



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 37

In XONTRO werden die folgenden Änderungen eingesetzt:

zum 23. Februar 2009: Handel in stücknotierten Anleihen

Handel in stücknotierten Anleihen

Allgemeines

Bisher wurden in XONTRO alle Anleihen automatisch als prozentnotierte Papiere behandelt, auch wenn es sich um stücknotierte Werte gehandelt hat. Daher wurden stücknotierte Anleihen an den Börsen meist nicht zum Handel zugelassen.

Ab 23. Februar 2009 werden in XONTRO die notwendigen Änderungen vorgenommen, damit diese Papiere richtig verarbeitet werden.

Berechnung des Nennwertes

Um die Berechnung von nennwert-basierten Werten korrekt vorzunehmen, wird bei stücknotierten Anleihen der Nennwert durch die Rechenoperation „Stückzahl * Nennwert zum Stück (GD460A)“ ermittelt.

Der so ermittelte Nennwert wird bei nennwertbezogenen Berechnungen wie Stückzinsen, Courtage, Transaktionsentgelten u. ä. herangezogen.

Sonderheiten

- Bitte beachten Sie, dass bei Geschäften in stücknotierten Fremdwährungsanleihen der Devisenkurs mitgegeben werden muss, damit eine Umrechnung des Nennwertes in Euro erfolgen kann.
- Wenn der „Nennwert zum Stück“ in den Gattungsstammdaten nicht gepflegt ist, können der Nennwert und damit die nennwert-basierten Beträge nicht ermittelt werden. Die betroffenen Beträge bleiben in diesem Fall leer.

Test

Die Änderungen sind im Simulationssystem IMS27 bereits verfügbar. Für den Fall, dass Sie die Änderungen testen wollen, stehen Ihnen folgende Gattungen im Simulationssystem zur Verfügung:

ISIN	Depot-Währung	Nennwert/Stück	Notierung in
DE000DB0TUT1	EUR	0	Düsseldorf, Frankfurt, Stuttgart
DE0006949555	EUR	100	Berlin, Frankfurt, Hamburg, Stuttgart
DE000A0TX6J3	EUR	1.000	Düsseldorf, Frankfurt, Stuttgart
DE000A0TY9V1	USD	1.000	Berlin, Frankfurt, Stuttgart
CH0043142071	DEM	1.000	Frankfurt, Hamburg, Stuttgart