



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute Nr.93

&

Makler Nr. 68

XONTRO / Kreditinstitute
XONTRO / Makler

Newsletter Nr. 93
Newsletter Nr. 68

Dieser Newsletter informiert Sie über folgende Themen:

- Kreditinstitute:
 - Plausibilitäten bei der Longcode-Übergabe via Shortcode-File
- Skontroführende Makler
 - Generierte Eröffnungskurse
- Kreditinstitute und Makler
 - Ablauf am Jahresende
 - Systemzugang über das Jahresende hinaus

Disclaimer:

Bei dem hier versendeten Newsletter handelt es sich um keine Werbung, sondern um ergänzende Informationen zur Produktdokumentation hinsichtlich eines von der Firma BrainTrade Gesellschaft für Börsensysteme mbH, Börsenplatz 4, 60313 Frankfurt am Main betriebenen oder technisch erreichbaren Systems.

Dieser Newsletter wird daher nur an BrainTrade Systemnutzer bzw. deren Mitarbeiter sowie Dienstleister per E-Mail übermittelt.

Der Newsletterversand kann jederzeit per Mail an "trade(at)xontro.de" oder telefonisch unter +49-(0)69-589978-110 widerrufen werden.

1. Plausibilitäten bei der Longcode-Übergabe via Shortcode-File

Die Übermittlung von Longcodes im Rahmen des RTS 24 unterliegt gemäß dem MiFID II Regelwerk zeitlichen Beschränkungen.

Ab dem 02. Januar 2019 werden Longcodes, die via Shortcode-File übermittelt werden, nur noch an den auf den Entstehungstag folgenden zwei Abwicklungstagen entgegengenommen.

Später übermittelte Longcodes werden mit Returncode XO03001 „Invalid Report Day“ zurückgewiesen.

2. Generierte Eröffnungskurse (relevant für skontroführende Makler)

Derzeit existiert in XONTRO die Logik, dass in Instrumenten, die sowohl Kassa- als auch variabel notiert sind bei einer ersten Preisfeststellung zum Kassakurs von XONTRO automatisch ein „gestrichener Eröffnungskurs“ erzeugt und an die Kursverteilungssysteme CEF und WSS übertragen wird.

Für die skontroführenden Makler erscheint dieser generierte „gestrichen Kurs (EK)“ bisher sowohl in der Kurskette des Dialog-Orderbuches BROS/OM als auch in der Dialog-Kurskorrektur BROS/KU.

Ab dem 14. Januar 2019 wird unter den o.a. Bedingungen kein „gestrichen Kurs (EK)“ mehr erzeugt.

Der XONTRO-Systemanschluss Makler ist von der Änderung nicht betroffen.

3. Jahresende 2018

3.1 Überblick

Montag, 24. Dezember und Montag, 31. Dezember 2018 sind keine Börsentage, sondern Erfüllungstage. Die wesentlichen Besonderheiten an Erfüllungstagen werden im Folgenden unter 3.2 beschrieben.

Donnerstag, 27. Dezember und Freitag, 28. Dezember 2018 sind Börsentage. Am Donnerstag sind keinerlei Besonderheiten zu beachten. Am Freitag – dem Tag der Jahresschlussbörse – werden Kurse nur bis 14:00 Uhr festgestellt, der Buchungsschnitt wird an diesem Tag auf 18:30 Uhr vorgezogen.

Das Handling von tagesgültigen Orders sowie von Folgetagorders wird unter 3.3 beschrieben.

Im Übrigen wird auf die angehängte Tabelle verwiesen.

3.2 Erfüllungstage

3.2.1 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 jedoch vorgezogen.

Die Banken können alle Dialogmasken und das Orderrouting über die Systemanschlüsse nutzen. Orders können daher eingestellt, geändert und gelöscht werden, jedoch sind auf keinen Fall Ausführungen möglich. Tagesgültige Orders können an den Erfüllungstagen eingestellt werden, sie verfallen aber am gleichen Tag.

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

Systemanschlussbanken erhalten an den Erfüllungstagen vor 8:00 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.

3.2.2 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.

3.2.3 Abwicklung und Fristen

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

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

3.2.4 Leerfiles

Schlussnotendatenträger werden an den Erfüllungstagen versandt, auch für den Fall, dass sie bis auf Vor- und Endesatz leer sind.

Nach dem Buchungsschnitt werden zu den gewohnten Zeiten die dann noch fälligen stündlichen und viertelstündlichen Datenträger leer ausgeliefert.

XONTRO / Kreditinstitute
XONTRO / Makler

Newsletter Nr. 93

Newsletter Nr. 68

Das Kennzeichen „A – 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.

3.2.5 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.

3.3 Tagesgültige Orders / Folgetagorders

An Erfüllungstagen können Orders eingestellt werden. Tagesgültige Orders verfallen jedoch am gleichen Tag. Für die Gültigkeit von Folgetagorders wird auf die angehängte Tabelle verwiesen.

4. Systemberechtigung/Passwortänderungen

Bitte denken Sie rechtzeitig daran, die Systemzugangsberechtigungen Ihrer Mitarbeiter auch über das Jahresende hinaus sicher zu stellen.

Schematische Darstellung Jahreswechsel 2018/2019

	21.12. Fr	22.12. Sa	23.12. So	24.12. Mo	25.12. Di	26.12. Mi	27.12. Do	28.12. Fr	29.12. Sa	30.12. So	31.12. Mo	01.01. Di	02.01. Mi	03.01. Do
Börsentag / Erfüllungstag	Börsen- tag			Erfüllungs- tag			Börsen- tag	Börsen- tag			Erfüllungs- tag		Börsen- tag	Börsen- tag
Kursfeststellung	Ja			Nein			Ja	Ja**)			Nein		Ja	Ja
Buchungsschnitt	22:15			18:30*)			22:15	18:30*)			18:30*)		22:15	22:15
Fristen														
1)	ST			Sto			GV							
2)				ST			Sto	GV						
3)							ST	Sto			GV			
4)								ST			Sto		GV	
5)											ST		Sto	GV
6)													ST	Sto
7)														ST

ST Schlusstag
 Sto Storno
 GV Geldvaluta, Settlement

*) zugleich Eingabeende für Geschäftseingaben
 **) bis 14:00 Uhr

Schematische Darstellung Jahreswechsel 2018/2019 - Folgetagorder

