



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 40

In XONTRO werden die folgenden Änderungen eingesetzt:

- zum 21. September 2009 : Aufhebung des vorzeitigen Annahmeschlusses für Order in Pfandbriefen und einigen weiteren Wertpapierarten an der Börse Düsseldorf
- am 22. September 2009 : morgens zwischen 07:00 h und 08:30 h: Nicht-Verfügbarkeit der Test- und Simulations-Umgebung (IMS27) wegen notwendiger Wartungsarbeiten
- zum 28. September 2009 : Einführung der neuen „Resend“ Funktionalität für Orderzugänge nach Xetra im Systemanschluss für Kreditinstitute (SAKI)
- zum 1. Oktober 2009 : Einstellung des physischen Ausdrucks aller Paper-Listen und -Reports durch die Börse
- zum 12. Oktober 2009 : Einführung des Handelsmodells „Continuous Auction with Specialist“ (für die so genannten „PERD Equities“) auf Xetra Frankfurt, mit entsprechenden Anpassungen im Antwortverhalten bei „Gesperrem Xetra Orderbuch“ im Systemanschluss für Kreditinstitute (SAKI)
- zum 2. November 2009 : Einführung eines neuen Courtagemodells an den Börsen Hamburg und Hannover; Start der neuen Xetra-Handelsplattform „Xetra International Market“
- zum 23. November 2009 : Anpassung der S.W.I.F.T. - Texte für die „Art des Wertpapiers“ (Etikett 35A) im Systemanschluss für Kreditinstitute (SAKI) und im Schlussnoten-Datenträger
- zum 4. Januar 2010 : Einstellung der Funktionen BxAG DG/DN (des so genannten Terminaldrucks der Schlussnoten) für Banken

1. Aufhebung des vorzeitigen Annahmeschlusses für Order in Pfandbriefen und einigen weiteren Wertpapierarten an der Börse Düsseldorf (zum 21. September 2009)

An der Börse Düsseldorf besteht zur Zeit noch ein Annahmeschluss für Order in Pfandbriefen und einigen weiteren Wertpapierarten. Order in diesen Gattungen, die nach 11:45 h eingehen, werden zur Zeit noch zu Folgetagsordern.

Diese Regelung wird mit Wirkung von Montag, dem 21. September 2009, ersatzlos aufgehoben.

2. Nicht-Verfügbarkeit der Test- und Simulations-Umgebung (IMS27) (am 22. September 2009)

Es ist geplant, am 22. September 2009, morgens von 7:00 h bis 08:30 h eine DB2 Wartung für die XONTRO Simulations- und Test-Umgebung (IMS27) durchzuführen. Während dieser Zeit wird das System gestoppt. Wir bitten Sie, diesen Umstand bei Ihrer Testplanung zu berücksichtigen.

3. Einführung der neuen „Resend“ Funktionalität für Orderzugänge nach Xetra, im Systemanschluss für Kreditinstitute (SAKI) (zum 28. September 2009)

Durch die Resend-Funktionalität wird es ermöglicht, eine bereits verschickte Ordereinstellung noch einmal zu senden, wenn auf die Originalnachricht keine Antwort angekommen ist. Sie steht ausschließlich für die MTs 500/501 (Bank an System) nach Xetra zur Verfügung.

Beim Resend enthält die Nachricht identische Orderdaten wie der ursprüngliche MT500/501. Zusätzlich ist im Feld 23 das Unterfeld „Automatische Lieferfreigabe“ mit „D“ (für „Duplicate“) belegt. Die BI-Ordernummer muss belegt und in Kombination mit den Orderattributen eindeutig sein. Die ISN ist neu und eindeutig.

Ein Resend für eine Ordereinstellung kann mehrfach versendet werden. Bei Nutzung der Resend-Funktionalität ist sichergestellt, dass eine Order nur einmal im Handelssystem erfasst wird.

Kann die Originalorder zu einem Resend nicht eindeutig bestimmt werden, wird die Nachricht mit der Fehlermeldung XK0050F „Orderdaten nicht eindeutig für Resend-Nachricht“ abgelehnt. Die Antwort auf einen Resend wird mit der ISN der Resend-Nachricht referenziert. Eine ggf. noch ausstehende Orderbestätigung für die Originalorder wird mit der ISN des ursprünglichen MT500/501 im Feld „Eingabereferenz“ des Anwendungsheaders übertragen

Eine ausführliche Beschreibung der Resend-Funktionalität ist in der neuesten Version 5.3 der „Technischen Anbindung für Kreditinstitute“ zu finden. Dieses Dokument ist über den folgenden Link erreichbar:

http://www.xontro.de/fileadmin/media/documents/KI_Dokumentation_SAKI/1_swift_xontro_5_3.pdf

Die Beschreibung des Feldes 23 / Unterfeld "automatische Lieferfreigabe" beim MT500/501 für Xetra-Orders wurde entsprechend angepasst. Außerdem wurden drei neue Fehlermeldungen (XK0030F, XK0040F und XK0050F) verfasst.

4. Einstellung des physischen Ausdrucks aller Paper-Listen und -Reports durch die Börse (zum 1. Oktober 2009)

Wie Ihnen bereits per XONTRO Rundschreiben mit Datum vom 19. März 2009 mitgeteilt wurde, werden ab dem 1. Oktober 2009 von der Börse keine Papierreports mehr ausgeliefert bzw. zur Verfügung gestellt. Hiermit möchten wir Sie nochmals darauf hinweisen, dass die Lieferung dieser Listen und Reports mit Datum 1. Oktober 2009 ersatzlos eingestellt werden wird. Falls diese Listen oder Reports dennoch weiterhin von Ihrem Hause benötigt werden, so bitten wir Sie, die Lieferung dieser Unterlagen auf einem der verfügbaren alternativen Versandwege per Formular bei BrainTrade zu beauftragen. Das betreffende Formular ist über den folgenden Link abrufbar:

<http://www.xontro.de/fileadmin/media/documents/Rundschreiben/20090330-Listumbestellung.pdf>

Die Beauftragung des alternativen Versands der betreffenden Unterlagen ist noch bis zum 30. September 2009 möglich.

5. Einführung des Handelsmodells „Continuous Auction with Specialist“ für die so genannten „PERD Equities“ auf Xetra Frankfurt (zum 12. Oktober 2009)

Zum 12. Oktober 2009 wird auf Xetra Frankfurt das so genannte „Handelsmodell 8: Continuous Auction with Specialist“ auch auf Xetra Frankfurt (für die so genannten „PERD Equities“) produktiv eingeführt. Für XONTRO bedeutet dies, dass bei der Ordereingabe nach Xetra Frankfurt über den Systemanschluss für Kreditinstitute (SAKI) und bei „eingefrorenem Orderbuch“ zunächst nur eine vorläufige Eingangsbestätigung zurückgesendet wird. Dieses Antwortverhalten war bei den Xetra-basierten Handelsplattformen so bisher nur von Xetra Frankfurt 2 (Scoach) bekannt. Wir bitten Sie, diese Änderungen bei der Auswertung der SAKI-Nachrichten von Xetra Frankfurt in Zukunft ebenfalls zu berücksichtigen. Das Antwortverhalten im SAKI kann bereits im Rahmen der derzeit laufenden Xetra Release 10.1 Simulation getestet bzw. simuliert werden.

6. Neue Courtageschlüssel an den Börsen Hamburg und Hannover (zum 2. November 2009)

Zum 2. November 2009 wird an den Börsen Hamburg und Hannover ein neues Courtagemodell eingeführt. Hierzu wurden von WM neue Schlüssel für das Feld „Maklergebühr (XD697)“ eingeführt.

Für die Ausführung von Orders mit einem Kurswert bis zu bestimmten Grenzen (siehe Tabelle) fällt keine Courtage an. Für Aufträge mit Kurswerten über den genannten Grenzen gelten die Courtagesätze von 0,04% bzw. 0,08%.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Details des neuen Modells:

WM-Schlüssel	Courtagefrei bis Kurswert in Euro	Courtagesatz in Prozent	berechnet ab Kurswert in Euro
6A	50.000,00 €	0,04 %	50.000,01 €
6B	25.000,00 €	0,08 %	25.000,01 €
6C	25.000,00 €	0,08 %	25.000,01 €
6D		0,08 %	0,01 € (Minimum 0,75 €)
6E	25.000,00 €	0,08 %	25.000,01 €
6F	25.000,00 €	0,08 %	25.000,01 €
6G	25.000,00 €	0,08 %	25.000,01 €
6H	25.000,00 €	0,08 %	25.000,01 €

Die bisherigen Courtage-Caps entfallen bei diesen neuen Schlüsseln. Das WM-Feld XD698 wird daher gelöscht.

Hinweis:

Bitte beachten Sie auch, dass die Börsen Hamburg und Hannover zum gleichen Zeitpunkt auch das Transaktionsentgelt im Bereich der Aktienwerte anpassen. Ab diesem Zeitpunkt fallen für Orders in Aktienwerten 0,25 Promille des Kurswertes, mindestens 1,30 € und maximal 11,- €, an.

7. Start der neuen Xetra-Handelsplattform „Xetra International Market“ (ebenfalls zum 2. November 2009)

Ebenfalls am 2. November 2009 nimmt die neue Xetra-basierte Handelsplattform „Xetra International Market“ ihren produktiven Betrieb auf. Diese Plattform hat jedoch keine Auswirkungen für die XONTRO Teilnehmer, d.h. konkret:

- das Orderrouting zu „Xetra International Market“ ist nicht über den Systemanschluss für Kreditinstitute (SAKI) möglich, und
- es werden in XONTRO Trade keine Schlussnoten für auf „Xetra International Market“ abgeschlossene Geschäfte erzeugt.

8. Anpassung der S.W.I.F.T. - Texte für die „Art des Wertpapiers“ (zum 23. November 2009)

Mit Datum 23. November 2009 erfolgt die Zuordnung der „Wertpapierart“ zum Textfeld „Art des Wertpapiers“ (meistens im Etikett 35A) im Systemanschluss für Kreditinstitute (SAKI) und im Schlussnoten-Datenträger für die Banken aufgrund der „Produktgruppe“ im WM-Feld GD198B. Dadurch fallen einige der bisherigen Codes in Zukunft weg, andere kommen neu dazu oder werden anders zugeordnet. Über diese Änderung wurden die XONTRO Teilnehmer ebenfalls bereits per XONTRO Rundschreiben mit Datum vom 4. August 2009 informiert. Dieses Rundschreiben ist über den folgenden Link abrufbar:

<http://www.xontro.de/fileadmin/media/documents/Rundschreiben/20090804-rundschreiben-KI-SWIFT-Texte-Terminaldruck.pdf>

Für die detaillierte Beschreibung der einzelnen Feldinhalte wurden die Beschreibungen der „Technischen Anbindung Kreditinstitute“ sowie des Schlussnoten-Datenträgers entsprechend aktualisiert; die aktuellen Versionen dieser beiden Dokumente sind ebenfalls über die beiden folgenden Links abrufbar:

http://www.xontro.de/fileadmin/media/documents/KI_Dokumentation_SAKI/1_swift_xontro_5_3.pdf

http://www.xontro.de/fileadmin/media/documents/KI_Dokumentation_SAKI/SWIFT_DT_R211_20090803_20091123.pdf

Wir bitten Sie, auch diese Änderungen zu beachten.

9. Reminder: Einstellung der Funktionen BxAG DG/DN (des so genannten Terminaldrucks der Schlussnoten) für Banken (zum 4. Januar 2010)

Bei dieser Gelegenheit möchten wir ebenfalls nochmals darauf hinweisen, dass die Funktion BxAG DG/DN (der so genannte Terminaldruck der Schlussnoten) zum 4. Januar 2010 eingestellt wird.