



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 39

In XONTRO werden die folgenden Änderungen eingesetzt:

zum 08. und 09. Juni 2009 XONTRO Release 27.2: Anpassungen in XONTRO wegen Änderungen im Entgeltmodell der Börse Stuttgart sowie Einführung der Tick-sizes in Abhängigkeit von WM-Feldern.

Anmerkung:

Dieser Newsletter Nr. 39 beschreibt einige Anpassungen für XONTRO (Release 27.2), die zum 08./09. Juni 2009 produktiv eingesetzt werden. Weitere zum 08. Juni 2009 produktiv wirksam werdende Anpassungen für das XONTRO Release 27.2 werden in einem späteren, gesonderten Newsletter beschrieben.

1 Anpassungen im Entgeltmodell

2.1 Einleitung

Die Börse Stuttgart plant Anpassungen im Entgeltmodell, die im Folgenden beschrieben werden. Die Änderungen werden zum 08. und 09. Juni 2009 zum Einsatz kommen.

2.2 Anpassungen

1.2.1 Teilausführungen

Jede Orderausführung wird bepreist. Dabei ist es unerheblich, ob es sich um Teilausführungen handelt oder nicht. Jedoch werden mehrere Teilausführungen des Börsentages zusammengefasst und das Entgelt auf das zusammengefasste Volumen berechnet. Die Zusammenfassungen werden im Entgeltdatei gesondert gekennzeichnet.

1.2.2 Vergabe von Eingabenummern und Lieferung im Schlussnoten-Format MT512

Bei Geschäften, denen keine elektronischen Orders zu Grunde liegen, erfolgt die Berechnung wie bisher auf Basis der – vom Makler – eingegebenen Geschäftsnominalen. Wie schon für Geschäfte an den anderen Börsenplätzen (außer München) wird diese Geschäftseingabe künftig mit einer Nummer versehen. Die Eingabenummer trägt den Präfix MAN.

Kreditinstitute, die die Referenzierung bereits bestellt haben, erhalten die Referenzierung dann auch für den Börsenplatz Stuttgart automatisch zum Einsatztermin am 08. Juni 2009.

Falls Sie die Eingabenummer in den Schlussnoten (MT512) noch nicht erhalten, dies aber umstellen wollen, nutzen Sie bitte das entsprechende Bestellformular, das Sie auf unserer Homepage www.xontro.de finden.

1.2.3 Storno

Im Falle eines Storno erfolgt die Referenzierung des stornierten Geschäftes bei manuellen Eingaben über die neu aufgenommene Eingabenummer und bei orderbezogenen Geschäften über die Ordernummer. Der Bezug auf die Geschäftsnummer entfällt.

2.3 Änderungen im Entgeltdatei

In der Entgeltdatei entfallen zukünftig die Felder:

- BOETAG-EING (Eingabe Börsentag)
- BOE-PLATZ-GNR (Börsenplatz Geschäftsnummer)
- LFD-GNR (laufende Geschäftsnummer)

Neu aufgenommen wird das Feld:

- EINGABENUMMER
- KZ_AUSF_KUMULIERT (Kennzeichen kumulierte Ausführung)

Sind die Felder der Order- bzw. Eingabenummer nicht belegt, so werden diese in der Entgeltdatei mit Leerzeichen anstelle Nullen gefüllt.

2.4 Hinweis

Die Lieferung der Eingabenummer in der Schlussnote (MT512) erfolgt ab dem **08. Juni 2009**. Die fachlichen Änderungen und die Anpassung der Entgeltdatei erfolgen ab dem **09. Juni 2009**. Dies ist notwendig, da bei Stornos eine Eingabenummer vorhanden sein muss.

2. Tick-sizes in Abhängigkeit von WM-Feldern

Ab dem 08. Juni 2009 wird XONTRO bei der Bestimmung der zulässigen Tick-sizes auf das WM-Feld XD546 Tick-Größe XONTRO zugreifen. Das Feld enthält die folgenden vier Schlüssel:

- N Standardregelung für nicht-stücknotierte Werte
- S Standardregelung für stücknotierte Werte
- 3 Sonderregelung für ausgewählte Aktien
- 4 Sonderregelung diverse

Die Schlüssel geben die bisher nur im Programm hinterlegte Regelung wieder:

Standardregelung (Schlüssel S) für stücknotierte Werte	
Kurs	Tick-Sizes
>= 1,00 €	0,01 €
< 1,00 €	0,001€

Sonderregelung (Schlüssel 3) für ausgewählte Aktien	
Kurs	Tick-Sizes
> =1,00 €	0,005 €
< 1,00 €	0,001€

Standardregelung (Schlüssel N) für nicht-stücknotierte Werte	
Restlaufzeit ²⁾	Tick-Sizes
< 2 Jahre	0,001%
>= 2 Jahre	0,005%
>= 7 Jahre	0,01%
Ohne Tilgungstermin ³⁾	0,001%

Sonderregelung (Schlüssel 4) diverse für
- stück- und nicht-stücknotierte Floater, Zero-Bonds und Strips (an allen Börsen)
- ausgewählte ETFs (an allen Börsen)
- alle nicht-stücknotierten Werte am Börsenplatz Stuttgart
Die Tick-sizes betragen immer 0,001€ bzw. 0,001%

ANHANG zum Entgeltmodell

Die tägliche Entgeltdatei hat folgenden Aufbau:

Feld	Beschreibung	Format
ABSCHL_DATUM	Abschlussstag	PIC 9(8)
ABSCHL_ZEIT	Abschluss-Uhrzeit (ist '0', wenn KZ_AUSF_KUMULIERT= 'J')	PIC 9(8)
EINGABENUMMER	Eingabenummer bei manueller Geschäftseingabe (3 Stellen Präfix „MAN“ gefolgt von 6 Stellen Datum JJMMTT und 7-stelliger Nummer)	PIC X(16)
ORDER_NO	XONTRO-Ordernummer	PIC X(13)
BUY_SELL_FLAG	Geschäftsart	PIC X
WEITERGELEITET	W oder blank/ NULL kennzeichnet, ob die Order weitergeleitet wurde	PIC X
STORNO_FLAG	Storno-Kennzeichen	PIC X
BOE_EINGEBER	BPL des Orderempfängers bzw. des Eingebers	PIC XXX
EINGEBER	CBF-Nr. Orderempfänger / Eingebener	PIC 9(4)
EINGEBER_KZ_EIN_ART	Kennzeichen, ob Eingebener Bank oder Makler 000 = Bank 001 = Makler	PIC 999
BOE_AUFGEBER	BPL des Orderaufgebers bzw. des SNO-Empfängers	PIC XXX
AUFGEBER	CBF-Nr. des Orderaufgebenden bzw. des SNO-Empfänger	PIC 9(4)
AUFGEBER_KZ_EIN_ART	Kennzeichen, ob Empfänger Bank oder Makler 000 = Bank 001 = Makler	PIC 999
ISIN	ISIN	PIC X(12)
PREIS	Preis (bei KZ_AUSF_KUMULIERT = ,J' wird hier ein gewichteter Durchschnittspreis eingestellt)	PIC 9(8)V9(8)
NR_KF	Nummer der Kursfeststellung (ist '0', wenn KZ_AUSF_KUMULIERT= 'J')	PIC 9(5)
NOMINALE	Volumen (bei KZ_AUSF_KUMULIERT = 'J' das kumulierte Volumen aller zusammengefassten Teilausführungen)	PIC 9(14)V9(3)
KURSWERT	Kurswert (bei KZ_AUSF_KUMULIERT = ,J', der kumulierte Kurswert aller zusammengefassten Teilausführungen)	PIC 9(15)V99
FIX_ENTGELT	anfallender Fixbetrag ohne MwSt	PIC S9(7)V9(2)
VAR_ENTGELT	errechneter variabler Entgeltbetrag ohne MwSt	PIC S9(7)V9(2)

Feld	Beschreibung	Format
Staffelentgelt	variables Entgelt für Emittenten ohne MwSt (nur gefüllt, wenn FIX_ENTGELT und VAR_Entgelt leer sind)	PIC S9(7)V9(2)
Entgelt-Kennzeichen	blank = Standard AT = abweichendes Transaktionsentgelt wurde eingegeben; der erfasste Betrag ersetzt das VAR_ENTGELT und das Fixentgelt bzw. das Staffelentgelt. Der Fixbetrag ist in diesem Fall immer leer. KT = es wurde kein Transaktionsentgelt berechnet HT = VAR_ENTGELT bzw. Staffelentgelt wurden halbiert; das FIX_ENTGELT bleibt davon unberührt.	PIC X(2)
Entgeltschlüssel	vgl. WM/WSS-Daten Entgeltschlüssel Stuttgart z. B. 3A, 3B, 3C, 3D, 3E, 3F, 3G, 39	PIC X(2)
QLP	Skontrofürer zu der ISIN	PIC 9(4)
KZ_AUSF_KUMULIERT	J/N (kumulierte Teilausführung)	PIC X