

An  
alle Kreditinstitute

per eMail

Frankfurt am Main, den 26. Januar 2010

Tel.-Durchwahl: 069 – 58 99 78 – 110

Sehr geehrte Damen und Herren,

bei den Valuta-Angaben für Bankdirektgeschäfte und händische Geschäftseingaben der Makler werden wir folgende Änderungen durchführen:

Zum 22. März 2010 schaffen wir die Möglichkeit, die Valuta-Angabe FZ (Zug-um-Zug) mit dem Datum T+1 zu versehen. Bisher kann FZ nur mit einem Datum von T+2 bis T+90 versehen werden. Es ist zu beachten, dass Geschäfte mit FZ(T+1) nur am Tag der Geschäftseingabe bis zum Eingabe-Ende um 20:30 h storniert werden können.

In den Systemen von Clearstream gilt: Da ein solches Geschäft am Valutatag frühestens im SDS1 (10:00 h) disponiert wird, kann es zuvor noch bis spätestens 09:30 h gesperrt bzw. freigegeben und/oder für die SDS2-Verarbeitung bis spätestens 13:45 h wieder freigegeben werden, so dass noch an T+1 (im SDS2) die Disposition erfolgt. Ein freigegebenes Geschäft, das mangels Deckung im SDS1 nicht disponiert wurde, kann dann bis 13:45 h auch noch gesperrt werden.

Voraussichtlich zum 21. Juni 2010 werden die Valuta-Angaben FO (ohne Gegenwert) und FV (Geld auch ohne Stücke) abgeschafft.

Außerdem möchten wir auf die Feldbelegung bei Bankdirektgeschäften hinweisen: Bisher ist bei Bankdirektgeschäften der Eingaber immer mit einem der beiden Kontrahenten identisch. Inzwischen ist es möglich, dass Bankdirektgeschäfte von einem reinen Handelsteilnehmer (Kontengruppe 32 XO-NUR-HANDELSTN. in der KUSTA) eingegeben werden, der nicht selbst abwickelt. Eingaber (Etikett 72, 1. Zeile im MT 512) in beiden Geschäftsbestätigungen ist dann der Handelsteilnehmer. Im Feld Kontrahent (Etikett 82D) steht die Abwicklungsbank des Handelsteilnehmers. Da der Eingaber in diesen Fällen auch der wirtschaftliche Käufer oder Verkäufer ist, wird der Eingaber zusätzlich (on line und im Druck) als TEILN-V oder TEILN-K angezeigt und (im MT512) in den beiden Etiketten 87F. Das entspricht der bisher schon bestehenden Logik bei Maklervermittelten Geschäften eines reinen Handelsteilnehmers in XONTRO oder bei Geschäften eines Non-Clearers aus der Vor-CCP-Zeit in Xetra.

Für Rückfragen stehen wir gerne zur Verfügung.

Mit freundlichen Grüßen



Dr. Michael Hamke

Renate Einstädter