

XONTRO Newsletter

Skontro führende Makler

Nr. 3

INHALTSVERZEICHNIS

1	Zusammenfassung	1
2	Kennzeichen börslich / außerbörslich	2
2.1	Regeln	2
2.1.1	Allgemeine Grundsätze	2
2.2	Manuelle Eingaben	3
2.2.1	Allgemeine Regeln	3
2.2.2	Eingabe von Geschäften	4
2.2.3	Handhabung in HuM	4
2.2.4	Behandlung der Aufgaben	5
2.2.5	Storno Neu	7
2.3	Dokumentation	8
2.4	Systemanschluss Makler	8
3	Geschäfte vom Wochenende / Börsenfeiertag	9
3.1	Regeln	9
3.2	Eingabe des Kennzeichens durch Makler	10
3.3	Dokumentation	11
3.4.	Systemanschluss Makler	12
4	Kennzeichen Eigengeschäft	12

1 Zusammenfassung

In XONTRO werden zum 29. Oktober 2001 folgende Änderungen wirksam:

- Kennzeichnung von Geschäften als börslich oder außerbörslich
- Eingabe und Dokumentation von Geschäften am Wochenende
- Kennzeichnung von Eigengeschäften der Makler auf der Schlussnote

2 Kennzeichen börslich / außerbörslich

Aufgrund von gesetzlichen Vorgaben benötigt das BaWe bei den Meldungen der Marktteilnehmer einen eindeutigen Hinweis, ob es sich um ein börsliches oder außerbörsliches Geschäft handelt. Um die meldepflichtigen Teilnehmer bei der Erstellung der Meldungen zu unterstützen, liefert XONTRO das Kennzeichen im Maklertagebuch (und für die Banken auf der Schlussnote).

2.1 Regeln

2.1.1 Allgemeine Grundsätze

Das Kennzeichen wird nach den folgenden Regeln vom System bzw. durch manuelle Eingabe vergeben:

Automatisch (orderbasierte Eingaben)

- Alle Geschäfte, die eindeutig aus der Kursfeststellung des Skontroführers resultieren, sind automatisch börslich.
 - Geschäfte aus Ordnern an den Skontroführer (von der Bank oder vom Freimakler weitergeleitet)
 - Geschäfte aus dem Handskonto (Nachbearbeitung des Skontroführers)
- Alle Geschäfte, die eindeutig nicht aus der Kursfeststellung des Skontroführers resultieren, sind automatisch außerbörslich.
 - Geschäfte aus nicht weitergeleiteten Bankordern an den Freimakler

Manuell (Geschäftseingabe)

- Alle anderen Geschäfte erhalten eine Möglichkeit zur Kennzeichnung.
 - Geschäfte aus händischen Eingaben des Maklers in Xontro Trade

2.2 Manuelle Eingaben

2.2.1 Allgemeine Regeln

Eine manuelle Eingabe ist in den folgenden Masken möglich:

- BCEM¹ GE, PE, HM, SN
- BCBA AG, AK

Das Kennzeichen liegt in den folgenden Ausprägungen vor:

BS oder b = Börslich

AB oder a = Außerbörslich

Zuordnung zu den Transaktionen

BCEM GE, PE	BS
BCEM SN	BS, AB
BCEM HM	b, a
BCBA AG, AK	b

In den Masken **BCEM GE, PE und BCBA AG, AK** gilt außerbörslich als Defaultwert; das Kennzeichen börslich muss immer manuell eingegeben werden.

- In diesen drei Masken wird die Eingabe von AB oder a daher abgelehnt.
- Die Eingabe des Kennzeichens ist bei **BCEM GE und PE** nur in der Kopf-Zeile möglich.
- Die Eingabe des Kennzeichens ist bei **BCBA AG** in der Eingabezeile möglich.
- Wenn ein Makler auf den beiden Seiten eines Geschäftes ein unterschiedliches Kennzeichen benötigt, muss er eine Seite an Aufgabe nehmen und kann der Schließung in BCEM HM oder BCBA AG dann das andere Kennzeichen mitgeben.

Bei **BCEM SN** wird das Kennzeichen in der Zeile Käufer/ Verkäufer angezeigt und kann überschrieben werden.

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

2.2.2 Eingabe von Geschäften

Nachfolgend ein Beispiel für die Eingabe eines maklervermittelten Geschäftes als ‚börslich‘ in der Maske ‚Eingabe von Geschäften‘. Die Eingabe für PÜEV-Geschäfte in BCEM PE ist identisch.

```

TRAN: BCEM FC: GE SB:

XONTRO TRADE / EINGABE VON GESCHAEFTEN                78xx/00 MAKLER

GATTUNG  KURS          ZUSATZANGABEN                      SEITE 1
ifx...   40.....   bs.....

GA NOMINALE      KONT  AU  ZUSATZANGABEN
k  101.....    7009 1200 v7010.....

. ....
. ....
. ....
    
```

Die Vorbelegung ist ‚außerbörslich‘ und erfordert keine Eingabe.

2.2.3 Handhabung in HuM

In der Maske **BCEM HM** (Handel unter Maklern) wird das Kennzeichen aus der Eingabe des ersten Maklers bei dem benannten Makler angezeigt. Dieser kann bei einer Weiterleitung oder Schließung das Kennzeichen übernehmen oder überschreiben.

Bei Eingaben in BCEM HM durch den zweiten (benannten) Makler gilt also dasjenige Kennzeichen, das der erste (benennende) Makler mitgegeben hat. Wenn für die Eingabe durch den benannten Makler das andere Kennzeichen gelten soll, überschreibt er dieses. Es gilt die gleiche Logik wie bei der Abschluss-Uhrzeit.

```

TRAN: BCEM FC: HM SB: N#A##

XONTRO TRADE / OFFENE HUM-GESCHAEFTE                78xx/00 MAKLER

GATTUNG      NOMINALE  AU  K KAUF      KURS VERK      KURS  NOMINALE  ZA H
.  123456      101      1111  b  78xx      50,00  ....      .....  12345678  ..

-- ID-KZ: 78xx000000 -- PW:          ----- B999818M -- 25/05/01 -- 19:59:30 --

BC1820F ZUR ZEIT KEINE WEITEREN DATEN VORHANDEN
    
```

Überschreibbar durch ‚a‘ und umgekehrt

Darüber hinaus wird die Maske BCEM HM verändert. Das 10 stellige Eingabefeld ‚Nominale‘ wird um 2 Stellen gekürzt. Glatte Nominale mit mehr als 8 Stellen müssen mit Kürzeln (T=1000 etc) eingegeben werden. Krumme Nominale können dazu führen, dass das Geschäft in 2 Teilen ausgeführt werden muss. Die beiden eingesparten Stellen werden für das neue 1 stellige Feld ‚K‘ (mit den zwei Ausprägungen b = börslich und a = außerbörslich) benötigt, das mit einem Zeichen Abstand zu dem Feld ‚Kauf‘ eingefügt wird.

Wenn Maklerketten über unabhängige Eingaben in BCEM GE gebildet werden, nimmt XONTRO keine Prüfung vor, ob die ineinandergreifenden Äste das gleiche Kennzeichen haben; das Kennzeichen börslich ist kein Verkettungskriterium. Auch hier gilt die gleiche Logik wie bei der Abschluss-Uhrzeit.

2.2.4 Behandlung der Aufgaben

Entstehung von Aufgaben

Beim Eintragen der eigenen Makler-Nummer ist die Eingabe eines Kennzeichens nur in der Kopfzeile möglich (siehe BCEM GE). Die Eingabe eines von der Kontrahenten-Seite abweichenden Kennzeichens ist nicht möglich. Eine vorläufige Aufgabe wird im Buchungsschnitt zur endgültigen Aufgabe. Für die Kennzeichnung der Aufgabe wird das Kennzeichen der Seite mit der Bank übernommen.

Schließungen von Aufgaben

Bei der Schließung von Aufgaben bekommt die Seite der alten Aufgabe auch deren Kennzeichen, d. h. das Kennzeichen der Aufgabe wird für diese Seite übernommen. Dies bedeutet, dass die Aufgabennote das gleiche Kennzeichen hat wie die Schließungsnote.

Für die neue Seite kann bei Schließungen in BCBA AG und BCEM HM ein neues Kennzeichen gesetzt werden: Nichtstun bedeutet – nach den bereits definierten Regeln - in BCEM HM die Übernahme des vorhandenen Kennzeichens, in BCBA per Default die Kennzeichnung als außerbörslich.

TRAN: BCBA FC: AG SB: IFX															
623100	IFX	INFINEON TECH.AG NA O.N.					GS								
AUFGABENSCHLISSUNG GEGEN HALBE GESCHAEFTE							78xx/00 MAKLER								
36,5 (V)															
K A U F		5.064	52,988		-5.064		0	V E R K							
AO ZN	NOMINALE KONT		KURS	P	AO ZN	NOMINALE KONT		KURS							
		936 7084	56,00	***	01										
		11 7008	55,00	***	02										
		50 7001	39,00	***	10										
KUM. KURSDIFFERENZ			0,00												
POS	NOMINALE	KONT	AU	KURS HG	ABR.KURS	COURTAGE	EG	K							
01k	136.....	5...	1200	b							
-- ID-KZ: 78xx192700 -- PW: ----- B999818M -- 21/06/01 -- 14:29:03 --															
F1	AUFG-AO	F2	BER	F3	END	F4	ABBR	F5	GGN.EIN	F9	IW-ZUO	F10	N.WKN	F12	NB

Im Feld ‚K‘ kann nur das Kennzeichen ‚b‘= börslich eingegeben werden.

Entstehung von Zwangsaufgaben

Bei einer Zwangsaufgabe nach dem Düsseldorfer Modell bekommt der Benannte das Kennzeichen des Benennenden. Beim Frankfurter Modell bekommt die Aufgabe das Kennzeichen von dem Kettenglied mit der Bank.

Zwangsschließungen von Aufgaben

Bei der Zwangsschließung in Düsseldorf wird das Kennzeichen der Aufgabe übernommen.

Das Feld ‚Courtage‘ wurde von 15 auf 13 Stellen gekürzt. Das Kürzen des Feldes ist erforderlich, da nach dem Kennzeichen börslich ggf. der Devisenkurs angezeigt wird.

Bitte beachten!!!

Aufgabenbestände, die vor dem Releaseinsatz vorhanden waren, werden ab dem 29. Oktober als außerbörsliche Aufgaben interpretiert.

2.2.5 Storno Neu

In der Maske Storno Neugeschäft werden die Kennzeichen aus dem zugrunde liegenden Geschäft für jede Seite (Kauf/Verkauf) angezeigt und können überschrieben werden.

```
TRAN: BCEM FC: SN SB: 280001##120901#F
XONTRO TRADE / EINGABE STORNO MIT NEUGESCHAEFT          78xx/00 MAKLER

GNR: F 010912 0280001
WKN: 623100 INFINEON AG NA O.N.
ABSCHLUSS-DATUM: 12.09.01  ABSCHLUSS-ZEIT: 12.00.00

KAEUFER:      7009      KONTR-KURS      COURTAGE      BS
VERKAEUFER:   7010      40              .....         BS
              40              .....

KURS:         40      VALUTA: .....      ZINSTAGE: ....
NOM:          101      TEXT: .....

-- ID-KZ: 78xx199900 -- PW:          ----- B999818M -- 12/09/01 -- 16:19:21 --
BC0260I BITTE KORREKTUR-EINGABE DURCHFUEHREN
```

BS kann mit AB überschrieben werden und umgekehrt

2.3 Dokumentation

Im gedruckten Maklertagebuch sowie im on-line-Tagebuch wird aus Platzgründen nur das Kennzeichen außerbörslich seitenbezogen angezeigt.

```

TRAN: BCEM FC: MT SB: N#####080801#F
XONTRO TRADE / INFO-MAKLER-TAGESGESCHAEFTSLISTE          78xx/00 MAKLER
623100 IFX INFINEON AG NA O.N.
  GESCHAFTSNUMMER   NOMINALE   AN           KURS   VON           KURS
  F 0609 0280001           1 7009           35,000 7010           35,000
  AU1000 AB ←
  F 0609 0280002           5 7009 TSL       40,000 7010           40,000
  AU1200 ABV ←
  F 0609 0280003           5 7009 TSL       40,000 7010           40,000
  AUK1200 AUV1201

KURS-DIFF.:           0,00  COURTAGE:           3,75  NOMINALE:           11
-- ID-KZ: 78xxxxxxxx -- PW:           ----- B999818M -- 06/09/01 -- 16:50:18 --
BC0030I KEINE WEITEREN DATEN VORHANDEN

```

Die folgenden Ausprägung des Kennzeichens sind im online Maklertagebuch möglich:

AB = beide Seiten(Kauf/Verkauf) sind außerbörslich
 ABK = der Kauf ist außerbörslich
 ABV = der Verkauf ist außerbörslich
 leer = beide Seiten sind börslich

Auch für das gedruckte Maklertagebuch gilt, dass nur das Kennzeichen außerbörslich angezeigt wird.

2.4 Systemanschluss Makler

Die Änderungen zum Systemanschluss Makler finden Sie in der Beschreibung der XONTRO Values API Release Notes. (Stand: 14.08.2001) Diese entnehmen sie bitte unserer Homepage www.xontro.de und dem Verzeichnis: Produkte/XONTRO/Dokumentation/Finanzdienstleister/Xontro-Systemanschluss.

3 Geschäfte vom Wochenende / Börsenfeiertag

Für die am 29. Oktober zum Einsatz kommende Version von XONTRO Trade ist es möglich, Geschäfte, die von Teilnehmern außerhalb der Börsentage getätigt werden, durch Eingabe eines „abweichenden Abschlussdatums“ zu erfassen. Damit können die Geschäfte korrekt für die Meldungen nach § 9 WPHG aufbereitet werden.

3.1 Regeln

Heute ist das Abschlussdatum immer mit dem (ggf. abweichenden) Schlusstag identisch. Abweichendes Abschlussdatum heißt daher, dass das Abschlussdatum vom (ggf. abweichenden) Schlusstag abweicht. Das (ggf. abweichende) Abschlussdatum ist und bleibt ein reines Informationsfeld, auf dem in XONTRO keine weitere Verarbeitung aufsetzt:

- Basis für die Ermittlung der Zinsberechnung ist der Schlusstag im System (inkl. AS).
- Basis für die Ermittlung der Stornofrist und (durch Clearstream) der Standard-Valuta ist der Eingabetag.

Mit der Eingabe eines abweichenden Abschlussdatums können nur ‚Nicht- Börsentage‘ erfasst werden. Die Eingabe dieses Datums ist an jedem Börsentag möglich.

Beispiel: Am Montag oder Dienstag werden Geschäfte vom Sonntag erfasst.

Abschluss im externen Handels-System	Sonntag	Sonntag
Eingabe in XONTRO Trade		
Eingabetag	Montag	Dienstag
Schlussstag	Montag	AS Montag Weil abweichend vom Eingabetag
Abschlussdatum (AA = abweichendes Abschlussdatum)	AA Sonntag Weil abweichend vom Schlussstag	AA Sonntag Weil abweichend vom (abw.) Schlussstag

3.2 Eingabe des Kennzeichens durch Makler

Bei der Eingabe von Makler-Vermittelten-Geschäften kann das abweichende Abschlussdatum in der Kopfzeile eingegeben werden:

Transaktion: BCEM EG / EP
Kürzel: AA
Format: TT.MM.JJJJ (Logik wie ‚AS‘)
Datumsergänzung: Bei verkürzter Eingabe werden der aktuelle Monat und das Jahr ergänzt.

Eine gleichzeitige Eingabe von AA und AS ist möglich. Bei einer Eingabe von AS können nach wie vor nur Börsentage eingegeben werden.

Das Datum von AA kann wie bei AS 90 Tage in der Vergangenheit liegen.

Beim Schließen von Aufgaben wird das Abschlussdatum (auch ein ggf. abweichendes Abschlussdatum) übernommen. Für den Fall, dass eine Aufgabe in BCEM GE geschlossen wird und ein weiteres AA mitgegeben werden soll, wird dieses ignoriert und das der Aufgabe übernommen.

Bei der Verkettung von Geschäften ist das abweichende Abschlussdatum kein Verkettungskriterium. Es stellt lediglich eine zusätzliche Information für die Meldung nach § 9 dar.

3.3 Dokumentation

Im on line Maklertagebuch wird das abweichende Abschlussdatum hinter der Abschlussuhrzeit angezeigt

TRAN: BCEM FC: MT SB: N#####080801#F							
XONTRO TRADE / INFO-MAKLER-TAGESGESCHAEFTSLISTE				78xx/00 MAKLER			
675700 NSU AUDI AG							
GESCHAEFTSNUMMER	NOMINALE	AN		KURS	VON		KURS
F 0808 0100001	14	7034	ISL	150,000	7005	ISL	150,000
AUK2002 AUV1906 AAK2907 AAV0408 AB							
F 0808 0100004	1	AUF		150,000	7005		150,000
AU1904 AA0408 AB							
F 0808 0280001	9	7001	ASL	150,000	7005		150,000
GN/K2507010100002 AUV1200 AB							
F 0808 0280002	11	7034	TSL	150,000	7005	TSL	150,000
AUK1901 AUV1903 AA0408 AB							
F 0808 0280003	21	7034	TSL	150,000	7005	TSL	150,000
AUK1905 AUV2001 AAK0408 AAV2907 AB							
F 0808 0280004	51	7001	ASL	150,000	7005	ASL	150,000
GN/K2507010100002 GN/V0708010100002 AB							
F 0808 0280005	5	7034	TSL	150,000	7005	ASL	150,000
GN/V0708010100002 AUK2002 AAK2907 AB							
F 0808 0280006	6	7001	ASL	150,000	7005	TSL	150,000
GN/K2507010100002 AUV1906 AAV0408 AB							
F 0808 0280009	3	7034	TSL	150,000	7002		150,000
AUK1902 AUV1351 AAK0408 AB							

Erläuterung:

Bei der Schließung von Aufgaben kann das Kennzeichen nur bei taggleichen Schließungen angezeigt werden. Bei Schließungen von älteren Aufgaben ist das Kennzeichen im Maklertagebuch des Entstehungstages nachzuschlagen.

Sind bei taggleichen Schließungen das Datum der Kauf und Verkaufseite unterschiedlich, wird für die Kaufseite AAKttmm und die Verkaufseite AAVttmm angezeigt. Ist das Datum gleich, wird nur einmal AAttmm angezeigt.

Wurde das Kennzeichen nur auf einer Seite eingegeben, wird es auch nur für diese Seite angezeigt AAKttmm oder AAVttmm.

In der Druckversion wird das abweichende Abschlussdatum in der Zusatzzeile angezeigt.

3.4. Systemanschluss Makler

Auch hierzu finden Sie die Änderungen im Systemanschluss Makler in der Beschreibung der XONTRO Values API Release Notes (Stand: 14.08.2001). Diese entnehmen sie bitte unserer Homepage www.xontro.de und dem Verzeichnis: Produkte/XONTRO/Dokumentation/Finanzdienstleister/Xontro-Systemanschluss.

4 Kennzeichen Eigengeschäft

Die Makler haben bereits mit der Einführung der Meldepflicht für Wertpapiergeschäfte gemäß § 9 WpHG zum 01.01.1996 in XONTRO die Möglichkeit erhalten, ihre Eigengeschäfte besonders zu kennzeichnen.

Ab dem 29. Oktober 2001 wird dieses Kennzeichen auch auf der Schlussnote an die Depotbank übertragen.