



Projekt Jahr 2000

Gesamtsimulation II

Simulationsskript

Teil I: Übersicht

Inhaltsverzeichnis

	Abkürzungsverzeichnis	3
1	Einleitung	4
1.1	Übersicht	4
1.2	Ablauf	4
1.3	Gliederung der Skripten	5
1.4	Skript Konventionen	8
2	Unterstützung durch die Gruppe Deutsche Börse / Eurex	9
2.1	Kontakt zur Gruppe Deutschen Börse / Eurex	9
2.2	Kommunikationskanäle	10
2.3	Dokumentation	11
3	Aufgaben der Teilnehmer	12
3.1	Allgemeines	12
3.2	Eingaben	12
3.3	Prüfungen	13
3.4	Readiness-Meldung	13
4	Geschäftsvorfälle	14
4.1	Übersicht	14
4.2	Kassamarkt	14
4.3	Terminmarkt	15
4.4	Abwicklung	16
5	Eckdaten zur Simulation	17
5.1	Teilnehmer der Simulation	17
5.2	Tagesablauf	18
5.3	Handelszeitplan	19
5.3.1	Kassamarkt	19
5.3.2	Terminmarkt	20
5.3.3	Abwicklung	21
5.4	Simulationskalender	22
6	Technische Informationen	24
6.1	Setup	24
6.2	Zugang zur Simulationsumgebung	24
6.3	Benutzerkennungen und Passwörter	25

6.4	Bestände	26
6.5	Gattungen / Produkte	27
6.5.1	Kassamarkt	28
6.5.2	Terminmarkt	29
6.5.3	Abwicklung	31
6.5.4	Änderungen WM-Testband	32
6.6	Reports	36
6.6.1	Reportarten	36
6.6.2	Kassamarkt	37
6.6.3	Terminmarkt	38
6.6.4	Abwicklung	39

Abkürzungsverzeichnis

Abkürzung	Erklärung
AKV	Auslandskassenverein
BP	Börsenplatz
CMTF	Cash Market Triggered Process
CTP	Clearing Triggered Process
DBC	Deutsche Börse Clearing
DMTF	Derivatives Market Triggered Process
FAQ	Frequently Asked Questions
GS	Girosammelverwahrung
ISIN	International Securities Identification Number
LZB	Landeszentralbank
OTC	Over the counter
SDS	Same Day Settlement
SONDPRO	Sonderprogramme Kapitaleidienste (Kapitalveränderungen)
STD	Standard Disposition
WKN	Wertpapierkennnummer
WM	Wertpapiermitteilungen
WSS	Wertpapier Service System
ZLK	Zahlungslieferungskauf
ZLV	Zahlungslieferungsverkauf

Simulationsskript	Jahr 2000 Projekt
Teil I: Übersicht	
	03.09.99
Einleitung	Seite I-4

1 Einleitung

Die Gruppe Deutsche Börse / Eurex will für ihre Kunden und sich selbst sicherstellen, dass der Übergang in das nächste Jahrtausend zu keinerlei Problemen in der geschäftlichen Abwicklung führt. Aus diesem Grund hat die Gruppe Deutsche Börse / Eurex ein Projekt aufgesetzt, das in mehreren Phasen entsprechende Massnahmen durchführt. Eine der Aktivitäten bildet die Jahr 2000 Gesamtsimulation II, welche die Gruppe Deutsche Börse / Eurex zusammen mit Ihren Teilnehmern durchführt.

Ziel der Jahr 2000 Simulationen ist die Sicherung der Geschäftsbereitschaft der Teilnehmer an Börsen- und Abwicklungssystemen über den Jahreswechsel 1999 hinaus. Dies wird durch Simulationen der betroffenen Kernsysteme mit Kundenschnittstellen im Hinblick auf Jahr 2000 Fähigkeit erreicht.

Im folgenden wird eine Übersicht über die Jahr 2000 Gesamtsimulation II und deren Ablauf gegeben, bevor die Struktur der vorliegenden Skripten und die Darstellungsconventionen erklärt werden.

1.1 Übersicht

Zur Vorbereitung auf den Jahreswechsel von 1999 auf 2000 bietet die Gruppe Deutsche Börse / Eurex ihren Teilnehmern im Oktober und November 1999 die Gesamtsimulation II an. Die Gesamtsimulation II umfasst die Kerngeschäftsprozesse der Gruppe Deutsche Börse / Eurex und erlaubt die durchgängige Überprüfung der Jahr 2000 Fähigkeit für den Jahreswechsel und den Schalltag auf Teilnehmerseite. Die Applikationen stehen mit ihrer vollen Funktionalität zur Verfügung.

Dabei werden sowohl die Handelssysteme für Kassa- und Terminmarkt als auch die Abwicklungssysteme in einer produktionsnahen Umgebung zur Verfügung stehen.

1.2 Ablauf

Die Gesamtsimulation II wird von Mittwoch, dem 20.10.1999 bis Freitag, dem 05.11.1999 stattfinden. Ein Geschäftstag (z.B. der 29.12.1999) wird an einem Kalendertag (z.B. dem 20.10.1999) simuliert. Weitere Details entnehmen Sie bitte dem Simulationskalender (Simulationsskript Teil I: Übersicht, Kapitel 5.4 Simulationskalender).

Xetra® steht jeweils von 08:00 - 12:00 Uhr, BOSS / BÖGA und die Abwicklungssysteme CASCADE und OLGA von 07:00 - 13:00 Uhr und Eurex® von 08:00 - 15:00 Uhr zur Verfügung. Die detaillierten Handelszeitpläne für die einzelnen Marktsegmente sind im Simulationsskript Teil I: Übersicht Kapitel 5.3 Handelszeitplan beschrieben.

Die Kerngeschäftsprozesse der Gruppe Deutsche Börse / Eurex bilden die Basis zur Erstellung der Geschäftsvorfälle, welche insgesamt den funktionalen Rahmen der Gesamtsimulation II ergeben. Auf Basis der Geschäftsvorfälle wurden die Simulationsskripten erstellt. Alle für die Simulation in den Skripten verwendeten Testgattungen wurden im Vorfeld mit den Wertpapiermitteilungen (WM) abgestimmt und für das Wertpapier-Service-System (WSS) zur Verfügung gestellt. Eine genaue Auflistung aller zur Simulation vorgesehenen Gattungen (als Bestandteil des WM Testbandes) für die einzelnen Marktbereiche befindet sich im Simulationsskript Teil I: Übersicht, Kapitel 6.5 Gattungen / Produkte.

1.3

Gliederung der Skripten

Die vorliegenden Skripten sind in fünf Teile gegliedert:

Titel	Inhalt
I Übersicht	Management Summary zur Jahr 2000 Gesamtsimulation II.
II Kassamarkt	Skript für Eingaben und Kontrollen von Geschäftsvorfällen, die aus dem Kassamarkt angestossen werden.
III Terminmarkt	Skript für Eingaben und Kontrollen von Geschäftsvorfällen, die aus dem Terminmarkt angestossen werden.
IV Abwicklung	Skript für Eingaben und Kontrollen von Geschäftsvorfällen, die aus der Abwicklung angestossen werden.
V Anhang	Detaillierte Darstellung der Geschäftsvorfälle, Glossar.

Tabelle 1: Gliederung der Simulationsskripten



Aufgrund der Durchführung der Jahr 2000 Simulation anhand von Geschäftsvorfällen enthalten das Simulationsskript Teil IV Abwicklung nicht ausschliesslich alle Aktivitäten, welche in den Abwicklungssystemen durchgeführt werden müssen. Sowohl das Simulationsskript Teil II: Kassamarkt als auch das Simulationsskript Teil III: Terminmarkt decken Aktivitäten in den Abwicklungssystemen ab. Diese Aktivitäten resultieren aus der Verarbeitung der in den Handelssystemen Xetra® und Eurex® getätigten Geschäfte.

Folgende Teilnehmergruppen werden in den Simulationsskripten unterschieden:

Teilnehmer	Bemerkungen
Xetra®	Aktivitäten im Skript Teil II: Kassamarkt
Parkett (Banken)	Aktivitäten im Skript Teil II: Kassamarkt
Makler	Aktivitäten im Skript Teil II: Kassamarkt
Eurex®	Aktivitäten im Skript Teil III: Terminmarkt
CASCADE	Aktivitäten im Skript Teil II: Kassamarkt Skript Teil III: Terminmarkt Skript Teil IV: Abwicklung
OLGA	Aktivitäten im Skript Teil II: Kassamarkt Skript Teil III: Terminmarkt Skript Teil IV: Abwicklung

Tabelle 2: Simulationsteilnehmer

Die Simulationsskripte richten sich an alle Teilnehmer der Gesamtsimulation II und enthalten die Simulationstätigkeiten pro Simulationstag in den Skriptteilen II, III und IV. Die Skripten sind nach Marktsegmenten und Simulationsteilnehmer gegliedert. Für jeden Simulationsteilnehmer wird anschliessend eine Untergliederung nach System und Geschäftstag vorgenommen. Jedes Kapitel beschreibt die durchzuführenden Aktivitäten (typischerweise Eingaben oder Kontrollen).

Drittparteien und Zentralverwahrer nehmen nicht an der Simulation teil, die Makler unterliegen gewissen Einschränkungen (Simulationsskript Teil I: Übersicht, Kapitel 5.1 Teilnehmer der Simulation).

Zu jeder Aktivität werden in den Skriptteilen II, III und IV bei der Beschreibung der Eingaben und Kontrollen der Simulationsaktivitäten die folgenden Attribute verwendet:

Attribut	Kurzbeschreibung
Aktivität	Beschreibung der Aktion, die durchgeführt werden soll. Dabei handelt es sich meist um eine spezielle Eingabe oder die Kontrolle einer Ausgabe.
ID	Jede Aktivität wird anhand einer Identifikationsnummer auf den zugrundeliegenden Geschäftsvorfall referenziert. Die Referenznummer enthält das Marktsegment des Geschäftsvorfalles (z.B. DMTP) sowie eine eindeutige Nummer für diesen Geschäftsvorfall (z.B. DMTP05). Pro Geschäftsvorfall wird eine ID vergeben. Dies ermöglicht das Nachvollziehen der Bearbeitung einzelner Aktivitäten eines Geschäftsvorfalles an unterschiedlichen Tagen. Beispielsweise erfolgt die Abwicklung eines Börsengeschäftes mit Eingabetag 29.12.1999 erst am 03.01.2000. Der Zusammenhang der Aktivitäten an diesen Tagen kann anhand der ID eindeutig nachvollzogen werden. Gleichzeitig wird auch im Anhang der chronologische Ablauf der Geschäftsvorfälle anhand der ID veranschaulicht (Simulationsskript Teil V: Anhang, Kapitel 2 Geschäftsvorfälle).
Gattungen / Produkte	Gattungen bzw. Produkte, die für eine Aktivität verwendet werden sollen. Im Terminmarkt werden die Produkte mit der zugehörigen ISIN aufgeführt, im Kassamarkt und in der Abwicklung die Gattungen mit der zugehörigen WKN. Sind mehrere Gattungen bzw. Produkte angegeben, sollte die Aktivität im Kassamarkt mindestens mit <i>einer</i> dieser Gattungen und im Terminmarkt mit <i>allen</i> aufgeführten Produkten durchgeführt werden.

Tabelle 3: Attribute der Aktivitäten

1.4

Skript Konventionen

Im Skript werden folgende Symbole verwendet:



Fokus / Schwerpunkt der unten beschriebenen Tätigkeiten für den jeweiligen Simulationstag.



Simulationszeiten.
Geschäftsdatum.



Wichtige Informationen für die Simulationsteilnehmer.

2**Unterstützung durch die Gruppe Deutsche Börse / Eurex**

Die Gruppe Deutsche Börse / Eurex bietet den Teilnehmern ein breites Spektrum an Unterstützung während der Teilnahme an der Jahr 2000 Gesamtsimulation II an. Im folgenden wird das Betreuungskonzept kurz erläutert. Zudem wird auf die Kommunikationskanäle zur Vermittlung von Informationen an die Teilnehmer und auf weiterführende Dokumentation eingegangen.

2.1**Kontakt zur Gruppe Deutschen Börse / Eurex**

Zentraler Ansprechpartner ist das Year 2000 Coordination Center der Gruppe Deutsche Börse / Eurex:

Medium	Kontaktinformationen	Öffnungszeiten Simulationstagen)	(an
Telefon	+49 / (0)69 / 21 01 33 00	06:45 – 20:00	
Fax	+49 / (0)69 / 21 01 33 01		
Email	YEAR2000@Exchange.de		
Internet	www.Y2K.Exchange.de		
Adresse	Deutsche Börse AG Year 2000 Coordination Center D-60284 Frankfurt am Main		

Tabelle 4: Kontakt zur Gruppe Deutsche Börse / Eurex

2.2

Kommunikationskanäle

Folgende Kommunikationskanäle werden vom Jahr 2000 Simulationsteam vor, während und nach der Gesamtsimulation II zur Informationsübermittlung an die Teilnehmer benutzt. Jegliche Kommunikation per Post oder Fax ist an den Jahr 2000 Koordinator Ihres Instituts adressiert.

Name	Inhalt	Frequenz	Medium
Special 2000	Aktuelle Informationen aus dem Jahr 2000 Projekt	Alle 4–6 Wochen, nach Bedarf	Post, Internet
Rundfax	Zeitkritische, wichtige Informationen während der Simulation	nach Bedarf	FAX
Xetra®: High Priority News	Wichtige Kurzinformationen zu Xetra® während der Simulation	nach Bedarf	Online: Message Log Fenster
Eurex®: Newsboard	Wichtige Kurzinformationen zu Eurex® während der Simulation	nach Bedarf	Online: D050 Newsboard Inquiry / Select
Online-Nutzer Information	Wichtige Kurzinformationen zu den Parkett- und Abwicklungssystemen während der Simulation	nach Bedarf	Online: DIIN IY

Tabelle 5: Kommunikationskanäle zu den Teilnehmern

2.3

Dokumentation

Die Gesamtsimulation II wird – wie bereits die Gesamtsimulation I – durch Simulationsskripte unterstützt. Diese legen die Mindestaktivitäten fest, die zur Abdeckung der teilnehmerrelevanten Kerngeschäftsprozesse der Gruppe Deutsche Börse / Eurex erforderlich sind.

Neben Skripten, die durch die Geschäftsvorfälle führen, stehen ergänzende Dokumentationen, wie z.B. die bekannten Handbücher, sowie das Year 2000 Coordination Center und die Member Readiness Teams von Xetra® und Eurex® zur Verfügung. Aus dem Jahr 2000 Projekt kann folgende Dokumentation herangezogen werden:

Name	Kurzbeschreibung
Simulationsleitfaden	Überblick über Ziele und Vorgehensweise der Simulation sowie den technischen und funktionalen Setup.
Leitfaden zur technischen Anbindung	Informationen zur technischen Anbindung der Systeme an die Simulationsumgebung der Börse.
Special 2000	Aktuelle Informationen aus dem Jahr 2000 Projekt sind den Specials zu entnehmen.
Spezifikation zur technischen Anbindung	Informationen zur Planung, Vorbereitung und Durchführung des Konnektierungstests.
Frequently Asked Questions (FAQs)	Die am häufigsten gestellten Fragen an das Jahr 2000 Simulationsteam.

Tabelle 6: Dokumentationen aus dem Jahr 2000 Projekt

Alle diese aufgeführten Dokumentationen sind im Internet (www.Y2K.Exchange.de) in der Download Area der Member Area verfügbar.

3 Aufgaben der Teilnehmer

In diesem Kapitel werden die Aufgaben der Simulationsteilnehmer bezüglich der Eingaben und Kontrollen während der Simulation kurz dargestellt. Ferner wird erläutert, wie das Jahr 2000 Projekt die Readiness der Teilnehmer verfolgen und bewerten wird.

3.1 Allgemeines

Die vorliegenden Skripten bieten eine Hilfestellung zur zeitgerechten Eingabe und Kontrolle verschiedener Jahr 2000 relevanter Geschäftsvorfälle. Der Schwerpunkt liegt dabei auf einer systemübergreifenden Verfolgung der Geschäftsvorfälle, beginnend bei den Handelssystemen bis hin zu den Abwicklungssystemen. Den Teilnehmern bleibt freigestellt, auch andere Geschäftsvorfälle zu simulieren, sei es zu Schulungszwecken oder zur Verifikation der Inhouse-Systeme und –Prozesse. Die Gruppe Deutsche Börse / Eurex empfiehlt die Ergänzung um teilnehmerspezifische Geschäftsvorfälle.

3.2 Eingaben



Bei den Eingaben ist darauf zu achten, dass mindestens die in den Simulationsskripten aufgeführten Aktivitäten durchgeführt werden. Dazu sollen die im Simulationsskript aufgeführten Gattungen bzw. Produkte verwendet werden. **Die im Skript verwendeten Gattungen bzw. Produkte sind die Grundlage für die Prüfung des Teilnahmeerfolges.** Die Wertpapierkennnummern sind ein zentrales Erkennungsmerkmal für unsere Ergebnisstatistik. Wir bitten Sie deshalb, die vorgegebenen Wertpapierkennnummern ausschliesslich für die in den Skripten beschriebenen Geschäftsvorfälle zu nutzen.

Selbstverständlich ist es den Teilnehmern freigestellt und empfohlen, zusätzliche Eingaben mit anderen Gattungen bzw. Produkten vorzunehmen. Die folgenden Grundsätze gelten für alle Teile des vorliegenden Skripts:

Name	Kurzbeschreibung
Market Maker / Designated Sponsor:	Die Market Maker / Designated Sponsor Funktionen werden von den Teilnehmern analog zum Produktionsbetrieb übernommen.
OTC-Geschäfte:	OTC-Geschäfte sprechen die Teilnehmer miteinander ab (Xetra®, Eurex®, BÖGA, CASCADE, OLGA).
Börsengeschäfte	Die Teilnehmer sollten sowohl Kauf- und Verkauforders eingeben, um Matching zu ermöglichen.

Tabelle 7: Grundsätze für Simulationseingaben

3.3

Prüfungen

Die Resultate der einzelnen Simulationsaktivitäten sollten vom Simulationsteilnehmer überprüft und mit den eigenen Inhouse-Systemen abgeglichen werden. Die vorzunehmenden Prüfungen sind in den Skripten vermerkt. Kontrolldokumente, die während der Simulation standardmässig an die Simulationsteilnehmer versandt werden, sind im Simulationsskript Teil I: Übersicht, Kapitel 6.6 Reports mit detaillierten Angaben zur Art und Weise der Übermittlung aufgeführt.

3.4

Readiness-Meldung

Nach Abschluss der Gesamtsimulation II wird für jeden Simulationsteilnehmer, der an den vorangegangenen Simulationen nicht oder nicht erfolgreich teilgenommen hat, ein „Testprotokoll“ vom Jahr 2000 Simulationsteam erstellt, auf dem die Gruppe Deutsche Börse / Eurex dem Teilnehmer ihre Einschätzung zum Erfolg seiner Aktivitäten während der Simulation kommuniziert. Die Teilnehmer werden gebeten, das dargestellte Ergebnis mit der internen Einschätzung abzugleichen.

Voraussetzung für eine erfolgreiche Teilnahme ist, dass die Simulationsteilnehmer die in den Skripten aufgeführten Geschäftsvorfälle komplett ausgeführt haben.

In einer dem Testprotokoll angehängten Erklärung übermitteln die Teilnehmer ihre Sicht zum Verlauf der Simulation und erklären gegebenenfalls ihre Systeme mit Unterschrift ihrer Geschäftsführung für „Jahr 2000 ready“.

4 Geschäftsvorfälle

Für die einzelnen Marktsegmente Kassamarkt, Terminmarkt und Abwicklung wird anschliessend ein kurzer Überblick über die zu simulierenden Geschäftsvorfälle gegeben.

4.1 Übersicht

Die Geschäftsvorfälle decken die Kerngeschäftsprozesse der Gruppe Deutsche Börse / Eurex mit Ihren Teilnehmern ab. In den Skriptteilen II, III und IV werden die Geschäftsvorfälle für jedes Marktsegment nach Geschäftstag und Eingabesystem detailliert beschrieben. Zum besseren Verständnis sind daher alle Geschäftsvorfälle im Simulationsskript Teil V: Anhang, Kapitel 2 Geschäftsvorfälle im chronologischen Ablauf dargestellt.

4.2 Kassamarkt

Im Marktsegment Kassamarkt werden die Kernprozesse des Parketthandels und des elektronischen Börsenhandels simuliert. Die Eingabe und die Prüfung von Börsenaufträgen steht für die Teilnehmer im Mittelpunkt der Aktivitäten. Für alle drei Eingabesysteme (BOSS, BÖGA und Xetra®) werden Börsengeschäfte vor und nach dem Jahreswechsel bzw. dem Schalttag getätigt. Die Abwicklung der Börsengeschäfte beansprucht zwei Tage und wird in den Folgesystemen des Kassamarktes und der Abwicklung nachvollzogen. Die Prüfung erfolgt online bzw. anhand von vorgegebenen Listen und Reports.

Relevant sind insgesamt 35 Geschäftsvorfälle für die folgenden Systeme:

BOSS:

Die Kursfeststellung in den vier Gattungen, die im Simulationsskript verwendet werden, wird intern durch die Deutsche Börse vorgenommen. Zur Überprüfung der Abwicklung von Geschäften aus BOSS sind die Teilnehmer des Parketts (Banken) dringend angehalten, nur diese Gattungen zu verwenden.

Die teilnehmenden Makler geben Orders auf Rechnung von zwei speziell aufgesetzten Testbanken pro Börsenplatz ein. Sie können für die gleichen Gattungen wie im Produktionsbetrieb Geschäfte tätigen. Analog können sie für alle Gattungen Kurse feststellen, allerdings mit Ausnahme der von der Gruppe Deutsche Börse / Eurex intern betreuten Gattungen. Die Prüfung der Verarbeitung erfolgt auf der Basis vorgegebener Listen und Reports.

BÖGA:

Die Eingabe von Bankdirektgeschäften inklusive Ausübung der Stornofunktion steht für Kreditinstitute im Vordergrund der Simulation. Die Teilnehmer handeln wie im Produktionsbetrieb, d.h. sie stimmen die Geschäfte eigenverantwortlich untereinander ab. Die Weiterverarbeitung der Geschäfte wird anhand von vorgegebenen Listen und Reports verfolgt.

Die teilnehmenden Makler geben Geschäfte auf Rechnung von zwei speziell für sie pro Börsenplatz aufgesetzten Testbanken ein. Sie können für die gleichen Gattungen wie im Produktionsbetrieb, ausser den vier für die Kursfeststellung Reservierten, Geschäfte tätigen.

Xetra[®]:

In Xetra werden durch die Teilnehmer Börsengeschäfte um den Jahreswechsel und den Schalttag getätigt. Ferner sind OTC-Geschäfte und Stop Orders einzugeben. Die Weiterverarbeitung wird analog zum Parketthandel online bzw. anhand von vorgegebenen Reports überprüft.

4.3**Terminmarkt**

Im Marktsegment Terminmarkt werden 40 Geschäftsvorfälle simuliert.

Hauptmerkmal der Eurex[®] Gesamtsimulation ist die Prüfung der Kernfunktionalität. Diese besteht aus Geschäftsvorfällen, die Eurex[®]-intern sowie systemübergreifend sind.

Im Eurex[®] System wird die Auftragseingabe, das Matching und Posting, das Trade Management und die Durchführung von Ausübungen getestet. Dabei sollen Geschäftsvorfälle vor und nach dem Jahreswechsel bzw. dem Schalttag durchgeführt werden. Die Geschäftsvorfälle umfassen alle Options- sowie Futures-Typen. Die Funktionalität von Spezialfällen wie Stop Orders, Quotes, Block Trades und Basis Trades wird explizit im Jahr 2000 und am Schalttag getestet. Auf Wunsch werden den Teilnehmern Reports zur Verfügung gestellt, die zur Überprüfung der korrekten Verarbeitung der Eingaben dienen.

Die physische Belieferung von ausgeübten inländischen Aktienoptionen sowie die Hinterlegung von inländischen Sicherheiten bei den Abwicklungssystemen sind Geschäftsvorfälle, die mit CASCADE auch ein System ausserhalb von Eurex[®] betreffen. Ziel ist, mit allen Abwicklungsteilnehmern die physische Belieferung sowie die Sicherheitenhinterlegung im Austausch mit den Abwicklungssystemen zu testen. Es sollen Positionen im Jahr 1999 ausgeübt und im Jahr 2000 physisch beliefert werden. Zudem wird der korrekte Betrieb für das physische Settlement im Jahr 2000 getestet. Bei der Sicherheitshinterlegung wird die korrekte Einbuchung und Verarbeitung von eingelieferten inländischen Gattungen in den Abwicklungssystemen im Jahr 1999 und im Jahr 2000 sowie die korrekte Verarbeitung der Fälle in Eurex[®] im Jahr 2000 getestet. Analog zum Jahresende wird die gleiche Funktionalität um den Schalttag in der Gesamtsimulation II getestet.

Kontrollinstrumente für die Teilnehmer sind Ausübungs- und Regulierungsdatenträger aus den Abwicklungssystemen sowie Reports aus Eurex[®].

4.4

Abwicklung

Im Marktsegment Abwicklung werden 26 Geschäftsvorfälle in den folgenden Systemen simuliert:

CASCADE OTC:

Bei den OTC-Geschäften in CASCADE ist die Einstellung von Geschäften mit und ohne Gegenwert Schwerpunkt der Aktivitäten. Dabei sollen vom Teilnehmer sowohl Aufträge in 1999 als auch im Jahr 2000 eingestellt werden. Für die Simulation des Jahreswechsels werden die in 1999 eingestellten Aufträge als Schwebegeschäft mit Erfüllung im Jahr 2000 getestet. Zusätzlich wird die Übernahme von Geschäften in 1999 im Erfassungsstatus ins Jahr 2000 getestet. Für die Simulation des Schalttages sind die Valuta-Vorgaben so gestaltet, dass Aufträge am und nach dem Schalttag zur Erfüllung anstehen. Gegenstand der Simulation sind Geschäfte, die mittels STD und SDS reguliert werden.

CASCADE / Kapitalgutschriften und –veränderungen:

Testinhalt ist die korrekte Ermittlung, Berechnung und Buchung der Geld- bzw. Stückeumsätze aufgrund von Kapitalgutschriften und –veränderungen für GS verwahrte Gattungen. Im Bereich Kapitalgutschriften wird eine Dividendenzahlung sowie eine Kapitalfälligkeit zu Beginn des Jahres 2000 simuliert. Offene OTC-Geschäfte werden aufgrund von Kapitalveränderungen angepasst. Zusätzlich wird die korrekte Ausgleichsbuchung zwischen Käufer und Verkäufer bei Dividendenzahlungen auf offene CASCADE-Geschäfte Testinhalt sein. Für den Schalttag sind im Skript keine Vorgaben gemacht.

OLGA:

Bei den OTC-Geschäften in OLGA ist die Einstellung von Geschäften mit und ohne Gegenwert Schwerpunkt der Aktivitäten. Dabei sollen vom Teilnehmer sowohl Aufträge in 1999 als auch im Jahr 2000 eingestellt werden. Weitere Aufträge sollen am Schalttag bzw. mit Valuta des Schalttags eingegeben werden. Zusätzlich wird die Übernahme von Geschäften in 1999 im Erfassungsstatus ins Jahr 2000 getestet. Simuliert werden nur Überträge zwischen AKV-Teilnehmern.

Die in OLGA simulierten Geschäfte (Überträge zwischen AKV-Teilnehmern) werden nur im Ausnahmefall dem Tagesgeschäft des Teilnehmers entsprechen. Wir bitten alle Simulationsteilnehmer dennoch, die Geschäfte einzustellen. Die Gruppe Deutsche Börse / Eurex hat mit Euroclear und CEDEL bereits bilaterale Tests durchgeführt, um die Jahr 2000 Fähigkeit dieser Funktionalität sicherzustellen. Deshalb wird der Normalfall der Wertpapierüberträge gegen Zahlung (ZLV und ZLK) nicht in die Teilnehmersimulation mit einbezogen.

5 Eckdaten zur Simulation

In diesem Kapitel wird ein Überblick über organisatorische Eckdaten der Simulation gegeben. Darin enthalten sind die verschiedenen Simulationsteilnehmer, der Tagesablauf und die Handelszeiten sowie der komplette Simulationskalender für die Gesamtsimulation II.

5.1 Teilnehmer der Simulation

In der nachfolgenden Tabelle werden die Geschäftspartner der Gruppe Deutsche Börse / Eurex in Bezug auf die Teilnahme an der Gesamtsimulation II aufgeführt.

Teilnehmer	Beschreibung
Banken:	Als Teilnehmer der Handels- und Abwicklungssysteme
Makler:	Als Teilnehmer des Parketts (mit gewissen Einschränkungen, siehe unten)

Tabelle 8: Funktionale Teilnehmergruppen der Gesamtsimulation II



Makler können Geschäfte im Namen von Testbanken tätigen. Pro Börsenplatz werden jeweils zwei Testbanken (KV-Nummern: 1035, 1037, 2061, 2062, 3120, 3121, 3338, 3339, 4123, 4125, 6049, 6052, 7095, 7099, 8058, 8059) eingerichtet. Für die vier in der Simulation in BOSS verwendeten Gattungen findet die Kursfeststellung intern statt, d.h. die produktiv skontroführenden Makler können für diese Gattungen an allen Börsenplätzen keine Kurse feststellen. **Makler werden dringend gebeten, nicht im Namen anderer Simulationsteilnehmer Geschäfte durchzuführen.** Dies ist notwendig, um eine korrekte Überprüfung der Simulationsaktivitäten pro Simulationsteilnehmer zu gewährleisten. Die Abwicklung der durch die Makler getätigten Geschäfte wird vernachlässigt.

5.2

Tagesablauf

Xetra® steht jeweils von 08:00 – 12:00 Uhr, BOSS / BÖGA und die Abwicklungssysteme CASCADE und OLGA von 07:00 – 13:00 Uhr und Eurex® von 08:00 – 15:00 Uhr online zur Verfügung. Die Reports aus den Systemen erhalten Sie im Falle der Handelsapplikationen Xetra® und Eurex® auf üblichem Wege. Für die Mainframe Applikationen gelten die während der technischen Konnektierung getroffenen Vereinbarungen.

Uhrzeit	Art	System	Beschreibung
08:00 – 12:00	Online	Xetra®	Xetra®
07:00 – 13:00	Online	Parkett	BOSS / BÖGA
07:00 – 13:00	Online	Clearing	CASCADE / OLGA
08:00 – 15:00	Online	Terminmarkt	Eurex®
Ab 09:00	Batch	Clearing	1. SDS-Lauf (inkl. LZB Buchungsschnitt)
Ab 10:30	Batch	Clearing	2. SDS-Lauf (inkl. LZB Buchungsschnitt)
Ab 14:00	Batch	Clearing	STD-Lauf
14:00 – 15:00	File Transfer	Kassamarkt	Versand BÖGA / Xetra® Schlussnoten
14:00 – 20:00	File Transfer	Clearing	Versand Regulierungsdatenträger (Buchungen per heute aus 1. SDS, 2. SDS und STD)
20:00	File Transfer	Xetra®	Versand Xetra® Reportdateien (über Xetra®-Netz)
21:00	File Transfer	Eurex®	Versand Eurex® Reportdateien (über Eurex®-Netz)

Tabelle 9: Tagesablauf Gesamtsimulation II

5.3 Handelszeitplan

Für die drei Marktsegmente wird im folgenden auf die einzelnen Handelszeitpläne eingegangen.

5.3.1 Kassamarkt

Auf dem Parkett findet eine Kursfeststellung nur für die Geschäftstage vom 30.12.1999, 03.01.2000, 28.02.2000 und 29.02.2000 statt, wobei am 30.12.1999 und am 28.02.2000 die Kursfeststellung nur für den Börsenplatz Frankfurt durchgeführt wird. Die Kursfeststellung der vier in der Simulation in BOSS verwendeten Gattungen (WKN: 103001, 604843, 877355, 900304) wird durch die Deutsche Börse vorgenommen. Hierfür werden die folgenden KV-Nummern verwendet: 1390, 2265, 3801, 3893, 4296, 6299, 7659 und 8800.



Die Makler dieser vier Gattungen, für welche eine Kursfeststellung durchgeführt wird, können während der gesamten Simulation für diese Gattungen keine Kursfeststellung vornehmen. Ansonsten sind die Makler angehalten, für ihre Gattungen die Kursfeststellung durchzuführen.

Der Handelszeitplan für das Parkett mit dem Handelssystem BOSS hat die folgende Ausgestaltung. Die erste Kursfeststellung entspricht dem Eröffnungskurs und die zweite Kursfeststellung dem Kassakurs:

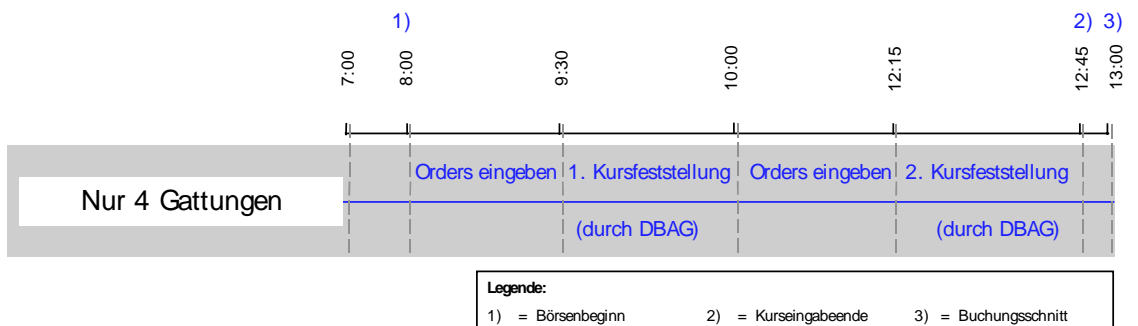


Abbildung 1: Handelszeitplan BOSS

In BÖGA ergibt sich der Handelszeitplan aus den Online-Zeiten der Simulation:

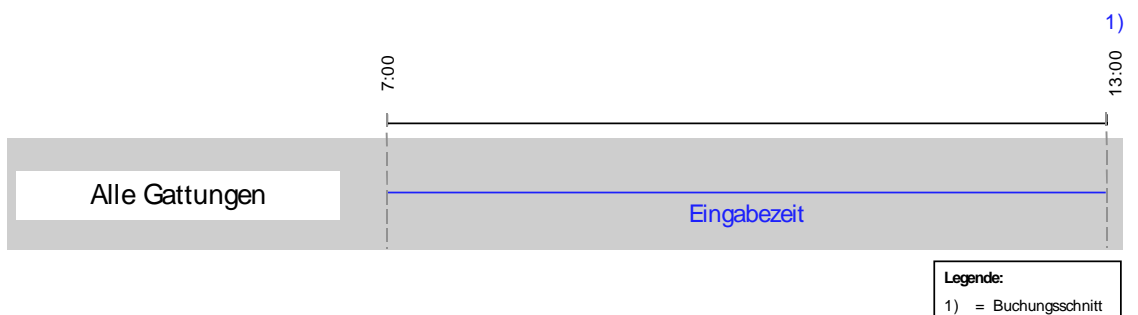


Abbildung 2: Handelszeitplan BÖGA

Der Handelszeitplan für den Xetra® Handel hat die folgende Ausgestaltung:

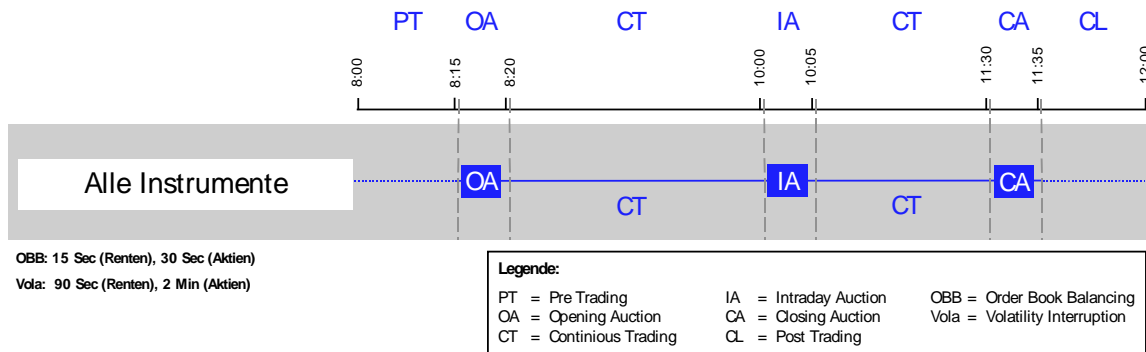


Abbildung 3: Handelszeitplan Xetra®

5.3.2

Terminmarkt

Die folgende Abbildung zeigt den Zeitplan für den Handel im Handelssystem Eurex® während der Gesamtsimulation II. Generell wird auf eine halbe Stunde Vorhandelszeit eine Pre-Opening Periode folgen, die für alle Produkte gleichermassen ca. 10 Minuten dauert.

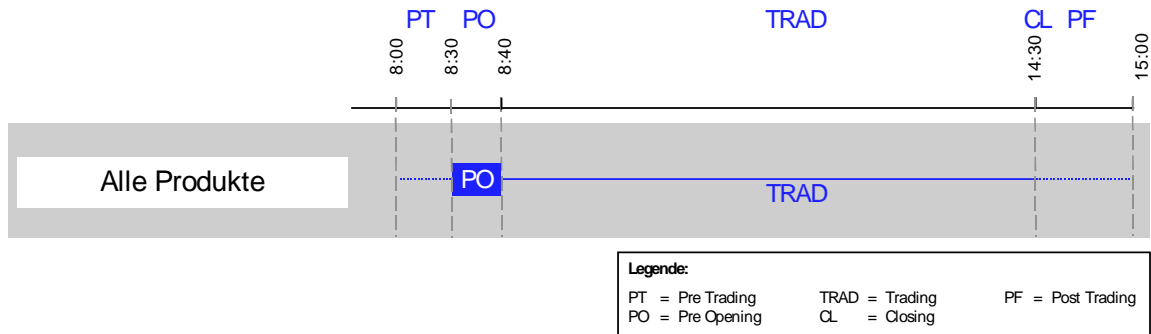


Abbildung 4: Handelszeitplan Eurex®

5.3.3

Abwicklung

In der Abwicklung sind in CASCADE die SDS Läufe über die Online-Zeit verteilt, und bei OLGA ergibt sich der Handelszeitplan aus den Online-Zeiten der Simulation.

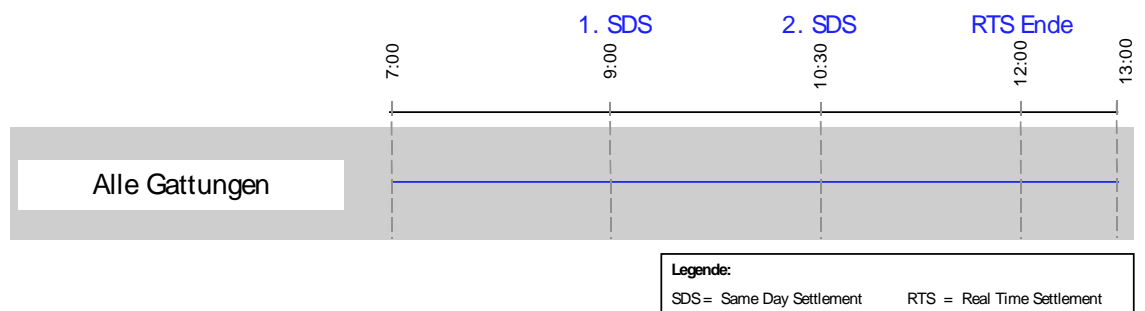


Abbildung 5: Handelszeitplan CASCADE

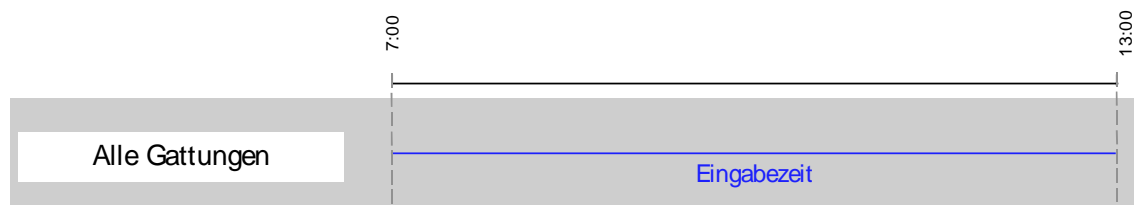


Abbildung 6: Handelszeitplan OLGA

5.4

Simulationskalender

Auf den folgenden Seiten wird der Simulationskalender für die Gesamtsimulation II mit dem geplanten Tagesablauf dargestellt. Zur Erleichterung des Jahreswechsels wird davon ausgegangen, dass der 31.12.1999 im deutschen Markt als Bankfeiertag gilt.

Gesamtsimulation II: Vorbereitungswoche							
	Montag 11.10.	Dienstag 12.10.	Mittwoch 13.10.	Donnerstag 14.10.	Freitag 15.10.	Samstag 16.10.	Sonntag 17.10.
Geschäftsdatum							
Xetra®							
BOSS / BÖGA							
Clearing							
Eurex®	keine	keine	keine	keine	keine		
Batches	Simulation	Simulation	Simulation	Simulation	Simulation		
	Konnektierungs- tests	Konnektierungs- tests	Konnektierungs- tests	Konnektierungs- tests	Konnektierungs- tests		
Besonder- heiten	Vorbereitung Systeme	Vorbereitung Systeme	Vorbereitung Systeme	Vorbereitung Systeme	Vorbereitung Systeme		

Gesamtsimulation II: 1. Simulationswoche							
	Montag 18.10.	Dienstag 19.10.	Mittwoch 20.10.	Donnerstag 21.10.	Freitag 22.10.	Samstag 23.10.	Sonntag 24.10.
Geschäftsdatum			29.12.1999	30.12.1999	31.12.1999	01.01.2000	02.01.2000
Xetra®			08:00 - 12:00	08:00 - 12:00			
BOSS / BÖGA			07:00 - 13:00	07:00 - 13:00			
Clearing			07:00 - 13:00	07:00 - 13:00			
Eurex®	keine	keine	08:00 - 15:00	08:00 - 15:00	keine	keine	keine
Batches	Simulation	Simulation	Kassamarkt ab 12:00 Terminmarkt ab 16:00 Clearing 1. SDS-Lauf, Valuta 29.12. ab 09:00 Clearing 2. SDS-Lauf, Valuta 29.12. ab 10:30 Clearing STD-Lauf, Valuta 30.12. ab 14:00 Clearing Ausland ab 14:00	Kassamarkt ab 12:00 Terminmarkt ab 16:00 Clearing 1. SDS-Lauf, Valuta 30.12. ab 09:00 Clearing 2. SDS-Lauf, Valuta 30.12. ab 10:30 Clearing STD-Lauf, Valuta 03.01. ab 14:00 Clearing Ausland ab 14:00	Simulation	Simulation	Simulation
Besonder- heiten	Vorbereitung Systeme	Vorbereitung Systeme		Jahresende	Jahresende		

Abbildung 7: Simulationskalender GS II, 11.10.1999 – 24.10.1999

Gesamtsimulation II: 2. Simulationswoche							
	Montag 25.10.1999	Dienstag 26.10.1999	Mittwoch 27.10.1999	Donnerstag 28.10.1999	Freitag 29.10.1999	Samstag 30.10.1999	Sonntag 31.10.1999
Geschäftsdatum	03.01.2000	04.01.2000	05.01.2000		25.02.2000		
Xetra®	08:00 - 12:00	08:00 - 12:00	08:00 - 12:00		08:00 - 12:00		
BOSS / BÖGA	07:00 - 13:00	07:00 - 13:00	07:00 - 13:00		07:00 - 13:00		
Clearing	07:00 - 13:00	07:00 - 13:00	07:00 - 13:00		07:00 - 13:00		
Eurex®	08:00 - 15:00	08:00 - 15:00	08:00 - 15:00		08:00 - 15:00		
Batches	Kassamarkt ab 12:00 Terminmarkt ab 16:00	Kassamarkt ab 12:00 Terminmarkt ab 16:00	Kassamarkt ab 12:00 Terminmarkt ab 16:00	keine Simulation	Kassamarkt ab 12:00 Terminmarkt ab 16:00		
	Clearing 1. SDS-Lauf, Valuta 03.01. ab 09:00	Clearing 1. SDS-Lauf, Valuta 04.01. ab 09:00	Clearing 1. SDS-Lauf, Valuta 05.01. ab 09:00		Clearing 1. SDS-Lauf, Valuta 25.02. ab 09:00		
	Clearing 2. SDS-Lauf, Valuta 03.01. ab 10:30	Clearing 2. SDS-Lauf, Valuta 04.01. ab 10:30	Clearing 2. SDS-Lauf, Valuta 05.01. ab 10:30		Clearing 2. SDS-Lauf, Valuta 25.02. ab 10:30		
	Clearing STD-Lauf, Valuta 04.01. ab 14:00	Clearing STD-Lauf, Valuta 05.01. ab 14:00	Clearing STD-Lauf, Valuta 06.01. ab 14:00		Clearing STD-Lauf, Valuta 28.02. ab 14:00		
	Clearing Ausland ab 14:00	Clearing Ausland ab 14:00	Clearing Ausland ab 14:00		Clearing Ausland ab 14:00		
Besonderheiten				Umstellung			

Gesamtsimulation II: 3. Simulationswoche							
	Montag 01.11.1999	Dienstag 02.11.1999	Mittwoch 03.11.1999	Donnerstag 04.11.1999	Freitag 05.11.1999	Samstag 06.11.1999	Sonntag 07.11.1999
Geschäftsdatum		28.02.2000	29.02.2000	01.03.2000	02.03.2000		
Xetra®		08:00 - 12:00	08:00 - 12:00	08:00 - 12:00	08:00 - 12:00		
BOSS / BÖGA		07:00 - 13:00	07:00 - 13:00	07:00 - 13:00	07:00 - 13:00		
Clearing		07:00 - 13:00	07:00 - 13:00	07:00 - 13:00	07:00 - 13:00		
Eurex®	keine	08:00 - 15:00	08:00 - 15:00	08:00 - 15:00	08:00 - 15:00		
Batches	Simulation	Kassamarkt ab 12:00 Terminmarkt ab 16:00	Kassamarkt ab 12:00 Terminmarkt ab 16:00	Kassamarkt ab 12:00 Terminmarkt ab 16:00	Kassamarkt ab 12:00 Terminmarkt ab 16:00	Simulation	
		Clearing 1. SDS-Lauf, Valuta 28.02. ab 09:00	Clearing 1. SDS-Lauf, Valuta 29.02. ab 09:00	Clearing 1. SDS-Lauf, Valuta 01.03. ab 09:00	Clearing 1. SDS-Lauf, Valuta 02.03. ab 09:00		
		Clearing 2. SDS-Lauf, Valuta 28.02. ab 10:30	Clearing 2. SDS-Lauf, Valuta 29.02. ab 10:30	Clearing 2. SDS-Lauf, Valuta 01.03. ab 10:30	Clearing 2. SDS-Lauf, Valuta 02.03. ab 10:30		
		Clearing STD-Lauf, Valuta 29.02. ab 14:00	Clearing STD-Lauf, Valuta 01.03. ab 14:00	Clearing STD-Lauf, Valuta 01.03. ab 14:00	Clearing STD-Lauf, Valuta 03.03. ab 14:00		
		Clearing Ausland ab 14:00	Clearing Ausland ab 14:00	Clearing Ausland ab 14:00	Clearing Ausland ab 14:00		
Besonderheiten	Feiertag					Ende	

Abbildung 8: Simulationskalender GS II, 25.10.1999 – 07.11.1999

6 Technische Informationen

Generelle technische Informationen zur Gesamtsimulation II sind Bestandteil dieses Kapitels. Zuerst wird auf die allgemeinen Setup-Aktivitäten eingegangen, bevor der Zugang zur Simulationsumgebung und die verwendete Systematik für Benutzerkennungen und Passwörter erläutert wird. Anschliessend folgt eine komplette Liste der in den Skripten für jeden Marktbereich verwendeten Gattungen bzw. Produkte. Die Vorgehensweise zum Aufbau zusätzlicher Bestände für diese Gattungen sowie weitere Informationen zu den Kontrolldokumenten schliessen dieses Kapitel ab.

6.1 Setup

Am 08. Oktober 1999 werden nach dem Abschluss der Tagesendverarbeitung seitens der Gruppe Deutsche Börse / Eurex Sicherungen erstellt, die im folgenden als Basis des Datenbestandes in IMS24 während der Gesamtsimulation II genutzt werden.

Insbesondere werden für die Abwicklungsapplikationen die Depotbestände (Inland / Ausland) sowie die Geldbestände (Ausland) gesichert.

Bitte nehmen Sie entsprechende Sicherungen Ihrer Bestände vor, damit bei Simulationsbeginn die Bestände auf Teilnehmerseite und Gruppe Deutsche Börse / Eurex übereinstimmen.

Weitere Informationen zu Bestandsveränderungen für die Simulationsgattungen finden Sie im Simulationsskript Teil I: Übersicht, Kapitel 6.4 Bestände.

6.2 Zugang zur Simulationsumgebung

Generell hat die Gruppe Deutsche Börse / Eurex für alle Jahr 2000 Simulationen eine gesonderte Umgebung auf jeder benutzten Rechnerplattform vorgesehen. Für die Simulationen der Handelsapplikationen Eurex® und Xetra® werden die jeweiligen permanenten Simulationsumgebungen genutzt. Für die Mainframe Applikationen der Parkett- und Abwicklungssysteme steht ein dedizierter Grossrechner zur Verfügung.

Im Rahmen der Konnektierungstests wurde der Zugang zu diesem Grossrechner (IMS24) als Voraussetzung zur Teilnahme getestet. Für Xetra® und Eurex® werden die bekannten permanenten Simulationsumgebungen verwendet, daher sind keine weiteren Schritte für die Anbindung notwendig.

Weiterführende Informationen können dem „Leitfaden zur technischen Anbindung“ und den „Spezifikationen zur technischen Anbindung“ entnommen werden, die auch im Internet verfügbar sind.

6.3

Benutzerkennungen und Passwörter

Die Benutzerkennungen und Passwörter in den permanenten Simulationsumgebungen von Xetra® und Eurex® bleiben unverändert.

Für das SNA Order Routing gelten ebenfalls die Benutzerkennungen und Passwörter, die in früheren Kassamarktsimulationen aufgesetzt wurden.

Die Benutzerkennung, das Benutzerprofil und die Passwörter (numerisch) für alle MVS-Applikationen wurden bereits zur Gesamtsimulation I für alle Teilnehmer neu aufgesetzt. Diese Benutzerkennungen und Passwörter bleiben für die Gesamtsimulation II erhalten. Sofern Sie die Passwörter während der Gesamtsimulation I modifiziert haben, werden Ihre Änderungen rückgängig gemacht. Die Teilnehmer erhalten je DBC-Kontonummer fünf User IDs, bestehend aus der vierstelligen DBC-Kontonummer des Teilnehmers und einem sechsstelligen Zahlenschlüssel, durchnummeriert von „000 000“ bis „000 004“. Für diese User IDs sind alle Transaktionen erlaubt, unabhängig davon, welche Transaktionen dem einzelnen Teilnehmer im Produktionsbetrieb zur Verfügung stehen. Eine Einschränkung wie im Produktionsbetrieb findet nicht statt.

Das Gesamtpaket mit den Benutzerkennungen und den Passwörtern wurde bereits im April an die Simulationsteilnehmer der Gesamtsimulation I mit separater Post zugestellt. Teilnehmer, die nicht an der Gesamtsimulation I teilgenommen haben, erhalten im September ein Informationsschreiben mit den Benutzerkennungen und Passwörtern. Bei Problemen mit dem Zugriff kann Ihnen das Year 2000 Coordination Center (Simulationsskript Teil I: Übersicht, Kapitel 2.1 Kontakt zur Gruppe Deutschen Börse / Eurex) weiterhelfen.

6.4

Bestände

Um für alle Teilnehmer die reibungslose Durchführung der Aktivitäten im Skript zu gewährleisten, werden zusätzlich zum produktiven Bestand vom 08.10.1999 nach Handelsschluss für die Simulationsgattungen Bestände aufgebaut. Die Dispositionsbestände vom 08.10.1999 werden in der Abendverarbeitung noch verbucht, alle anderen offenen Dispositionsbestände werden nicht berücksichtigt.

Die Höhe der Bestandseinbuchung ist so gewählt, dass die Durchführung der Geschäftsvorfälle sichergestellt ist. Bei GS-verwahrten Aktien werden 10'000 Stück und bei AKV-verwahrten Aktien 1'000 Stück zugebucht. Bei GS-verwahrten Renten werden 10'000'000 Nominale in der Stückewährung und bei AKV-verwahrten Renten 100'000 Nominale in Depotwährung zugebucht. Die alten, produktiven Bestände werden nicht überschrieben, sondern um die genannten Bestandseinbuchungen aufgestockt.



Die Bestandsänderungen finden im Vorfeld der Simulation statt, es werden daher keine SWIFT-Mitteilungen zu erfolgreichen Bestandsübertragungen an die Teilnehmer verschickt. Zur Sicherstellung, dass bei Simulationsbeginn die Bestände in Ihren internen Systemen gleich sind, müssen Sie die Bestandsänderungen manuell in Ihren internen Systemen nachziehen. Die Bestandsänderungen werden nicht für die Niederlassungen, sondern nur für die Zentralen durchgeführt.

OLGA Geschäfte (ZLV, WUG, WPU, WPA), die sich im Erfassungsstatus befinden (d.h. noch nicht kontrolliert sind), werden nach Kopie aus der Produktion automatisch gelöscht. Dies bewirkt eine Gegenbuchung vom 99er Zwischenkonto auf das Hauptkonto des betreffenden Teilnehmers vor Simulationsbeginn. Der Depotbestand zu Beginn der Simulation erhöht sich daher um die Nominale der betroffenen Geschäfte. Bitte achten Sie möglichst darauf, dass am 08.10.1999 bei Online-Ende keine Geschäfte im Erfassungsstatus in OLGA sind. Ansonsten berücksichtigen Sie bitte die resultierenden Bestandsveränderungen bei Ihrem internen Bestandsaufbau.

Es handelt sich insgesamt um 43 Gattungen, davon 26 Aktien und 17 Renten. Im Simulationsskript Teil I: Übersicht, Kapitel 6.5 Gattungen / Produkte finden Sie die Simulationsgattungen für jeden Marktbereich und Information zu den Bestandsänderungen.

6.5

Gattungen / Produkte

In der Gesamtsimulation II kann grundsätzlich mit allen Gattungen bzw. Produkten gehandelt werden.

In enger Abstimmung mit der Gruppe Deutsche Börse / Eurex wurde von den Wertpapier-Mitteilungen Frankfurt (WM) ein Testband für den Jahrtausendwechsel erstellt.

Die in den Gesamtsimulationen verwendeten Testgattungen werden hieraus abgeleitet. Der Bezug dieses Testbandes wurde den WM-Kunden in der 10. Kalenderwoche 1999 durch eine Kundeninformation angeboten, die Bereitstellung durch WM erfolgte am Ende der 14. Kalenderwoche 1999. Nur für diese Gattungen kann garantiert werden, dass alle Ausprägungen in WSS auch korrekt eingepflegt sind.



Gegenüber dem Testband, das von der WM geliefert wird, ergeben sich für vier Testgattungen noch kleinere Änderungen. Diese Änderungen müssen von den Simulationsteilnehmern, die das Testband in ihre eigenen Systeme einspielen, nachvollzogen werden und sind detailliert im Simulationsskript Teil I: Übersicht, Kapitel 6.5.4 Änderungen WM-Testband aufgeführt.

Da die Daten auf dem WM-Testdatenträger bereits Ende 1998 festgelegt wurden, kann es bei einigen Gattungen in den Stammdaten zu Abweichungen gegenüber dem Produktionsdatenträger kommen.

Detaillierte Informationen zu den Gattungen für die Testfälle Kapitalgutschriften und –veränderung finden Sie in der Internet Download Area unter www.Y2K.Exchange.de im Verzeichnis Jahr 2000 Simulation.

Im folgenden werden nun die in den Simulationsskripten verwendeten 43 Testgattungen (32 GS-verwahrte und 11 AKV-verwahrte, bzw. 26 Aktien und 17 Renten), die eine Teilmenge dieses Testbandes bilden, für die einzelnen Marktsegmente aufgeführt.

6.5.1

Kassamarkt

Für den Bereich Kassamarkt werden insgesamt 24 Gattungen verwendet, wovon 10 in Xetra®, 4 in BOSS und 10 in BÖGA gehandelt werden.

System	WKN	Bezeichnung	Verwahrart	Bestand	Geschäftsvorfall
BÖGA	109007	6,25 TREUH.ANL 94/04	GS	+ 10'000'000	CMTP11, CMTP30
BÖGA	114125	5 BUNDESUBL.V.97/02	GS	+ 10'000'000	CMTP15, CMTP34
BÖGA	231836	5,625 US TREASURY 2008	AKV	+ 100'000	CMTP12, CMTP31
BÖGA	350406	4,13 FUCHS PETROL.WDL.97	GS	+ 10'000'000	CMTP19
BÖGA	627500	KARSTADT AG	GS	+ 10'000	CMTP15, CMTP34
BÖGA	725750	METRO AG ST O.N.	GS	+ 10'000	CMTP11, CMTP30
BÖGA	765800	VOGEL AG BETEILIG.	GS	+ 10'000	CMTP18
BÖGA	802200	BAY.HYPO-VEREINSBK.O.N.	GS	+ 10'000	CMTP17
BÖGA	873580	BAA PLC	AKV	+ 1'000	CMTP12, CMTP31
BÖGA	897791	ENI S.P.A.	AKV	+ 1'000	CMTP10, CMTP29
BOSS	103001	8,5 BUND ANL.V.91DT.EINH.	GS	+ 10'000'000	CMTP02, CMTP21
BOSS	604843	HENKEL KGAA VZO O.N.	GS	+ 10'000	CMTP02, CMTP21
BOSS	877355	SMITHKLINE BEECH. LS-0625	AKV	+ 1'000	CMTP16, CMTP35
BOSS	900304	CHINA CONS.HLDGS	AKV	+ 1'000	CMTP01, CMTP20
Xetra®	109005	6,625 TREUH.ANL 93/03	GS	+ 10'000'000	CMTP09, CMTP28
Xetra®	113487	7,25 BUNDANL.V.92	GS	+ 10'000'000	CMTP08, CMTP27
Xetra®	113505	5,25 BUNDANL.V.98/10	GS	+ 10'000'000	CMTP05, CMTP24
Xetra®	114127	4,5 BUNDESUBL.V.98/03	GS	+ 10'000'000	CMTP07, CMTP26
Xetra®	575800	HOECHST AG O.N.	GS	+ 10'000	CMTP08, CMTP27
Xetra®	648300	LINDE AG	GS	+ 10'000	CMTP07, CMTP26
Xetra®	716463	SAP AG VZO O.N.	GS	+ 10'000	CMTP09, CMTP28
Xetra®	717200	SCHERING AG O.N.	GS	+ 10'000	CMTP05, CMTP24
Xetra®	870547	AMER GRP LTD A	AKV	+ 1'000	CMTP06, CMTP25
Xetra®	870747	MICROSOFT CORP.	AKV	+ 1'000	CMTP06, CMTP25

Tabelle 10: Simulationsgattungen im Kassamarkt

6.5.2

Terminmarkt

Im Terminmarkt werden 4 Gattungen, die physisch beliefert oder als Sicherheiten eingeliefert werden, und 14 Produkte verwendet.

System	WKN	Bezeichnung	Verwahrart	Bestand	Geschäftsvorfall
Eurex®	113495	7,5 BUNDANL.V. 94/04	GS	+ 10'000'000	DMTP08, DMTP28
Eurex®	109001	7,375 TREUH.ANL.V.92	GS	+ 10'000'000	DMTP18, DMTP19, DMTP38, DMTP39
Eurex®	723600	SIEMENS AG	GS	+ 10'000	DMTP11, DMTP12, DMTP31, DMTP32
Eurex®	804610	DRESDNER BANK AG O.N.	GS	+ 10'000	DMTP15, DMTP16, DMTP17, DMTP35, DMTP36, DMTP37

Tabelle 11: Simulationsgattungen im Terminmarkt (nur physisch belieferte und Sicherheiten)

System	Produkt-Typ	Währung	Produkt	Geschäftsvorfall
Eurex®	Optionen auf Aktien	EUR	SIE	DMTP01, DMTP03, DMTP11, DMTP12, DMTP21, DMTP23, DMTP31, DMTP32
Eurex®	Optionen auf Aktien	EUR	DRB	DMTP15, DMTP16, DMTP17, DMTP35, DMTP36, DMTP37
Eurex®	Optionen auf Aktien	CHF	CSGN	DMTP01, DMTP03, DMTP21, DMTP23
Eurex®	Optionen auf Indizes	EUR	ODAX	DMTP01, DMTP03, DMTP07, DMTP09, DMTP21, DMTP23, DMTP27, DMTP29
Eurex®	Optionen auf Indizes	CHF	OSMI	DMTP01, DMTP03, DMTP21, DMTP23
Eurex®	Optionen auf Futures, Kapitalmarkt	EUR	OGBM	DMTP01, DMTP03, DMTP05, DMTP13, DMTP14, DMTP21, DMTP23, DMTP25, DMTP33, DMTP34
Eurex®	Optionen auf Futures, Geldmarkt	EUR	OEU3	DMTP01, DMTP03, DMTP21, DMTP23
Eurex®	Futures, Kapitalmarkt	EUR	FGBM	DMTP02, DMTP04, DMTP08, DMTP10, DMTP22, DMTP24, DMTP28, DMTP30
Eurex®	Futures, Kapitalmarkt	CHF	CONF	DMTP02, DMTP04, DMTP05, DMTP22, DMTP24, DMTP25
Eurex®	Futures, Geldmarkt	EUR	FEU1	DMTP02, DMTP04, DMTP22, DMTP24
Eurex®	Futures, Geldmarkt	EUR	FEU3	DMTP20, DMTP40
Eurex®	Futures, Geldmarkt	DEM	LIB3	DMTP02, DMTP04, DMTP22, DMTP24
Eurex®	Futures auf Indizes	EUR	FDAX	DMTP02, DMTP04, DMTP06, DMTP22, DMTP24, DMTP26
Eurex®	Futures auf Indizes	CHF	FSMI	DMTP02, DMTP04, DMTP22, DMTP24

Tabelle 12: Simulationsprodukte in Eurex®

6.5.3

Abwicklung

In der Abwicklung werden 15 Gattungen verwendet:

System	WKN	Bezeichnung	Verwahrart	Bestand	Geschäftsvorf all
CASCADE	103000	8,75 BUND ANL.V.90	GS	+ 10'000'000	CTP03, CTP18
CASCADE	109009	7,5 TREUH.ANL 94/04	GS	+ 10'000'000	CTP07, CTP22
CASCADE	113953	7,75 BUNDESSCH.BR.A 1995	GS	+ 10'000'000	CTP04, CTP19
CASCADE	288148	7 STSPK.MUENCHEN IS.S159	GS	+ 10'000'000	CTP13
CASCADE	515100	BASF AG O.N.	GS	+ 10'000	CTP01, CTP16
CASCADE	600173	HACH AG VZO	GS	+ 10'000	CTP14
CASCADE	634800	KABEL RHEYDT AG	GS	+ 10'000	CTP15
CASCADE	761440	VEBA AG	GS	+ 10'000	CTP06, CTP21
CASCADE	766400	VOLKSWAGEN AG ST O.N.	GS	+ 10'000	CTP05, CTP20
CASCADE	803200	COMMERZBANK AG O.N.	GS	+ 10'000	CTP02, CTP17
CASCADE	849100	UNIFONDS	GS	+ 10'000	CTP12
OLGA	402252	9,125 UTD KINGDOM 91/01	AKV	+ 100'000	CTP11, CTP26
OLGA	406765	8,5 EIB EUR. INV.BK 92/04	AKV	+ 100'000	CTP09, CTP24
OLGA	852009	PFIZER INC.	AKV	+ 1'000	CTP10, CTP25
OLGA	876178	AMSTRAD PLC	AKV	+ 1'000	CTP08, CTP23

Tabelle 13: Simulationsgattungen in der Abwicklung

6.5.4

Änderungen WM-Testband

Nachfolgende Änderungen an vier Testgattungen aus dem Bereich Kassamarkt müssen von den Simulationsteilnehmern, die das Testband der WM in ihre Systeme einlesen, vor Simulationsbeginn nachvollzogen werden. Die zu verändernden Werte gegenüber dem Testband sind „fett“ hervorgehoben.

WKN 103001 - 8,5 BUND ANL.V.91DT.EINH.

W S S ----- ANZEIGE STAMMDATEN BOERSE ----- SEITE: 1 ---									
103001	BF01	8,5	BUND ANL.V.91DT.EINH.	STV	20.02.G	GS	EO		
VERWAHRMOEGL/ART	STV	EINZ.FORD.MOEGL.	COURTAGE-KLASSE	S.	TAB-F02	SCHL.	2D		
EINHEIT	NOTIZ	%	INDEX-KENNZEICHEN						
DEPOTWAEHRUNG		EO	ZULASSUNG/STATUS				DATUM		
ABRECHNUNGS-WRG		EUR	BL	TAG 1.	NOTIERUNG	13.02.1991			
BOEGA-ABRECHNUNGS-WRG		EUR	BR	TAG 1.	NOTIERUNG	13.02.1991			
ERSATZPARITAET			DD	TAG 1.	NOTIERUNG	13.02.1991			
KL.HANDELB.EINH.		0,01	FF	TAG 1.	NOTIERUNG	13.02.1991			
NENNW.ZUM STUECK			HB	TAG 1.	NOTIERUNG	13.02.1991			
KZ OHNE NENNWERT			HA	TAG 1.	NOTIERUNG	13.02.1991			
			MC	TAG 1.	NOTIERUNG	13.02.1991			
			ST	TAG 1.	NOTIERUNG	13.02.1991			
ZINSBER.-METHODE	ACT/ACT (ISMA)		XETRA	TAG 1.	NOTIERUNG	12.10.1998			
TRENNTERMIN	TAGE	1	EUREX	N					
INH/NAMENSPAPIER	INHABERPAPIER	BOEGA	FREIGEgeben	AB	04.12.1992				
HEIMAT-/AUSLANDSBOERSE	EDF	GUELTIG	AB	02.03.2000	BIS	9999999999			

Abbildung 9: Stammdaten WKN 103001 Seite 1

W S S ----- ANZEIGE STAMMDATEN BOERSE ----- SEITE: 2 ---									
103001	BF01	8,5	BUND ANL.V.91DT.EINH.	STV	20.02.G	GS	EO		
MARKT	BL	BR	DD	FF	HB	HA	MC	ST	
EINH.NOT.	AMT.H	AMT.H	AMT.H	AMT.H	AMT.H	AMT.H	AMT.H	AMT.H	
-BETRAG	0,010	0,010	0,010	0,010	0,010	0,010	0,010	0,010	
-INKREMENT	VF	VF	VF	VF	VF	VF	VF	VF	
VAR. NOT.	J	J	J	J	J	J	J	J	
-BETRAG	0,010	1000000	0,010	1000000	1000000	1000000	1000000	1000000	
-INKREMENT	VF	VF	VF	VF	VF	VF	VF	VF	
MAKLER	390	893	296	659	801	800	265	299	
DSK									
BOSS-AB	16.08.93	01.09.93	10.05.93	01.04.93	01.07.93	12.07.93	19.07.93	02.08.93	
STOP-LOSS/BUY	J	J	J	J	J	J	J	J	
L.H-TAG									

Abbildung 10: Stammdaten WKN 103001 Seite 2

WKN 877355 - SMITHKLINE BEECH. LS-0625

```

W S S ----- ANZEIGE STAMMDATEN BOERSE ----- SEITE: 1 ---
877355 SBE SMITHKLINE BEECH. LS-0625 AKV ST

VERWAHRMOEGL/ART DBC-AUSLAND,LIEFERB COURTAGE-KLASSE AKTIEN O.DAX-30-WERT
EINHEIT NOTIZ ST INDEX-KENNZEICHEN
DEPOTWAHRUNG LS ZULASSUNG/STATUS DATUM
ABRECHNUNGS-WRG EUR BL TAG 1. NOTIERUNG 26.01.1998
BOEGA-ABRECHNUNGS-WRG EUR BR TAG 1. NOTIERUNG 14.05.1998
ERSATZPARITAET DD TAG 1. NOTIERUNG 14.05.1998
KL.HANDELB.EINH. 1 FF TAG 1. NOTIERUNG 14.05.1998
NENNW.ZUM STUECK 0,0625 HB TAG 1. NOTIERUNG 01.04.1992
KZ OHNE NENNWERT HA TAG 1. NOTIERUNG 14.05.1998
RECHN.NENNWERT BEI MC TAG 1. NOTIERUNG 14.05.1998
NENNWERTL.ST-AKT. ST TAG 1. NOTIERUNG 19.05.1998
XETRA
EUREX N

WARRANT-SEGMENT
INH/NAMENSPAPIER NAMENSPAPIER BOEGA FREIGEgeben AB 04.12.1992
HEIMAT-/AUSLANDSBOERSE EUL GUELTIG AB 31.12.1998 BIS 9999999999
    
```

Abbildung 13: Stammdaten WKN 877355 Seite 1

```

W S S ----- ANZEIGE STAMMDATEN BOERSE ----- SEITE: 2 ---
877355 SBE SMITHKLINE BEECH. LS-0625 AKV ST

BL BR DD FF HB HA MC ST
MARKT FV FV FV FV FV FV FV FV
EINH.NOT. J J J J J J J J
-BETRAG 1 1 1 1 1 1 1 1
-INKREMENT VF VF VF VF VF VF VF VF
VAR. NOT. J J J J J J J J
-BETRAG 1 1 1 1 1 100 1 1
-INKREMENT VF VF VF VF VF VF VF VF
MAKLER 390 893 296 659 801 800 265 299
DSK
BOSS-AB 26.01.98 14.05.98 14.05.98 14.05.98 01.07.93 14.05.98 19.07.93 19.05.98
STOP-LOSS/BUY J J J J J J J J
L.H-TAG
    
```

Abbildung 14: Stammdaten WKN 877355 Seite 2

WKN 900304 - CHINA CONS.HLDGS

W S S ----- ANZEIGE STAMMDATEN BOERSE -----		SEITE: 1 ---	
900304 CIH	CHINA CONS.HLDGS	AD-,30	AKV ST
VERWAHRMOEGL/ART	DBC-AUSLAND,LIEFERB	COURTAGE-KLASSE	AKTIEN O.DAX-30-WERT
EINHEIT NOTIZ		ST INDEX-KENNZEICHEN	
DEPOTWAEHRUNG		AD ZULASSUNG/STATUS	DATUM
ABRECHNUNGS-WRG	EUR	BL	TAG 1. NOTIERUNG 13.02.1998
BOEGA-ABRECHNUNGS-WRG	EUR	BR	TAG 1. NOTIERUNG 23.10.1996
ERSATZPARITAET		DD	TAG 1. NOTIERUNG 23.10.1996
KL.HANDELB.EINH.	1	FF	TAG 1. NOTIERUNG 23.10.1996
NENNW.ZUM STUECK	0,3	HB	TAG 1. NOTIERUNG 08.07.1997
KZ OHNE NENNWERT		HA	TAG 1. NOTIERUNG 23.10.1996
RECHN.NENNWERT BEI		MC	TAG 1. NOTIERUNG 16.09.1998
NENNWERTL.ST-AKT.		ST	TAG 1. NOTIERUNG 14.05.1996
		XETRA	TAG 1. NOTIERUNG 12.10.1998
		EUREX	N
WARRANT-SEGMENT			
INH/NAMENSPAPIER	NAMENSPAPIER	BOEGA	FREIGEgeben AB 23.04.1996
HEIMAT-/AUSLANDSBOERSE	AAS	GUELTIG AB	31.12.1998 BIS 999999999

Abbildung 15: Stammdaten WKN 900304 Seite 1

W S S ----- ANZEIGE STAMMDATEN BOERSE -----		SEITE: 2 ---						
900304 CIH	CHINA CONS.HLDGS	AD-,30	AKV ST					
	BL	BR	DD	FF	HB	HA	MC	ST
MARKT	FV	FV	FV	FV	FV	FV	FV	FV
EINH.NOT.	J	J	J	J	J	J	J	J
-BETRAG	1	1	1	1	1	1	1	1
-INKREMENT	VF	VF	VF	VF	VF	VF	VF	VF
VAR. NOT.	J	J	N	J	J	J	J	J
-BETRAG	1	1	1	1	1	1	1	1
-INKREMENT	VF	VF	VF	VF	VF	VF	VF	VF
MAKLER	390	893	296	659	801	800	265	299
BOSS-AB 13.02.98	23.10.96	23.10.96	23.10.96	08.07.97	23.10.96	16.09.98	14.05.96	
STOP-LOSS/BUY	J	J	J	J	J	J	J	J
L.H-TAG								

Abbildung 16: Stammdaten WKN 900304 Seite 2

6.6 Reports

Die für die Simulation notwendigen Reports, welche standardmässig den Teilnehmern zur Verfügung gestellt werden, sowie ihre Reportarten sind im folgenden nach Marktbereichen und Systemen getrennt aufgeführt.

6.6.1 Reportarten

Während der Simulation werden die folgenden Reportarten unterschieden:

Art	Beschreibung
CA-Spool	Der CA-Spool ist für die Teilnehmern nur online zugänglich. Das Ausdrucken seitens der Teilnehmer ist nicht möglich, um eine Verwechslung mit den Dateien aus dem Produktionsbetrieb auszuschliessen. Für Teilnehmer, die den CA-Spool elektronisch auswerten, ist der Zugriff zu parametrisieren.
Datenträger	Den Teilnehmern stehen alle Datenträger aus dem Produktionsbetrieb auch während der Simulation zur Verfügung. Während der Konnektierung werden mit den Teilnehmern die Parameter für die einzelnen Transferjobs eingestellt. Die Adressierung der File Transfer-Produkte erfolgt mit einem „p“ für Produktion. Der Versand der Datenträger erfolgt nicht untertäglich.
Druckdateien	In der MVS-Umgebung der Jahr 2000 Simulation stehen den Teilnehmern generell keine Druckjobs zur Verfügung. Während der Konnektierung kann der Teilnehmer, unter Angabe der Parameter der Jobs, die Übertragung spezieller Druckdateien anfordern. File Transfers erfolgen in der Simulation nur, sofern die Druckdateien vom Teilnehmer explizit angefordert wurden.
Papierlisten / Reports	Papierlisten und Reports, die zur Durchführung der Simulation als notwendig erachtet werden, werden nur auf Anforderung an die Teilnehmer versandt. Die Listen können nur komplett bezogen werden. Diesen Simulationsskripten beiliegend befindet sich ein Rückantwort-Formular, mit dem die Listen bis 1.Oktober 1999 bestellt werden können. Der Ausdruck und anschliessende Versand erfolgt über Eurocom.



Tabelle 14: Reportarten in der Simulation

Anmerkung: Beim Versand des Listoutputs kann es wegen des zusätzlichen Aufkommens bei unserem externen Serviceprovider Eurocom zu Verzögerungen kommen.

6.6.2

Kassamarkt

System	Bezeichnung	ID
BÖGA	Schlussnotdatenträger	diverse
Xetra®	Fee Overall Summary	CB050
Xetra®	Fee Statement	CB060
Xetra®	Daily Quote Maintenance	TC530
Xetra®	Daily Order Maintenance	TC540
Xetra®	Daily Trade Confirmation	TC810
Xetra®	Daily Open OTC Maintenance	TC820

Tabelle 15: Standard Reports Kassamarkt

6.6.3

Terminmarkt

System	Bezeichnung	ID
Eurex®	Position Detail	CB010
Eurex®	Give-up Trade History	CB130
Eurex®	Accepted Give-Up Trades	CB140
Eurex®	Take-up Trade History	CB150
Eurex®	Accepted Take-up Trades	CB160
Eurex®	Daily Cash Account Statement	CD010
Eurex®	Daily Security Movement and Coverage	CD020
Eurex®	Daily Exercise and Assignment Summary	CE070
Eurex®	Option on Futures Exercise / Assignment Summary	CE071
Eurex®	Pending Delivery	CE080
Eurex®	Settled Delivery	CE100
Eurex®	Delivery List Sale	CE110
Eurex®	Delivery List Buy	CE111
Eurex®	Daily Quote Maintenance	TC530
Eurex®	Daily Order Maintenance	TC540
Eurex®	OTC Block Trade Maintenance	TC545
Eurex®	Open Order Detail	TC550
Eurex®	Daily Trade Confirmation	TC810

Tabelle 16: Standard Reports Terminmarkt

6.6.4

Abwicklung

System	Bezeichnung	ID
LION	Lieferliste LION	KV209
CASCADE	Regulierungsliste 1.SDS,2.SDS,STD	PU05
CASCADE	Liste der gültig erteilten Aufträge	KV158
CASCADE	Liste der nicht zur Disposition übernommenen Aufträge	KV157
CASCADE	Änderungshistorie für Aufträge im Auftragsstatus	KV132
CASCADE	Liste der von der Kontrahentenseite eingeg. Instruktionen	KV102001
CASCADE	Liste der gelöscht. Eing. im Auftrags- u. Erfassungsstatus	KV102003
CASCADE	Liste der historischen Aufträge	KV102004
KADI	Persönliches Anschreiben Schwebe Erträge	KD111
KADI	Persönliches Anschreiben Sondpro	KD206
KADI	Persönliches Journal Sondpro Schwebe	KD118
KADI/KV-Geld	Geldtagesauszug	KV108

Tabelle 17: Standard Reports Abwicklung