010	26. Jan 2011	GS	28. Jan 2011

Allgemeine Regeln

Für die Mitgabe der Emissionsvaluta in der Ausführungsbetätigung gelten die gleichen Regeln wie für das maschinelle Setzen von FZ bzw. FE + Emissionsvaluta in der Schlussnote (s. auch Newsletter Nr. 47 vom 07. November 2010).

3. Erweiterung Fixanbindung

Nachdem die erste Fix-Stufe vollumfänglich eingesetzt wurde, werden mit der zweiten Stufe die Funktionalitäten von OTC-Geschäften, Schlussnoten und MiFID realisiert sein. XONTRO wird dann per Fix im gleichen Umfang wie derzeit per SAKI erreichbar sein. Das gleiche gilt auch für die Erreichbarkeit von INVESTRO per Fix. Der Einsatz der zweiten Stufe ist für das erste Halbjahr 2011 geplant.

4. Verschiebung des Buchungsschnitts

Es ist geplant, zum 17.01.2011 den Buchungsschnitt (Geschäftseingabeende für Makler und Banken) von heute 20:30 Uhr auf neu 20:40 Uhr zu verschieben.

Datum	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.	04.01.	05.01.
Wochentag	Mi	Do	Fr	Sa	So	Mo	Di	Mi	Do	Fr	Sa	So	Mo	Di	Mi
Börsentag / Erfüllungstag	Bö- Tag	Bö- Tag	Erf- Tag			Bö- Tag	Bö- Tag	Bö- Tag	Bö- Tag	Erf- Tag			Bö- Tag	Bö- Tag	Bö- Tag
Kursfeststellung	ja	ja	nein			ja	ja	ja	ja***)	nein			ja	ja	ja
Buchungsschnitt*)	20:30	20:30	18:30			20:30	20:30	20:30	18:30	18:30			20:30	20:30	20:30
ZS CCP-Aufgaben**)	ja	ja	nein			ja	ja	ja	ja	nein			ja	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					
7)									ST	Sto			GV		
Folgetagsorder													ST	Sto	GV
1)		● →													
2)			● →												
3)						● →									
4)							● →								
5)								● →							
6)									● →						
7)										● →					

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. 24.12. 27.12.