



XONTRO Newsletter

Makler

Nr. 35

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 und die Eingabe/Versendung von quotes durch die Skontroführer im Dialog und im SAM wird technisch unterbunden. Im Übrigen steht XONTRO aus technischer Sicht praktisch uneingeschränkt zur Verfügung, der Buchungsschnitt wird aber vorgezogen.

Die Makler können - mit Ausnahme der Kursfeststellung und der Quotierung - alle Dialogmasken und den SAM nutzen. Insbesondere sind Storno, händische Geschäftseingaben und Aufgabenschließungen möglich. Außerdem können Order eingestellt, geändert und gelöscht werden, jedoch sind auf keinen Fall Ausführungen möglich. Tagesgültige Order können an den Erfüllungstagen eingestellt werden, verfallen aber am gleichen Tag.

An den Erfüllungstagen können Geschäfte entstehen - aus Storno, händischen Geschäftseingaben der Makler und Aufgabenschließungen. Zwangsschließungen von CCP-Aufgaben werden aber technisch unterbunden.

Systemanschlussmakler erhalten an den Erfüllungstagen vor 9:00 Uhr den Broadcast "Unterbrechung der Börsenversammlung" (Subtype 054 BCBE_STOP_TRADE, siehe SAM-API-Beschreibung Abschnitt 2.1.26.1); die Wiederaufnahme erfolgt am nächsten Börsentag ohne eine besondere Nachricht.

Die folgenden Dialogfunktionen und die entsprechenden SAM-requests sind an den Erfüllungstagen gesperrt:

BxOS OM, KK, KA, TF, AE
BxNS EG, EV

2.2 Eingabezeiten

An den beiden Erfüllungstagen wird das Eingabeende für Geschäftseingaben auf 18:30 Uhr vorgezogen, danach beginnt der Buchungsschnitt.

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 Sonstiges

Die Übergabe von MiFID-Meldungen (SAM-request BC_ENTER_OTC_TRADE_RID) und deren Stornierung ist an Erfüllungstagen nicht möglich.

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).

Hinweis

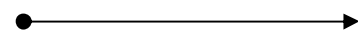
Wir beabsichtigen, zum 22. März 2010 die Kompensationsorder sowie die Geschäftsart "Kompensation" abzuschaffen.

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
z.B. 24.12.

Gültig
ab
28.12.