



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 42

Dieser Newsletter beschreibt einige technische Einzelheiten, die an den letzten Tagen des Jahres 2009 zu beachten sind.

1 Jahresende 2009 - Überblick

Donnerstag, der 24. Dezember, und Donnerstag, der 31. Dezember 2009, sind keine Börsentage, sondern nur Erfüllungstage. Die wesentlichen Besonderheiten an Erfüllungstagen werden im Folgenden unter 2) beschrieben.

Montag, der 28. Dezember, Dienstag, der 29. Dezember und Mittwoch, der 30. Dezember 2009, sind Börsentage. Am Montag und Dienstag sind keinerlei Besonderheiten zu beachten, am Mittwoch – Tag der Jahresschlussbörse – 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 Donnerstag, dem 31. Dezember 2009, statt.

Folgetagsorder, die ab dem 04. Januar 2010 gelten sollen, können nur am Donnerstag, dem 31. Dezember 2009, eingestellt werden.

4 Eingeschränkte Testmöglichkeiten “über die Feiertage”

Von Montag, dem 21. Dezember 2009, bis Donnerstag, dem 31. Dezember 2009, unterstützen wir keine Tests in XONTRO (weder im IMS27 noch im IMS29).

5 Abschaltung der Funktion BxAG DG / DN

Wie mehrfach angekündigt, wird die Funktion BxAG DG / DN (der so genannte Terminaldruck der Schlussnoten) zum Jahresbeginn 2010 abgeschaltet.

Hinweis

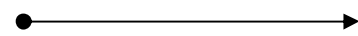
Wir beabsichtigen, zum 22. März 2010 die Kompensationsorder abzuschaffen.

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	Di	Mi	Do	Fr	Sa	So	Mo	Di	Mi	Do	Fr	Sa	So	Mo	Di
Börsentag / Erfüllungstag	Bö- Tag	Bö- Tag	Erf- Tag				Bö- Tag	Bö- Tag	Bö- Tag	Erf- Tag				Bö- Tag	Bö- Tag
Kursfeststellung	ja	ja	nein				ja	ja	ja***)	nein				ja	ja
Buchungsschnitt*)	20:30	20:30	18:30				20:30	20:30	18:30	18:30				20:30	20:30
ZS CCP-Aufgaben**)	ja	ja	nein				ja	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	GV
Folgetagsorder														ST	Sto
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 Gültig ab
z.B. 24.12. 28.12.