

An
alle Kreditinstitute

per eMail

Frankfurt am Main, den 05. November 2007

Tel.-Durchwahl: 069 – 58 99 78 – 110

Sehr geehrte Damen und Herren,

wie im Rundschreiben vom 26. Juli angekündigt, werden wir ab Montag, dem 12. November 2007, das Datum des Geschäftstages in unserem Testsystem IMS27 wie folgt manipulieren:

| | Echte Kalendertage im November | Geschäftstage im IMS27 |
|------------|-----------------------------------|---------------------------|
| Montag | 12. Nov. | 19. Dez. |
| Dienstag | 13. Nov. | 20. Dez. |
| Mittwoch | 14. Nov. | 21. Dez. |
| Donnerstag | 15. Nov. | 24. Dez. |
| Freitag | 16. Nov. | 27. Dez. |
| Samstag | 17. Nov. | |
| Sonntag | 18. Nov. | |
| Montag | 19. Nov. | 28. Dez. |
| Dienstag | 20. Nov. | 31. Dez. |
| Mittwoch | 21. Nov. | 02. Jan. |
| Donnerstag | 22. Nov. | 03. Jan. |
| Freitag | 23. Nov. | 04. Jan. |

Dieser Test dient insbesondere dazu, die Erfüllungstage 24. Dezember 2007 und 31. Dezember 2007 zu testen. Banken und Makler können sich an diesem Test beteiligen, sofern ihre hausinternen Systeme mit den veränderten Tagesdaten umgehen können.

Während der Testperiode werden wir täglich – mit Ausnahme der beiden Erfüllungstage 24.12. und 31.12. – in den Gattungen

- DE0006599905 Kürzel MRK
- DE0001135283 Kürzel BB28

um 11:00 Uhr und um 14:00 Uhr Kurse feststellen.

Desweiteren empfehlen wir aus funktionaler Sicht folgende Tests, die Sie ohne unsere Unterstützung mit Direktgeschäfts-Eingaben durchführen können:

- Eingabe von Bankdirektgeschäften am 21.12. und 28.12.
- Storno dieser Geschäfte am 24.12. und 31.12.
- Eingabe von Geschäften mit Festvaluta oder abweichendem Schlusstag 24.12. und 31.12.

Außerdem empfehlen wir, dass Sie zu Beginn und Ende der Testperiode Ihre Testbestände löschen.

Banken, die den Systemanschluss (SAKI) nutzen, beachten bitte, dass während der Testperiode alle Nachrichten (MTxxx) ausschließlich mit entsprechend manipulierten Datumswerten versandt bzw. entgegengenommen werden.

Wegen bzw. während der Datumsumstellung können keine Geschäftsdaten mit anderen Systemen ausgetauscht werden, bei welchen diese Datumsmanipulation nicht durchgeführt wird. Dies bedeutet im Besonderen:

- Während der Datumsumstellung werden keine Schlussnoten bzw. Schlussnoten-Datenträger für Xetra Geschäfte erstellt.
- Es werden keine in XONTRO abgeschlossenen CCP Geschäfte an „den CCP“, also an das Eurex Clearing AG Simu Backend, weiter geleitet.

An den beiden Erfüllungstagen 24.12. und 31.12. sowie am 28.12. (Jahreschlussbörse) wird der Buchungsschnitt auf 18:30 Uhr vorgezogen.

Neue Eingabe-Bezüge („MAN...“, „ZWA...“) im Schlussnoten-Datenträger: Ergänzende Bemerkungen

Aus gegebenen Anlass weisen wir bei der Verwendung der neuen Eingabe-Bezüge („MAN...“ und „ZWA...“) im Schlussnoten-Datenträger noch auf folgendes hin:

In der Beschreibung „S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten, Ge-

schäftsbestätigungen und CCP-Geschäfte aus XONTRO Trade“ in der Version 19.9, gültig ab dem 22. Oktober 2007, findet sich zum Thema „Etikett 21 Order-Referenz“ auf der Seite 12 folgender Hinweis:

„Wenn sich die Nominale eines Geschäftes aus mehreren Ordnern zusammensetzt bzw. wenn die ausgeführte Ordernominale nur teilweise in das Geschäft fließt und gleichzeitig eine Referenzierung von Ordnernummern gewünscht wurde, so wird das Feld mit 'MT599' belegt. Die Daten der zugehörigen Orders befinden sich im MT599, welcher jeweils zur entsprechenden Geschäftsnummer bis zu 34 Ordnernummern inkl. der jeweiligen Nominalen enthält.“

Dieselbe Logik wird entsprechend auch bei den manuellen Eingabe-Bezügen angewandt. Dies bedeutet unter anderem: Wenn in die Nominale des Geschäfts nur eine Teilnominale der ursprünglich vom Makler eingestellten – und mit einer „MAN...“-Referenz versehenen – Position eingeht, dann steht (auch) in diesem Fall im Etikett 21 die Konstante „MT599“. Der MANuelle Eingabe-Bezug – zusammen mit der Nominalen aus dieser Eingabe, die in das betreffende Geschäft eingeflossen ist – steht dann (auch) im unmittelbar folgenden MT599, Zeile 2. Dies gilt auch dann, wenn das Geschäft nur diesen einen Eingabe-Bezug hat.

Bitte beachten Sie außerdem noch, dass in bestimmten Situationen im MT599 auch eine Mischung aus „echten“ (bankinternen oder DWZ-) Orderreferenzen und manuellen Eingabe-Bezügen enthalten sein kann.

Für Rückfragen zu den genannten Themen stehen wir unter der oben angegebenen Telefon-Durchwahl oder über unsere e-Mail Sammeladresse trade@xontro.de gerne zur Verfügung.

Mit freundlichen Grüßen

Dr. Michael Hamke

Mirja Bachmann