



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 63

Dieser Newsletter informiert Sie über folgende Themen:

- Ablauf am Jahresende
- Maximale Ordergültigkeit von 360 Kalendertagen
- Methode 16 im Zinsmodul
- Änderungen bei der Umsetzung der Verwahrart
- Änderungen im Schlussnotenversand per File-Transfer
- Änderung im Bereitstellungsrythmus der Entgeltdateien

1. Jahresende 2012

1.1 Überblick

Montag, der 24. Dezember, und Montag, der 31. Dezember 2012, sind keine Börsentage, sondern nur Erfüllungstage. Die wesentlichen Besonderheiten an Erfüllungstagen werden im Folgenden unter 1.2 beschrieben.

Donnerstag, der 27. Dezember, und Freitag, der 28. Dezember 2012, sind Börsentage. Am Donnerstag sind keinerlei Besonderheiten zu beachten; am Freitag – Tag der Jahresschlussbörse – werden Kurse nur bis 14:00 Uhr festgestellt, der Buchungsschnitt wird auf 18:30 Uhr vorgezogen.

Folgetagsorders und die letztmals durchgeführte Orderlöschung zum Jahresende werden unter 1.3 beschrieben.

Im Übrigen wird auf die angehängte Tabelle verwiesen.

1.2 Erfüllungstage

1.2.1 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. Orders können daher eingestellt, geändert und gelöscht werden, jedoch sind auf keinen Fall Ausführungen möglich. Tagesgültige Orders können an Erfüllungstagen eingestellt werden, verfallen aber am gleichen Tag.

An Erfüllungstagen können Geschäfte und/oder Aufgaben entstehen – aus Storno, aus Geschäftseingaben der Makler, aus Aufgabenschließungen und aus Bankdirektgeschäften.

Systemanschlussbanken erhalten an Erfüllungstagen vor 8:30 Uhr die Nachricht "Unterbrechung der Börsenversammlung" (Ereignisschlüssel BOINT im MT551 bei SAKI-Swift bzw. den „News“ bei SAKI-FIX); die Wiederaufnahme erfolgt am nächsten Börsentag ohne eine besondere Nachricht.

1.2.2 Eingabezeiten

An den beiden Erfüllungstagen wird das Eingabeende für Bankdirektgeschäfte auf 18:30 Uhr vorgezogen, dann beginnt der Buchungsschnitt. Danach sind keine Ordereingaben mehr möglich.

1.2.3 Abwicklung und Fristen

Erfüllungstage zählen bei allen Fristberechnungen als „normale Börsentage“ und zählen auch mit bei der Berechnung des Aufgabenalters.

Geschäfte vom Börsentag vor einem Erfüllungstag müssen spätestens am Erfüllungstag storniert werden.

1.2.4 Leerfiles

Schlussnotendatenträger werden an Erfüllungstagen auf jeden Fall versandt, auch für den Fall, dass 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.

1.2.5 Sonstiges

Die Übergabe von OTC-Geschäften (MT511 bzw. TradeCaptureReport) ist an Erfüllungstagen möglich, die Übergabe von MiFID-Meldungen (MT513 bzw. TradeCaptureReport) und deren Stornierung jedoch 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.

1.3 Tagesgültige Orders / Folgetagsorders / Orderlöschung am Jahresende

An Erfüllungstagen können Orders eingestellt werden, tagesgültige Orders verfallen aber am gleichen Tag.

Für die Gültigkeit von Folgetagsorders wird auf die angehängte Tabelle verwiesen.

Die letztmals durchgeführte Orderlöschung zum Jahresende findet am Montag, dem 31. Dezember 2012, statt.

Aufträge in Bezugsrechten sind jedoch von der Löschung ausgenommen, d.h. sie sind auch über diesen Termin hinaus gültig.

Wenn eine Zeichnungsfrist im alten Jahr beginnt und im neuen Jahr endet, werden im alten Jahr eingestellte Orders automatisch auf den 31. Dezember des neuen Jahres befristet und werden am Jahresende ebenfalls nicht gelöscht.

In der Orderhistorie (BxHI/OH) werden die gelöschten Orders mit dem Hinweis – „Löschung wegen Befristung von Aufträgen“ (Kurzform: L/Befristung) gekennzeichnet. Die gelöschten Aufträge können am nächsten Börsentag mit gleicher bankinterner Ordernummer, (jedoch automatische Vergabe einer neuen DWZ-Ordernummer) mit entsprechender Gültigkeit erneut wieder eingestellt werden.

Folgetagsorders, die ab Mittwoch, dem 02. Januar 2013 gelten sollen, können nur am Montag, dem 31. Dezember 2012, eingestellt werden. Diese Orders werden am Jahresende ebenfalls nicht gelöscht.

2. Maximale Ordergültigkeit von 360 Kalendertagen

Vom 10. Dezember 2012 an wird ein bei der Ordererfassung mitgegebenes Gültigkeitsdatum auf maximale Gültigkeit von 360 Kalendertagen geprüft.¹ Dabei gilt der Eingabe-Tag als erster Tag. Wird eine längere Gültigkeit mitgegeben, so wird die Eingabe abgelehnt. Dies gilt für die Ordererfassung im Dialog sowie über SAKI, FIX und SAM. Bei einer Orderänderung kann die Gültigkeit auf maximal 360 Kalendertage ab dem Änderungstag geändert werden.

¹ Zur Klarstellung: Wird zwischen dem 10. und dem 31. Dezember 2012 eine Order mit einer Gültigkeit über das Jahresende hinaus eingestellt, so wird sie trotzdem Ende 2012 gelöscht. Die Neuregelung wirkt sich letztlich also erst im Zusammenhang mit dem Jahresende 2013 aus.

Bei Zeichnungsaufträgen und im Fondssegment Hannover werden die bisherigen Gültigkeitsregeln beibehalten, d.h. die Gültigkeit wird auf das Jahresende des Endes der Zeichnungsfrist oder – wenn früher – den letzten Tilgungstermin gesetzt. Dadurch kann sich hier ausnahmsweise eine Ordergültigkeit von mehr als 360 Tagen ergeben.

Alle übrigen Regeln bleiben unverändert; insb. wird bei Auftragserfassung durch die Bank im Dialog weiterhin standardmäßig der Ultimo des aktuellen Monats als Gültigkeitsdatum ermittelt.

3. Änderungen im Zinsmodul

Bisher hat XONTRO die Methode 16 (Bond Basis) noch durch die deutsche Methode als beste Annäherung ersetzt. Seit dem 16. November 2012 kann XONTRO auch die Methode 16 korrekt darstellen.

4. Änderungen bei der Umsetzung der Verwahrart

In XONTRO wird bei allen Geschäften in AKV-verwahrten Titeln geprüft, ob beide Kontrahenten AKV-Teilnehmer sind. Wenn nicht beide Kontrahenten eines Geschäftes AKV-Teilnehmer sind, wird auf der Schlussnote und im Geschäftsbestand die Verwahrart von „AKV“ auf „WPR“ umgesetzt. Voraussichtlich ab April 2013 kann XONTRO diese Prüfung nicht mehr durchführen; die Umsetzung erfolgt dann in den Systemen von Clearstream. In vermutlich sehr seltenen Fällen kann daher die Angabe „AKV“ auf der Schlussnote eine Abwicklung in Wertpapierrechnung bedeuten.

5. Änderungen im Schlussnotenversand per File-Transfer

Wenn zwischen mehreren Kassenvereinsnummern eine Zentral-/Filial-Beziehung im Sinne der „Regulierung über (Reg.über)“ besteht, werden die Schlussnoten dieser Kassenvereinsnummern von XONTRO im File Transfer in einer einzigen Datei zusammengepackt. Wenn sich in der Zentral-/Filial-Beziehung Änderungen ergeben, werden diese Änderungen bisher noch von XONTRO automatisch nachvollzogen. Dieser Automatismus kann voraussichtlich ab dem 01. Februar 2013 nicht mehr dargestellt werden.

Die Reg.über-Zentralen werden daher gebeten, Änderungen bei ihren Filialen bereits ab dem 02. Januar 2013 an XONTRO-Trade zu melden. Ein solches Verfahren wird heute schon bei den Realtime-Schlussnoten angewandt.

6. Änderungen im Bereitstellungsrythmus der Entgeltdateien

Auf Wunsch etlicher Teilnehmer haben wir uns entschlossen, die beiden Entgeltdateien (Berlin/Düsseldorf/Hamburg/Hannover/München sowie Stuttgart) nicht mehr täglich sondern nur noch zum Monatsultimo bereitzustellen. Die Datei am Monatsultimo enthält dann alle Datensätze der einzelnen Tage in gesammelter Form. Damit ist es nicht mehr notwendig, die Daten der einzelnen Tage separat herunterzuladen bzw. zu empfangen und am Monatsende zusammenzufassen. Der Satzaufbau bleibt unverändert. Die Änderung betrifft sowohl die Bereitstellung per Datenübertragung sowie über den BT Fileservice im Internet.

Die Änderung tritt im Februar 2013 in Kraft, d. h. bis zum 31. Januar 2013 werden die Daten noch täglich übermittelt.

| Datum | 20.12. | 21.12. | 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. |
|----------------------------------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|
| Wochentag | Do | Fr | Sa | So | Mo | Di | Mi | Do | Fr | Sa | So | Mo | Di | Mi | Do |
| 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*) | 20:40 | 20:40 | | | 18:30 | | | 20:40 | 18:30 | | | 18:30 | | 20:40 | 20:40 |
| 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
**) bis 14:00 Uhr

Folgetagsorder
● →
Tag der Einstellung Gültig ab
z.B. 24.12. 27.12.