



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 36

Dieser Newsletter beschreibt einige technische Einzelheiten, die an den letzten Tagen des Jahres 2008 zu beachten sind.

Vorbehaltlich der Entscheidung der Gremien der Frankfurter Wertpapierbörse (FWB) wird die Handelszeit auch an der FWB am 30.12.2008 (Jahresschlussbörse) - wie in den Vorjahren - um 14:00 h enden. Ein offizielles Rundschreiben wird voraussichtlich Mitte Dezember 2008 versandt.

## **1 Jahresende 2008 - Überblick**

Mittwoch, der 24. Dezember, und Mittwoch, der 31. Dezember 2008, sind keine Börsentage, sondern nur Erfüllungstage. Die wesentlichen Besonderheiten an Erfüllungstagen werden im Folgenden unter 2) beschrieben.

Montag, der 29. Dezember, und Dienstag, der 30. Dezember 2008, sind Börsentage. Am Montag sind keinerlei Besonderheiten zu beachten, am Dienstag – Tag der Jahresabschlussbörse – werden Kurse nur bis 14:00 festgestellt, der Buchungsschnitt wird auf 18:30 Uhr vorgezogen.

Folgetagsorder und die übliche Orderlöschung zum Jahresende werden unter 3) beschrieben.

Im Übrigen wird auf die angehängte Tabelle verwiesen.

## **2 Erfüllungstage**

### **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 9:00 Uhr die Nachricht "Unterbrechung der Börsenversammlung" (MT551 mit Ereignisschlüssel BOINT); die Wiederaufnahme erfolgt am nächsten Börsentag ohne eine besondere Nachricht.

## **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.

## **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.

## **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.

## **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.

### **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 Mittwoch, dem 31. Dezember 2008, statt.

Folgetagsorder, die ab dem 02. Januar 2009 gelten sollen, können nur am Mittwoch, dem 31. Dezember 2008, eingestellt werden.

### **4 Eingeschränkte Testmöglichkeiten “über die Feiertage”**

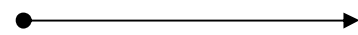
Von Montag, dem 22. Dezember 2008, bis Freitag, dem 02. Januar 2009, unterstützen wir keine Tests in XONTRO (weder im IMS27 noch im IMS29).

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	Mo	Di	Mi	Do	Fr	Sa	So	Mo	Di	Mi	Do	Fr	Sa	So	Mo
Börsentag / Erfüllungstag	Bö- Tag	Bö- Tag	Erf- Tag					Bö- Tag	Bö- Tag	Erf- Tag		Bö- Tag			Bö- Tag
Kursfeststellung	ja	ja	nein					ja	ja***)	nein		ja			ja
Buchungsschnitt*)	20:30	20:30	18:30					20:30	18:30	18:30		20:30			20:30
ZS CCP-Aufgaben**)	ja	ja	nein					ja	ja	nein		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
Folgetagsorder															
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  
z.B. 24.12.

Gültig  
ab  
29.12.