

e u r e x *information*

Date: Frankfurt, 27 June, 2002
Recipients: All Eurex Clearing members and vendors
Authorized by: Peter Reitz

Central Counterparty – CCP Circulars 17/02 and 18/02

Contact: Functional Member Readiness: Tel. +49 69-2101-1700

Content may be most important for:

➔ Central Counterparty Coordinators

Attachments:

CCP Circular 17/02 (English/Deutsch)

Attachments:

S.W.I.F.T. Message Formats (English/Deutsch)

XONTRO Newsletter No. 7 (English/Deutsch)

CCP Circular 18/02 (English/Deutsch)

Attachment:

Summer Road-show Agenda (English/Deutsch)

Please find attached a copy of Central Counterparty Circular 17/02 and 18/02 sent to Frankfurter Wertpapier Börse members and vendors recently.

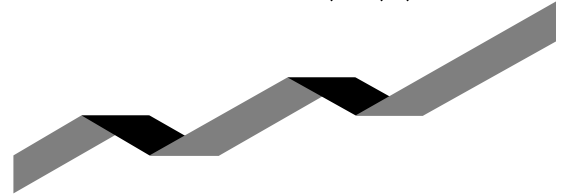
The attachments to Circular 17/02 contained:

1. a detailed description of S.W.I.F.T. message formats for contract notes, trade confirmations and CCP trades originating from XONTRO trade,
2. XONTRO Newsletter No. 7 dealing with the effects on XONTRO of the introduction of CCP and the ETS system of the Berlin Stock Exchange.

In addition it provided the CCP web-site location of the material distributed during the recent road-show events.

Attached to Circular 18/02 you will find the agenda for the summer road-show events to be held in Frankfurt and London on 2 July and 8 July, 2002 respectively.

Should you still wish to register for either of these events, the Fax reply attached to CCP Circular 16/02 should be returned by 27 June, 2002 at the latest. Location details have been provided on the CCP web-site.



An die FWB Teilnehmer, Xetra® Teilnehmer und Vendoren

Empfängerkreis: Allgemein, Handel, Back Office,
Systemadministrator, Projektkoordinator

FWB
Frankfurter
Wertpapierbörse

Geschäftsführung

Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt am Main

Postanschrift
60485 Frankfurt am Main

Central Counterparty – CCP Detailinformationen Schlussnotendatenträger/ Veröffentlichung Roadshow-Dokumentation

7. Juni 2002

Telefon
+49(0)69-21 01-16 40
+49(0)69-97 70-16 40

Telefax
+49(0)69-21 01-16 41
+49(0)69-97 70-16 41

Internet
deutsche-boerse.com

Sehr geehrte Damen und Herren,

wir freuen uns, Ihnen heute im Rahmen der Implementierung des Zentralen Kontrahenten eine umfassende Dokumentation mit Detailbeschreibungen möglicher Geschäftsarten und Übertragungsparameter zur Verfügung stellen zu können. Auch bietet dieses Dokument einen Überblick hinsichtlich der Gestaltung der S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für

- Schlussnoten
- Geschäftsbestätigungen und
- CCP-Geschäfte aus XONTRO Trade.

Darüber hinaus erhalten Sie als Anlage den XONTRO-Newsletter Nr. 7, der technische Erläuterungen zum Schlussnotendatenträger in Kapitel 3 beinhaltet.

Ferner möchten wir Sie darauf hinweisen, dass die Unterlagen und Präsentationen, die im Rahmen der CCP-Roadshow jeweils an den Veranstaltungsorten Frankfurt, Hamburg, London, Paris und München ausgehändigt wurden, ab sofort auf der CCP-Webseite im Members-Only-Bereich unter der Rubrik „Dokumentation“ verfügbar sind.

Geschäftsführer:
Edward Backes
Dr. Heiko Beck
Rudolf Ferscha
Frank Gerstenschläger
Volker Potthoff


Falls Sie Rückfragen haben oder weitere Informationen benötigen,
steht Ihnen das CCP Change Management Team unter

Telefon: +49(0)69-21 01-16 40

Fax: +49(0)69-21 01-16 41

gerne zur Verfügung.

Mit freundlichen Grüßen


i.A. Jens Hachmeister


i.A. Christian Ochsner

Anlagen

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten,
Geschäftsbestätigungen und CCP-Geschäfte
aus XONTRO Trade

**Gültig voraussichtlich ab
November 2002**

Version: 19.2

Stand: 24.05.2002

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/
Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

Schlussnoten/Geschäftsbestätigungen (MT512)

Funktion: Übermittlung von Geschäftsbestätigungen und Schlussnoten im S.W.I.F.T. Format. Folgende Geschäftsarten sind möglich:

- Maklervermittelte Geschäfte – Platz
- Bankdirektgeschäfte – Platz
- Banken-PUEV-Geschäfte
- Makler-PUEV-Geschäfte
- XONTRO Order-Geschäfte
- Xetra – Geschäfte
- INVESTRO – Geschäfte
- Orderschlussnoten Xetra-Geschäfte (Order Level Netting)
- ETS-Geschäfte

Die Übertragungsparameter des Trade-Schlußnotendatenträgers können wie folgt beschrieben nach Angaben des Kunden von BrainTrade individuell parametrisiert werden:

Übertragungsparameter

- stündlicher Rhythmus
- täglicher Rhythmus
- mit DWZ- bzw. Xetra- Ordernummern
- mit Bankinternen Ordernummern
- keine Ordernummern
- Xetra – Geschäftsbestätigungen in einem separaten Lauf
- Xetra – Geschäftsbestätigungen zusammen mit dem (bei stündl. Bezug: letzten) Parkettlauf (entfällt im 1. HJ 2001)
- keine Xetra – Geschäftsbestätigungen
- Orderschlussnoten – Datenträger nur in einem separaten Lauf
- ETS-Geschäfte werden immer in einem separaten Lauf 1 x täglich geliefert

Für Fragen stehen Ihnen gerne die Mitarbeiter von BRAINTRADE, unter der Rufnummer 069/589978-110 zur Verfügung.

Hinweis: Der Versand des Schlussnotendatenträgers erfolgt nicht über S.W.I.F.T. sondern via File Transfer. Die im Basic-Header und im Anwendungs-Header angegebene S.W.I.F.T.-Adresse wird nicht für den Versand benutzt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTR0 Trade****Beispiele für den Aufbau des Schlussnotendatensatzes:**

Der Geschäftsabwicklung vorliegende Orders:

KAUFSEITE	VERKAUFSEITE
Bank 1: Order 1 = 100	Bank 3: Order 4 = 200
Order 2 = 50	Bank 4: Order 5 = 250
Bank 2: Order 3 = 300	

Aus dem Zuteilungsalgorithmus ergeben sich die folgenden Schlussnoten (SNO) und Geschäfte (GNR) :

SNO1/GNR1: Bank 2 = 250	SNO2/GNR1: Bank 4 = 250
SNO3/GNR2: Bank 1 = 150	SNO4/GNR2: Bank 3 = 150
SNO5/GNR3: Bank 2 = 50	SNO6/GNR3: Bank 3 = 50

Für jedes Geschäft werden pro Kreditinstitut ein MT 512 und ggf. 'n' MT 599 wie folgt erstellt:

SNO1 MT 512

Empfänger = Bank 2
 20: GNR1
 21: Ordernr. 3
 23: Kauf
 Anz. 250
 Kontrahent Bank 4

SNO2 MT 512

Empfänger = Bank 4
 20: GNR1
 21: Ordernr. 5
 23: Verkauf
 Anz. 250
 Kontrahent Bank 2

SNO3 MT 512

Empfänger = Bank 1
 20: GNR2
 21: MT599
 23: Kauf
 Anz. 150
 Kontrahent Bank 3

SNO4 MT 512

Empfänger = Bank 3
 20: GNR2
 21: Ordernr. 4
 23: Verkauf
 Anz. 150
 Kontrahent Bank 1

SNO3 MT 599

Empfänger = Bank 1
 20: lfd. Nr.
 79: GNR2 (1.Zeile/SNO-Ref.)
 Ordernr. 1 (2.Zeile/ONR-Ref.) Nominale 100
 Ordernr. 2 (3.Zeile/ONR-Ref.) Nominale 50

SNO5 MT 512

Empfänger = Bank 2
 20: GNR3
 21: Ordernr. 3
 23: Kauf
 Anz. 50
 Kontrahent Bank 3

SNO6 MT 512

Empfänger = Bank 3
 20: GNR3
 21: Ordernr. 4
 23: Verkauf
 Anz. 50
 Kontrahent Bank 2

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/ Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade

In der Folge ist der Aufbau des Schlussnotendatenträgers im S.W.I.F.T. Format beschrieben.

Der S.W.I.F.T. Nachrichtensatz beginnt mit dem

Basic Header

Blockkennzeichen	= 1:		
Anwendungskennzeichen	= F	(1a)	für Anwendung Finanzbereich
Kennung Dateneinheit	= 01	(2n)	für System- und Benutzernachrichten
Adresse	= 12-stellig (4a2a2c1c3c)		Empfänger – SWIFT - Adresse für Ausgabenachrichten
Sitzungsnummer	= 0000	(4n)	Selektiertes Anwendungsprogramm
Folgenummer	= 999999	(6n)	OSN (Output Sequence Number)

Anwendungs-Header

Blockkennzeichen	= 2:		
Kennzeichen für Ein-/Ausgabe	= O	(1a)	für Ausgabe
Transaktionstyp	= 598 = 512 = 599	(3n) (3n) (3n)	Nachrichtentyp: Vorsatz/Endesatz Nachrichtentyp: Datensatz Nachrichtentyp: Free-Form-Nachricht
Uhrzeit der Eingabe	= HHMM	(4n)	Erstellungsuhrzeit
Eingabereferenz MIR	= JJMMTT 12-Stellen	(6n)	Eingabedatum Sender – SWIFT - Adresse
	(4a2a2c1c3c) 0000 999999	(4n) (6n)	Sitzungsnummer ISN (Input Sequence Number)
Ausgabedatum	= JJMMTT	(6n)	
Uhrzeit der Ausgabe	= HHMM	(4n)	
Priorität	= N	(1n)	für ‚Normal‘

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade****Text-Block**

Der Text einer Benutzernachricht bei S.W.I.F.T. II ist identisch mit dem Text der entsprechenden Nachricht bei S.W.I.F.T. I, mit Ausnahme eines zusätzlichen Blocktrennzeichens (= 4:).

Danach folgen die Etiketten:

MT	512	SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG	
O/M	ETIKETT	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
M	20:	Geschäftsnummer – Börsenplatz – Börsentag (JMMTT) – laufende Nummer	3n6nZn 3n 6n Zn
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 12)</i>	
M	21:	Order-Referenz – Konstante 'DWZ' bei DWZ – Ordernummer – Ordernummer –> Börsentag (JMMTT) –> laufende Nummer	16x 3a 6n Zn
	oder	– Konstante 'XET' bei XETRA – Ordernummer – Ordernummer	3a 13n
	oder	– Konstante 'BER' bei ETS – Ordernummer – Ordernummer	3a 13n
	oder	– Bankinterne – Ordernummer	[16x]
	oder	– 'NONREF'	[16x]
	oder	– 'MT599'	[16x]
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 12)</i>	
M	23:	Geschäftsart – BOUGHT oder SOLD – Satzart – Kennzeichen-Lieferfreigabe – Kennzeichen 'J' – automatische Lieferfreigabe nach Ausführung – Kennzeichen 'N' – keine automat. Lieferfreig. Nach Ausführung – Kennzeichen 'IW-Geschäft' – Kennzeichen Eigengeschäft – Kennzeichen börslich – Kennzeichen 'AB' – außerbörslich – Kennzeichen 'BS' – börslich – Netting – Type	6a/3n/[1a]/[J] /[2x]/[2x]/[1a] 6a /3n /[1a] /[J] /[2x] /[2x] /[1a]

(nähere Beschreibung siehe Seite 13-16)

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade**

MT	512	SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG	
O/M	ETIKETT	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
M	31P:	Abschlussangaben	6n3n/[2a]/[2a]/[1a]/[N] [6n,4n]
		– Schlusstag (JJMMTT)	6n
		– Börsenplatz des Eingebers	3n
		– Kennzeichen für Abweichender Schlusstag 'AS'	/[2a]
		– Festvaluta-Kennzeichen	/[2a]
		'FO' – Valuta ohne Gegenwertverrechnung	
		'FV' – Valuta mit Gegenwertverrechnung	
		'FZ' – Valuta Zug um Zug	
		'FI' – Valuta international	
		– Kennzeichen manuelle Eingabe von Zins- bzw. Diskontierungstagen 'M'	/[1a]
		– Vorzeichen für Kursdifferenz (s.Feld 33S) 'N'	/[N]
		– Abweichender Kontrahentenkurs	[6n,4n]
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 17)</i>	
M	30:	Weitere Abschlussangaben	6n/[4n]/[3n]/[2a]/[1a]
		– Datum-Festvaluta (JJMMTT) oder Dummywert '000000', falls keine Eingabe erfolgt ist	6n
		– Eingabe-Uhrzeit (HHMM)	/[4n]
		– Börsenplatz des Meldewesens	/[3n]
		– Kennzeichen für Abweichendes Abschlussdatum 'AA'	/[2a]
		– Kennzeichen „Abendbörse“	/[1a]
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 17-18)</i>	
M	35A:	Art und Stückzahl/Nennwert des Wertpapiers	3a10n,3n
		– Art des Wertpapiers	3a
		– Stück oder Nennwert (Nominale)	10n,3n
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 19)</i>	
M	35B:	1. Zeile - Wertpapierkennnummer	<u>ISIN</u> b12c
		2. Zeile - Wertpapierkurzbezeichnung	35x
		3. Zeile	3n1n/[4n,9n]/[8x] /[2x1n,9n]
		– Verwahrart	3n
		– Einheit Effektennotiz	1n
		'1' – Stücknotiz	
		'2' – Prozentnotiz	
		'3' – Promillenotiz	
		– Zinssatz	/[4n,9n]
		– Zinstermin	/[8x]

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade**

MT	512	SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG	
O/M	ETIKETT	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
		– Kennzeichen-Wertpapier mit Poolfaktor/ Fundierungsschuldverschreibungen 'PF' - Wertpapiere mit Poolfaktor 'FS' - Fundierungsschuldverschreibungen – Poolfaktor/Umrechnungsfaktor	/[2x 1n,9n]
		4. Zeile – Serien-Wertpapierkennung (beim Handel in Stamm-Nr. wird hier die erste in den Stammdaten gespeicherte Serie eingesetzt)	[ISINb12c]
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 19-23)</i>	
O	82D:	Kontrahent (CBF-Konto-Nr.)	/4n
M	87F:	Käufer/Verkäufer – Konstante 'APMT' = gegen Zahlung – Konstante 'C' für Käufer bzw. Konstante 'D' für Verkäufer – CBF-Konto-Nr. des Käufers/Verkäufers	4a/1x/4n 4a /1x /4n
O	87F:	Käufer/Verkäufer – Konstante 'APMT' = gegen Zahlung – Konstante 'C' für Käufer bzw. Konstante 'D' für Verkäufer – CBF-Konto-Nr. des Käufers/Verkäufers	4a/1x/4n 4a /1x /4n
		<i>(nähere Beschreibung für 82D + 87F siehe Seite 24)</i>	
M	33T:	Abschlusskurs – Währungskennzeichen (bei stücknotierten Werten Abrechnungswährung, sonst Depotwährung) – Betrag	3a6n,4n 3a 6n,4n
O	32M:	Kurswert – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) – Betrag	3a12n,2n 3a 12n,2n
O	33S:	Kursdifferenz – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) – Betrag (wenn in Feld 31P ‚N‘ steht, dann überweist der Makler, sonst erhebt der Makler)	3a12n,2n 3a 12n,2n
O	34G/H	Stückzinsen – Zinstage – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) – Betrag (wenn bei dem Etikett 34 ‚G‘ steht, sind dies Plusstückzinsen, die zum Kurswert zu addieren sind, wenn ‚H‘ steht, sind es Minusstückzinsen, die vom Kurswert zu subtrahieren sind)	3n3a10n,2n 3n 3a 10n,2n

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade**

MT	512	SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG	
O/M	ETIKETT	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
O	71C:	Gebühren und Spesen	6* /8a/3a7n,2n/[1a] /[2x]/[2x]
		– Konstante /BROK/	/8a/
		– Währungskennzeichen (Abrechnungswährung)	3a
		– Courtage-Betrag (negativ, wenn vom Abr.betrag abgezogen wird, positiv, wenn zum Abr.betrag addiert wird)	7n,2n
		– Vorzeichen Courtage: wenn negativ: 'N' , sonst frei	/[1a]
		– Courtage-Schlüssel	/[2x]
		– Courtage-Zusatzangabe	/[2x]
		'AC' – Abweichende Courtage	
		'FC' – Franco Courtage	
		'HC' – Halbe Courtage	
		'FR' – Franco Rechnung	
		'PC' – Prozentcourtage (bei maklervermittelten Geschäften)	
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 25-27)</i>	
		und/oder	
		– Konstante /FEES/	/8a/
		– Währungskennzeichen (Abrechnungswährung)	3a
		– Spesen-Betrag (negativ, wenn vom Abr.betrag abgezogen, positiv, wenn zum Abr.betrag addiert wird)	7n,2n
		– Vorzeichen Spesen Betrag: wenn negativ: 'N' , sonst frei	/[1a]
		und/oder	
		– Konstante /MISC/	/8a/
		– Währungskennzeichen (Abrechnungswährung)	3a
		– Wiederanlage-Betrag	7n,2n
		– Vorzeichen Wiederanlageabatt: wenn negativ: 'N' , sonst frei	/[1a]
		– Kennzeichen für Wiederanlageabatt 'WA'	/[2x]
		und/oder	
		– Konstante /MISC/	/8a/
		– Währungskennzeichen (Abrechnungswährung)	3a
		– Bonifikations-Betrag	7n,2n
		– Vorzeichen Boni-Betrag: wenn negativ: 'N' , sonst frei	/[1a]
		– Kennzeichen für Bonifikation 'BO'	/[2x]
		– Boni-Schlüssel	/[2x]
		'01' - % auf Kurswert	
		'02' - EO pro Stück	
		'03' - % auf Nennwert	

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/

Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade

MT	512	SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG	
O/M	ETIKETT	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
O	71C:	Gebühren und Spesen	6* /8a/3a7n,2n/[1a] /[2x]/[2x]]
	und/oder	<ul style="list-style-type: none"> – Konstante /MISC/ – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) – Boni-Differenz-Betrag (negativ: Makler überweist, positiv: Makler erhebt) – Vorzeichen Boni-Diff.: wenn negativ: 'N', sonst frei – Kennzeichen für Boni-Differenz 'BD' 	/8a/ 3a 7n,2n /[1a] /[2x]
	und/oder	<ul style="list-style-type: none"> – Konstante /COMM/ – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) – Provisionsbetrag (negativ, wenn vom Abr.betrag abgezogen wird, positiv, wenn zum Abr.betrag addiert wird) – Vorzeichen Prov-Betrag: wenn negativ: 'N', sonst frei – Kennzeichen Provisionseingabe (falls manuelle Eingabe erfolgte) 'PD' - Eingabe des Provisionsbetrags 'PM' - Eingabe des Promillesatz 	/8a/ 3a 7n,2n /[1a] /[2x]
O	71B:	Abrechnungsdaten Finanzierungsschätze	8n/2n,7n3n/10n,2n
		1. Zeile	8n/2n,7n
		– Letzter Tilgungstermin (letzte Fälligkeit)	8n
		– Diskontsatz	/2n,7n
		2. Zeile	3n/10n,2n
		– Diskonttage	3n
		– Diskontbetrag	/10n,2n
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 27)</i>	
O	36:	– Devisenkurs in der Form Mengennotiz auf einen Euro bezogen	7n,11n
M	34B:	Abrechnungsangaben	3a12n,2n
		– Währungskennzeichen (Abrechnungswährung)	3a
		– Abrechnungsbetrag	12n,2n

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

MT	512	SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG	
O/M	ETIKETT	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
O	57B:	Informationen bei einem CCP-Geschäft	1a[/4n]
		- Kennzeichen-CCP-Geschäft 'J' – CCP-Geschäft liegt vor	1a
		- CBF-Nummer des Clearing Teilnehmers	[/4n]
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 31)</i>	
M	72:	Information Sender an Empfänger	
		1. Zeile	4n[4n6nZn6n]
		- Eingeber	4n
		- Ursprünglicher Makler (bei Aufgabewiderrückgabe/-Schließung)	[4n]
		- Ursprüngliche Geschäftsnummer (bei Aufgabewiderrückgabe/-Schließung, Durchlief.)	6nZn
		- Ursprünglicher Schlusstag (JJMMTT) (bei Aufgabewiderrückgabe/-Schließung, Durchlieferung, Schlussnote)	6n]
		2. Zeile	4n[/6x][6nZn][N]/[N]/[2n,2n]
		- Empfänger der Geschäftsbestätigung (bei Einstellung ‚incl. Filiale = J‘ erscheint hier die KV-Nr. der Filiale)	4n
		- Wertpapierkennnummer (deutsche)	[/6x]
		- Wegen-Geschäftsnummer	[6nZn]
		- Vorzeichen Zwischengewinn: wenn negativ: ,N‘, sonst frei (siehe 5. Zeile)	[N]
		- Vorzeichen akk. Aussch. Erträge: wenn negativ: ,N‘, sonst frei (siehe 6. Zeile)	[/N]
		- Ausgabeaufschlag	[/2n,2n]
		3. Zeile	6n4n[9n6x]
		- Abschlussdatum (JJMMTT)	6n
		- Abschlussuhrzeit (HHMM)	4n
		- Xetra:Trade-Code-Suffix	[9n
- Identifizierungs-Kennzeichen (Händlernummer) aus Xetra oder XONTRO TRADE (erscheint nur bei dem Eingeber!)	6x]		
<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 27-29)</i>			

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

MT	512	SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG	
O/M	ETIKETT	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
M	72:	Information Sender an Empfänger	
		4. Zeile	
		– Textfeld	[35x]
		bei XONTRO TRADE-Geschäften:	
		Stelle 1-35: variabler Text bei Eingabe von 'TX'	
	Oder	bei XONTRO ORDER-Geschäften:	
		Stelle 1-5: Text ' BOSS '	
		ab Stelle 6: variabler Text aus Orders	
	Oder	bei Xetra – Geschäften	
		Stelle 1-6: Text ' XETRA '	
		ab Stelle 7: variabler (maximal 12-stelliger) Text aus Xetra und ggfs. danach die durch „/“ getrennte 5-stellige Executor ID.	
	Oder	bei INVESTRO – Geschäften	
		Stelle 1-9: Text ' INVESTRO '	
		ab Stelle 10: variabler Text aus Aufträgen	
	Oder	bei ETS – Geschäften	
		Stelle 1-7: Text ' BERLIN '	
		ab Stelle 8: variabler (maximal 12-stelliger) Text	
M	72:	Information Sender an Empfänger	
		5. Zeile	[2n,3n/[3n,7n]/7n,8n]]
		– Bonisatz	[2n,3n
		– Wiederanlageabatt	[/3n,7n]
		– Zwischengewinn (wenn negativ siehe 2. Zeile)	[/7n,8n]]
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 30)</i>	
		6. Zeile	[7n,8n/9n,8n]]
		– Ausgabepreis	[7n,8n
		– akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag	[/9n,8n]]
		(wenn negativ siehe 2. Zeile)	
		<i>(nähere Beschreibung siehe Seite 30)</i>	

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade****Regeln:****Etikett 20 Geschäftsnummer :**

Die Geschäftsnummer wird börsentäglich fortlaufend je Börsenplatz vergeben. Hamburg und Bremen haben einen gemeinsamen Geschäftsnummernbestand, daher wird das **Feld Börsenplatz** bei Hamburger und Bremer Geschäften mit dem Börsenplatz Hamburg (140) belegt.

CCP-Orderlevel Netting: 096
INVESTRO: 183

Etikett 21 Order-Referenz :

Liegt dem Geschäft nur eine Order zugrunde, und fließt die ausgeführte Ordernominale voll in das Geschäft ein, wird je nach Parametrisierung in der Verarbeitungssteuerung in das Feld Ordernummer die DWZ-, die Xetra- oder eine bankinterne Ordernummer eingestellt. Wenn die bankinterne Ordernummer als Kanfeld definiert und bei der Eingabe nicht miterfasst wurde, so wird die DWZ-Ordernummer ohne die Konstante ‚DWZ‘ eingestellt.

Ist das Geschäft nicht aus einer Order entstanden, wird das Feld mit der Konstanten **‘NONREF’** belegt. Genauso wird verfahren, wenn die Bank keine Order-Nummern mitgeliefert haben möchte (Parameter-gesteuert).

Wenn sich die Nominale eines Geschäftes aus mehreren Ordnern zusammensetzt bzw. wenn die ausgeführte Ordernominale nur teilweise in das Geschäft fließt und gleichzeitig eine Referenzierung von Ordnernummern gewünscht wurde, so wird das Feld mit **‘MT599’** belegt. Die Daten der zugehörigen Orders befinden sich im MT599, welcher jeweils zur entsprechenden Geschäftsnummer bis zu 34 Ordnernummern inkl. der jeweiligen Nominalen enthält. Ggf. werden weitere MT599 produziert.

Für Xetra-Geschäfte wird kein MT599 generiert, weil ein Geschäft sich auf eine Order bezieht, wobei die Ordernominale eine Teilnominale sein kann. Der Rest der Ordernominalen kann ein weiteres Geschäft bilden. Die Geschäfte haben identische Ordnernummern.

Bei **Orderschlussnoten** wird ebenfalls die Ordernummer der Order mit Konstante „XET“ eingestellt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade****Etikett 23 Geschäftsart:****Feld: - Satzart**

Möglicher Wertebereich:

- 011 Kauf – Schlussnote
- 012 Kauf – Direktgeschäft
- 013 Kauf – Aufgabe
- 014 Kauf – Aufgabeschließung
- 015 Kauf – Aufgabeweitergabe
- 016 Kauf – Durchlieferung
- 017 Kauf – INVESTRO
- 018 Kauf – Orderschlussnote (nur innerhalb Orderschlussnoten -DT)
- 021 Verkauf – Schlussnote
- 022 Verkauf – Direktgeschäft
- 023 Verkauf – Aufgabe
- 024 Verkauf – Aufgabeschließung
- 025 Verkauf – Aufgabeweitergabe
- 026 Verkauf – Durchlieferung
- 027 Verkauf – INVESTRO
- 028 Verkauf – Orderschlussnote (nur innerhalb Orderschlussnoten -DT)

- 112 Kauf – Xetra
- 122 Verkauf – Xetra

- 212 Kauf – Xetra OTC
- 222 Verkauf – Xetra OTC

- 312 Kauf – Xetra Best
- 322 Verkauf – Xetra Best

- 417 Kauf – Eingabebestätigung
- 427 Verkauf – Eingabebestätigung

- 511 Storno/Kauf – Schlussnote
- 512 Storno/Kauf – Direktgeschäft
- 513 Storno/Kauf – Aufgabe
- 514 Storno/Kauf – Aufgabeschließung
- 515 Storno/Kauf – Aufgabeweitergabe
- 517 Storno/Kauf – INVESTRO

- 521 Storno/Verkauf – Schlussnote
- 522 Storno/Verkauf – Direktgeschäft
- 523 Storno/Verkauf – Aufgabe
- 524 Storno/Verkauf – Aufgabeschließung
- 525 Storno/Verkauf – Aufgabeweitergabe
- 527 Storno/Verkauf – INVESTRO

- 611 Tagesstorno/Kauf – Schlussnote
- 612 Tagesstorno/Kauf – Direktgeschäft
- 613 Tagesstorno/Kauf – Aufgabe
- 614 Tagesstorno/Kauf – Aufgabeschließung
- 615 Tagesstorno/Kauf – Aufgabeweitergabe
- 617 Tagesstorno/Kauf – INVESTRO

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade****Etikett 23 Geschäftsart:****Feld: - Satzart**

Fortsetzung - Möglicher Wertebereich:

621	Tagesstorno/Verkauf – Schlussnote
622	Tagesstorno/Verkauf – Direktgeschäft
623	Tagesstorno/Verkauf – Aufgabe
624	Tagesstorno/Verkauf – Aufgabeschließung
625	Tagesstorno/Verkauf – Aufgabeweitergabe
627	Tagesstorno/Verkauf – INVESTRO
817	Tagesstorno/Kauf – Eingabebestätigung
818	Kauf – Take up (nur innerhalb Xetra-Handels-Schlussnoten-DT)
819	Kauf – Give up (nur innerhalb Xetra-Handels-Schlussnoten-DT)
827	Tagesstorno/Verkauf – Eingabebestätigung
828	Verkauf – Take up (nur innerhalb Xetra-Handels-Schlussnoten-DT)
829	Verkauf – Give up (nur innerhalb Xetra-Handels-Schlussnoten-DT)
913	Löschung/Kauf – Aufgabe
915	Löschung/Kauf – Aufgabenweitergabe
923	Löschung/Verkauf – Aufgabe
925	Löschung/Verkauf – Aufgabenweitergabe

Feld: - SatzartStorno:

Der Satz entspricht dem des Ursprungsgeschäfts und hat folglich identische Vorzeichen wie das Ursprungsgeschäft.

Durchlieferung:

Diese Geschäftsart ist in Bezug auf das Ursprungsgeschäft gedreht. Es entsteht eine neue Geschäftsnummer. Das Feld Schlusstag (Feld 31P) enthält das Datum des Ursprungsgeschäfts. Die Geschäftsnummer des Ursprungsgeschäfts wird in Feld 72 (Ursprüngliche Geschäftsnummer) geliefert.

Das ‚Kennzeichen Eigengeschäft‘ wird wie im Ursprungsgeschäft geliefert!

Tagesstorno:

Diese Nachrichten sind inhaltlich identisch mit den Storno-Nachrichten. Die Nachricht über das Ursprungsgeschäft ist im gleichen Datenträger enthalten (nicht zwingend bei mehreren Datenträgern pro Börsentag).

Aufgabenlöschung:

Es handelt sich hierbei um eine technische Löschung der Aufgabe. Die Folge ist ein Entfernen der Aufgabe aus dem Aufgabenbestand des Maklers. Es erfolgt keine Rückrechnung der angefallenen Courtage. Die Aufgabenlöschung ist nach Ablauf der Stornofrist möglich. Das Feld Schlusstag (31P) enthält den ursprünglichen Schlusstag der Aufgabe. Das Feld Geschäftsnummer (20) enthält die ursprüngliche Geschäftsnummer der Aufgabe.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/
Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

Etikett 23 Geschäftsart:**Feld: - Kennzeichen 'IW-Geschäft':**

Kennzeichen, das für die Kennzeichnung im Meldesatz MT 510 herangezogen werden kann (siehe fachliche Beschreibung TRICE-Benutzerhandbuch für Filetransfer - Geschäftstyp 04).

Feld: - Kennzeichen börslich:

Hier wird die Kennzeichnung eines Geschäftes mit ‚börslich‘ (BS) oder ‚außerbörslich‘ (AB) vorgenommen.

Innerhalb der XONTRO-Handels-Schlussnote ist das Feld:
- bei XONTRO-Order- und XONTRO-Trade-Geschäften immer
- bei INVESTRO-Geschäften g e n e r e l l mit ‚AB‘
- bei Xetra-Geschäften immer

gefüllt.

Feld: - Kennzeichen Eigengeschäft:**- innerhalb der XONTRO-Handels-Schlussnoten**

ist jeweils das ‚Kennzeichen Eigengeschäft‘ des Empfängers der Geschäftsbestätigung (Etikett 72, 2.Zeile) vorhanden. Eine Ausnahme bilden Schlussnoten, bei denen es sich um Eigengeschäfte des Maklers handelt. Hier wird nicht das ‚Kennzeichen Eigengeschäft‘ des Empfängers der Geschäftsbestätigung, sondern das ‚Kennzeichen Eigengeschäft‘ des Eingegers abgebildet.

Bei Bankdirektgeschäften wird dieses Kennzeichen n i c h t gefüllt.

Möglicher Wertebereich:

EE – Eigengeschäft des Maklers
P1 – Eigengeschäft der Bank
A1 – Kundengeschäft der Bank

- innerhalb der Xetra-Handels- und Orderschlussnoten

Möglicher Wertebereich:

A1 – Agent
P1 – Proprietary
M1 – Designated Sponsor
L1 – Liquidity Provider
I1 – Issuer
Q1 – Liquidity Manager
E1 – Best Executor

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/
Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

Etikett 23 Geschäftsart:**Feld: - Kennzeichen Netting - Type:**

Das 'Kennzeichen Netting – Type' wird mit der ersten Stufe der CCP-Einführung bei CCP-Geschäften belegt.

- innerhalb der XONTRO-Handels-Schlussnoten

Ist dieses Feld nicht belegt

- innerhalb der Xetra-Handels-Schlussnoten

Möglicher Wertebereich:

Feld ist nicht belegt – kein Netting
 – Order Level Netting

- innerhalb der Orderschlussnoten

Möglicher Wertebereich:

– Order Level Netting

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/
Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

Etikett 31P: Abschlussangaben**Feld: - Schlusstag:**

Dieses Feld enthält den Schlusstag des Geschäftes.

Feld: - Börsenplatz:

Börse, an der das Geschäft abgeschlossen wurde (Ort des Geschäftsabschlusses im Sinne des Meldewesens).

Möglicher Wertebereich:

096 – CCP-Orderschlussnote
100 – Berlin
110 – Bremen
120 – Düsseldorf
124 – Quotrix
130 – Frankfurt
140 – Hamburg
150 – Hannover
160 – München
170 – Stuttgart
183 – INVESTRO
194 – Xetra

Feld: - Festvaluta-Kennzeichen:

Erfolgte die manuelle Eingabe einer der Zusatzangaben 'FO', 'FV' oder 'FZ' oder wurde eine internationale Festvaluta 'FI' systemseitig gesetzt, so ist dieses Feld mit der entsprechenden Zusatzangabe belegt.

Etikett 30: Datum-Festvaluta enthält in diesen Fällen das zugehörige Datum.

Feld: - Kennzeichen manuelle Eingabe von Zins- bzw. Diskonttagen:

Erfolgte die manuelle Eingabe von Zinstagen über die Zusatzangabe 'ZT' bzw. die manuelle Eingabe von Diskonttagen über die Zusatzangabe 'DT', so wird hier das Kennzeichen 'M' gesetzt.

Die Anzahl der Zinstage ist Etikett 34G/H: zu entnehmen.

Die Anzahl der Diskonttage ist Etikett 71B, 2.Zeile zu entnehmen.

Etikett 30: weitere Abschlussangaben**Feld: - Festvaluta-Kennzeichen:**

Bei manueller Eingabe der Zusatzangaben 'FO', 'FV' oder 'FZ' (siehe Feld 31P - Festvaluta-Kennzeichen) oder bei systemseitiger Einstellung der internationalen Festvaluta 'FI' enthält dieses Feld das entsprechende Festvaluta-Datum.

Erfolgte keine Eingabe bzw. systemseitige Belegung einer Zusatzangabe ist dieses Feld mit '000000' belegt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

Feld: - Eingabe-Uhrzeit:

Die Uhrzeit der Eingabe des Geschäfts im Format HHMM.

Feld: - Börsenplatz des Meldewesens:

Bisher ist der „Börsenplatz des Eingebers“ im Feld 31P immer auch der Börsenplatz, an dem das Geschäft nach § 9 WPHG zustandegekommen ist. In Zukunft sind Konstellationen denkbar, dass Makler eines bestimmten Börsenplatzes sich an der von diesem Börsenplatz betriebenen elektronischen Börse betätigen. Dann muss diese elektronische Börse aus dem neuen Feld gemeldet werden.

Es werden die gleichen Schlüssel wie schon für den „Börsenplatz des Eingebers“ und den „Börsenplatz der Geschäftsnummer“ (Feld 20) verwendet.

Neu ist der Schlüssel 124 für Quotrix.

Da das neue Feld von XONTRO Trade immer versorgt wird, kann es in Zukunft generell für die Meldung nach § 9 WPHG benutzt werden.

Feld: - Kennzeichen „Abweichendes Abschlussdatum“:

Das Kennzeichen wird immer dann gesetzt, wenn das Abschlussdatum in Feld 72, 3. Zeile vom Schlusstag in Feld 31P abweicht. Der Schlüssel ist „AA“.

Feld: - Kennzeichen „Abendbörse“:

Das Kennzeichen ist als reines Vorratsfeld für den Fall der Einführung einer Abendbörse vorgesehen. Es wird im Moment nicht belegt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade****Etikett 35A: - Art und Stückzahl/Nennwert des Wertpapiers**

Das Unterfeld 'Art des Wertpapiers' ist generell mit einem der folgenden Codewörter belegt:

SHS	=	Aktien
BON	=	festverz. Wertpapiere (Stücknotiz)
FMT	=	festverz. Wertpapiere (Prozentnotiz)
OPS	=	Optionsscheine
RTS	=	Rechte
UNT	=	Investments
RTE	=	Genussrechte
WTS	=	Bezugsrechte
MSC	=	Sonstige
XXX	=	'Dummywert'

Etikett 35B: Wertpapierangaben**1. Zeile – Wertpapierkennnummer (ISIN)**

Existiert in den Wertpapier-Stammdaten keine ISIN-WKN, wird programmseitig 'XX0000000000' als Dummywert eingestellt.

3. Zeile**Feld: - Verwahrart**

Möglicher Wertebereich:

000	Keine Feldeingabe
001	GS, Jungscheinkonto bis zum Erscheinen der Stücke
002	GS, Jungscheinkonto, stückelos nach Einlieferung der Globalurkunde(n)
003	GS, eine Globalurkunde für die gesamte Laufzeit
005	GS, interimistische Globalurkunde bis zum Erscheinen der Stücke
006	GS, Schuldbuchgirokonto Einz. Schuldb. Ford.mögl.
007	GS, Schuldbuchgirokonto Einz. Schuldb. Ford. nicht möglich
008	GS, Miteigent. Anteil an Inhaber-Sammelzertifikat der CBF
009	Girosammelverwahrung
010	GS, NGS
011	GS, stückelos effekt. Stöcke nur bei ausl. Lagerstelle ein- und auslieferbar
012	GS, techn. Globalurk. (nicht GS-faeh. Einzelurk.koennen im Umlauf sein).
013	GS, Zentralverwahre Direktverwahrung
014	GS, Rahmenurkunde (BIS-ZU) fuer die gesamte Laufzeit
015	GS, interimistische Rahmenurkunde (BIS-ZU) bis zum Erscheinen d. Stck
016	GS, technische Globalurkunde (BIS-ZU)
019	GS, Miteigentum
020	Streifbandverwahrung
021	Streifbandverwahrung per Erscheinen
022	Streifbandverwahrung sog. Haussammelverwahrung
023	Streifbandverwahrung Schuldbucheintragung, keine GS-Verwahrung
024	STR, nur depotmäßige Einbuchung (keine effekt. Stöcke, keine Globalurk.)
040	Wertpapierrechnung (Stücke effektiv lieferbar)
041	Titel in die Auslandsabwicklung CBF aufgenommen (Stöcke effekt. lieferb.)

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

- 042 Auslandsabwicklung der CBF, Cedel hat Globalurkunde ausgetauscht (Stücke effekt. lieferbar)
- 043 Auslandsabwicklung der CBF, Cedel in interimist. Globalurkunden
- 044 Titel in Auslandsabwicklung der CBF (nicht effektiv lieferbar)
- 045 Auslandsabw. der CBF, Cedel in perm. Globalurkunden (Stücke n. Eff. lief.)
- 046 Auslandsabwicklung der CBF, in interimistischen Globalurkunden
- 047 Auslandsabwicklung der CBF, in permanenten Globalurkunden
- 048 Auslandsabwicklung der CBF, Globalurkunden wurden ausgetauscht
- 049 Wertpapierrechnung (Stücke nicht effektiv lieferbar)
- 088 Streifband, Sonstige (Indices, Derivate, etc.)
- 091 Streifband, Haussammelverwahrung bei Interims-WKN
- 092 Streifband bei Interims-WKN
- 093 Wertpapierrechnung bei Interims-WKN
- 096 GS, CBF-Eing., GS-IGL bei Interims-WKN
- 097 GS, CBF-Eing GS bei Interims-WKN
- 098 GS, CBF-Eing GS-SVG bei Interims-WKN
- 099 AKV-Interne WKN Ausland bei Interims-WKN

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade****Etikett 35B: Wertpapierangaben****3. Zeile****Feld: - Zinstermin**

Möglicher Wertebereich:

tt.01.G	tt. Januar ganzjährig
tt.02.G	tt. Februar ganzjährig
tt.03.G	tt. März ganzjährig
tt.04.G	tt. April ganzjährig
tt.05.G	tt. Mai ganzjährig
tt.06.G	tt. Juni ganzjährig
tt.07.G	tt. Juli ganzjährig
tt.08.G	tt. August ganzjährig
tt.09.G	tt. September ganzjährig
tt.10.G	tt. Oktober ganzjährig
tt.11.G	tt. November ganzjährig
tt.12.G	tt. Dezember ganzjährig
tt.J/J	tt. Januar/Juli halbjährig
tt.F/A	tt. Februar/August halbjährig
tt.M/S	tt. März/September halbjährig
tt.A/O	tt. April/Oktober halbjährig
tt.M/N	tt. Mai/November halbjährig
tt.J/D	tt. Juni/Dezember halbjährig
31M01O	31. März/01. Oktober halbjährig
tt.01.4M	tt. Januar/Mai/September viermonatlich
tt.02.4M	tt. Februar/Juni/Oktober viermonatlich
tt.03.4M	tt. März/Juli/November viermonatlich
tt.04.4M	tt. April/August/Dezember viermonatlich
tt.01.VJ	tt. Januar/April/Juli/Oktober vierteljährlich
tt.02.VJ	tt. Februar/Mai/August/November vierteljährlich
tt.03.VJ	tt. März/Juni/September/Dezember vierteljährlich
tt.01.2M	tt. ab Januar zweimonatlich
tt.02.2M	tt. ab Februar zweimonatlich
tt.01.1M	tt. monatlich
tt.01.9M	tt. Januar/Oktober neunmonatlich
tt.02.9M	tt. Februar/November neunmonatlich
tt.03.9M	tt. März/Dezember neunmonatlich
tt.04.9M	tt. April/Januar neunmonatlich
tt.05.9M	tt. Mai/Februar neunmonatlich
tt.06.9M	tt. Juni/März neunmonatlich
tt.07.9M	tt. Juli/April neunmonatlich
tt.08.9M	tt. August/Mai neunmonatlich
tt.09.9M	tt. September/Juni neunmonatlich
tt.10.9M	tt. Oktober/Juli neunmonatlich
tt.11.9M	tt. November/August neunmonatlich
tt.12.9M	tt. Dezember/September neunmonatlich
tt.01.5M	tt. Januar/Juni/November fünfmonatlich
tt.02.5M	tt. Februar/Juli/Dezember fünfmonatlich
tt.03.5M	tt. März/August/Januar fünfmonatlich
tt.04.5M	tt. April/September/Februar fünfmonatlich

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTR0 Trade**

tt.05.5M	tt. Mai/Oktober/März fünfmonatlich
tt.06.5M	tt. Juni/November/April fünfmonatlich
tt.07.5M	tt. Juli/Dezember/Mai fünfmonatlich
tt.08.5M	tt. August/Januar/Juni fünfmonatlich
tt.09.5M	tt. September/Februar/Juli fünfmonatlich
tt.10.5M	tt. Oktober/März/August fünfmonatlich
tt.11.5M	tt. November/April/September fünfmonatlich
tt.12.5M	tt. Dezember/Mai/Oktober fünfmonatlich
tt.01.7M	tt. Januar/August siebenmonatlich
tt.02.7M	tt. Februar/September siebenmonatlich
tt.03.7M	tt. März/Oktober siebenmonatlich
tt.04.7M	tt. April/November siebenmonatlich
tt.05.7M	tt. Mai/Dezember siebenmonatlich
tt.06.7M	tt. Juni/Januar siebenmonatlich
tt.07.7M	tt. Juli/Februar siebenmonatlich
tt.08.7M	tt. August/März siebenmonatlich
tt.09.7M	tt. September/April siebenmonatlich
tt.10.7M	tt. Oktober/Mai siebenmonatlich
tt.11.7M	tt. November/Juni siebenmonatlich
tt.12.7M	tt. Dezember/Juli siebenmonatlich
tt.01.8M	tt. Januar/September achtmonatlich
tt.02.8M	tt. Februar/Oktober achtmonatlich
tt.03.8M	tt. März/November achtmonatlich
tt.04.8M	tt. April/Dezember achtmonatlich
tt.05.8M	tt. Mai/Januar achtmonatlich
tt.06.8M	tt. Juni/Februar achtmonatlich
tt.07.8M	tt. Juli/März achtmonatlich
tt.08.8M	tt. August/April achtmonatlich
tt.09.8M	tt. September/Mai achtmonatlich
tt.10.8M	tt. Oktober/Juni achtmonatlich
tt.11.8M	tt. November/Juli achtmonatlich
tt.12.8M	tt. Dezember/August achtmonatlich
tt.01.ZM	tt. Januar/November zehnmonatlich
tt.02.ZM	tt. Februar/Dezember zehnmonatlich
tt.03.ZM	tt. März/Januar zehnmonatlich
tt.04.ZM	tt. April/Februar zehnmonatlich
tt.05.ZM	tt. Mai/März zehnmonatlich
tt.06.ZM	tt. Juni/April zehnmonatlich
tt.07.ZM	tt. Juli/Mai zehnmonatlich
tt.08.ZM	tt. August/Juni zehnmonatlich
tt.09.ZM	tt. September/Juli zehnmonatlich
tt.10.ZM	tt. Oktober/August zehnmonatlich
tt.11.ZM	tt. November/September zehnmonatlich
tt.12.ZM	tt. Dezember/Oktober zehnmonatlich
tt.01.EM	tt. Januar/Dezember elfmonatlich
tt.02.EM	tt. Februar/Januar elfmonatlich
tt.03.EM	tt. März/Februar elfmonatlich
tt.04.EM	tt. April/März elfmonatlich
tt.05.EM	tt. Mai/April elfmonatlich
tt.06.EM	tt. Juni/Mai elfmonatlich
tt.07.EM	tt. Juli/Juni elfmonatlich
tt.08.EM	tt. August/Juli elfmonatlich
tt.09.EM	tt. September/August elfmonatlich
tt.10.EM	tt. Oktober/September elfmonatlich

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

tt.11.EM	tt. November/Oktober elfmonatlich
tt.12.EM	tt. Dezember/November elfmonatlich
tt.01.ZJ	tt. Januar zweijährig
tt.02.ZJ	tt. Februar zweijährig
tt.03.ZJ	tt. März zweijährig
tt.04.ZJ	tt. April zweijährig
tt.05.ZJ	tt. Mai zweijährig
tt.06.ZJ	tt. Juni zweijährig
tt.07.ZJ	tt. Juli zweijährig
tt.08.ZJ	tt. August zweijährig
tt.09.ZJ	tt. September zweijährig
tt.10.ZJ	tt. Oktober zweijährig
tt.11.ZJ	tt. November zweijährig
tt.12.ZJ	tt. Dezember zweijährig
FLAT/ZE	kein Zinstermin; Zahlung am Ende der Laufzeit
FLAT/KZ	kein Zinstermin
ABZINS	Abzinsung (nur ADCA-Sparbrief)

3. Zeile**Feld: - Poolfaktor/Umrechnungsfaktor**

Bei Wertpapieren mit Poolfaktor (u.a. ABS-Papiere) wird die Tilgung am Stück durch einen Poolfaktor ausgedrückt. Der Kurswert errechnet sich wie folgt:

$$\text{Kurswert} = \text{Nominale} \times \text{Kurs} \times \text{Poolfaktor}$$

Bei Young-Fundierungsschuldverschreibungen muss bei der Ermittlung des Kurswertes ein Umrechnungsfaktor beachtet werden. Der Kurswert errechnet sich wie folgt:

$$\text{Kurswert} = \text{Nominale} \times \text{Kurs} \times \text{Umrechnungsfaktor} \times \text{Devisenkurs} \\ (\text{falls vorhanden})$$

4. Zeile**Feld: - Serien-Wertpapierkennnummer**

Wenn der Verkäufer in einer Serien-Wertpapierkennnummer (WKN) handelt, wird die Serien-WKN in der ersten Zeile des Etiketts 35B geliefert und die 4. Zeile dieses Feldes bleibt leer. Die zugehörige Stamm-WKN wird in Etikett 72/2. Zeile geliefert.

Wenn der Verkäufer/Käufer in einer Stamm-WKN handelt, wird die 1. Serien-WKN in Zeile 4 eingestellt. In Feld 72/2. Zeile wird ebenfalls noch einmal die Stamm-WKN eingestellt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/

Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade

Etikett 82D: Kontrahent

Parkettgeschäfte:

Das Etikett 82D ist bei Parkettgeschäften nicht belegt.

Xetra / Orderschlussnoten

Das Etikett 82D ist bei Xetra / Orderschlussnoten immer mit dem **Abwicklungsinstitut** der Gegenseite belegt, auch wenn das **Abwicklungsinstitut** selbst als Xetra-Teilnehmer an dem Geschäft beteiligt ist. Dies gilt sowohl für die Handels- als auch für die Orderschlussnoten.

Etikett 87F: Käufer/Verkäufer

Das Etikett 87F enthält die Gegenseite des Geschäfts.

Die Spezifizierung erfolgt über die Konstanten:

,C' für Käufer

,D' für Verkäufer

Xetra / Orderschlussnoten:

Das Etikett 87F enthält die Xetra-Teilnehmer, wobei folgende Regeln gelten: Dies gilt sowohl für die Handels- als auch für die Orderschlussnoten.

1. Beide Teilnehmer sind zusätzlich Abwicklungsinstitute:

- Etikett 87F enthält auf beiden Schlussnoten jeweils den Xetra / Orderschlussnoten – Teilnehmer der Gegenseite.

2. Ein Teilnehmer ist Abwicklungsinstitut:

- Etikett 87F enthält auf beiden Schlussnoten den Xetra / Orderschlussnoten – Teilnehmer, das nicht **Abwicklungsinstitut** ist.

3. Keiner der beiden Teilnehmer sind Abwicklungsinstitute:

Etikett 87F enthält auf beiden Schlussnoten den Xetra / Orderschlussnoten - Teilnehmer der eigenen Seite und den Teilnehmer der Gegenseite.

=> **Etikett 87F ist in diesem Fall 2 mal vorhanden!**

Lfd . Nr.	Geschäftsvorfall Xetra / Orderschlussnoten	Empfänger der SNO	Geschäftsart der SNO	Feld 82D KONT	Feld 87F Käufer/Verkäufer
1	7998 verkauft an 1998	7998 1998	Verkauf - Xetra/OTC/Best Kauf - Xetra/OTC/Best	1998 7998	C/1998 (Käufer) D/7998 (Verkäufer)
2	7998 verkauft an 7899 7899 settlement über 1998	7998 1998	Verkauf - Xetra/OTC/Best Kauf - Xetra/OTC/Best	1998 7998	C/7899 (Käufer) C/7899 (Käufer)
3	7899 verkauft an 1899 7899 settlement über 7998 1899 settlement über 1998	7998 1998	Verkauf - Xetra/OTC/Best Kauf - Xetra/OTC/Best	1998 7998	C/1899 (Käufer) D/7899 (Verkäufer) C/1899 (Käufer) D/7899 (Verkäufer)

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade****Etikett 71C: Gebühren und Spesen*****Feld: - Courtage-Betrag***

Bei maklervermittelten Geschäften fließt die Courtage nicht in den Abrechnungsbetrag mit ein.

Bei Bankdirektgeschäften wird bei negativem Courtagebetrag vom Abrechnungsbetrag subtrahiert, bei positivem Vorzeichen wird die Courtage zum Abrechnungsbetrag addiert.

Staffel 1 für Renten:

Wird seit dem 01.09.1999 nicht mehr verwendet!

Staffel 2 für Renten:

Für Anleihen von Bund, Bahn, Post, Länder, KfW und Dt. Ausgleichsbank, Staatsbank Berlin, Treuhandanstalt, ERP, Fonds "Deutsche Einheit", Deutsche Reichsbahn und Ausgleichsfonds Währungsumstellung, Fundierungsschuldverschreibungen.

Bei nicht auf Euro lautenden Emissionen wird die Nominale in Euro umgerechnet.

0	= bis	25.000	0,7500 ‰	vom Nennwert; min. 0,75
1	= über bis	25.000 50.000	0,4000 ‰	vom Nennwert; min. 18,75
2	= über bis	50.000 125.000	0,2800 ‰	vom Nennwert; min. 20,00
3	= über bis	125.000 250.000	0,2600 ‰	vom Nennwert; min. 35,00
4	= über bis	250.000 500.000	0,1600 ‰	vom Nennwert; min. 65,00
A	= über bis	500.000 1.000.000	0,1000 ‰	vom Nennwert; min. 80,00
B	= über bis	1.000.000 1.500.000	0,0750 ‰	vom Nennwert; min. 100,00
C	= über bis	1.500.000 2.000.000	0,0625 ‰	vom Nennwert; min. 112,50
D	= über bis	2.000.000 2.500.000	0,0600 ‰	vom Nennwert; min. 125,00
E	= über bis	2.500.000 3.500.000	0,0500 ‰	vom Nennwert; min. 150,00
F	= über bis	3.500.000 5.000.000	0,0400 ‰	vom Nennwert; min. 175,00
G	= über bis	5.000.000 15.000.000	0,0300 ‰	vom Nennwert; min. 200,00

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

H	= über	15.000.000			
	bis	25.000.000	0,0250 ‰		vom Nennwert; min. 450,00
I	= über	25.000.000			
	bis	50.000.000	0,0200 ‰		vom Nennwert; min. 625,00
J	= über	50.000.000	0,0150 ‰		vom Nennwert; min. 1.000,00

Staffel 3 für Renten:

Für Optionsanleihen cum und Wandelanleihen; für auf Reichsmark lautende Emissionen; für %-notierte Genussscheine; für Zerobonds und Asset Backed Securities (ABS) auf Basis des Kurswertes.

Für die übrigen Emissionen, die nicht in der Rentenstaffel 2 berücksichtigt werden; für Indexzertifikate auf Basis des Kurswertes. Bei nicht auf Euro lautenden Emissionen wird die Nominale in Euro umgerechnet.

0	= bis	25.000	0,7500 ‰		vom Nennwert; min. 0,75
1	= über	25.000			
	bis	50.000	0,4000 ‰		vom Nennwert; min. 18,75
2	= über	50.000			
	bis	125.000	0,2800 ‰		vom Nennwert; min. 20,00
3	= über	125.000			
	bis	250.000	0,2600 ‰		vom Nennwert; min. 35,00
4	= über	250.000			
	bis	500.000	0,1600 ‰		vom Nennwert; min.65,00
5	= über	500.000			
	bis	1.000.000	0,1200 ‰		vom Nennwert; min. 80,00
6	= über	1.000.000			
	bis	2.500.000	0,0800 ‰		vom Nennwert; min. 120,00
7	= über	2.500.000	0,0600 ‰		vom Nennwert: min. 200,00

Staffel für Aktien.Bezugsrechte und Optionsscheine sowie stücknotierte Genussscheine:

Für die Aktienwerte des DAX-30 wird an allen Börsenplätzen

0,4 ‰ des Kurswertes, mind. 0,75 EUR

und für alle übrigen Werte

0,8 ‰ des Kurswertes, mind. 0,75 EUR (Börsenplatz Berlin: 0,4 ‰ ab 01.04.01)

berechnet.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade****Feld: - Courtage-Schlüssel**

Die Ziffern in der ersten Spalte stellen den Courtage-Schlüssel aus den jeweiligen Courtage Staffeln dar.

Hierbei ist zu beachten, daß Schlussnoten, die aus der Zuteilung heraus erstellt werden, keinen Courtage-Schlüssel erhalten, da in diesem Fall evtl. Die Ursprungsnominale verändert wurde.

Feld: - Courtage-Zusatzangabe

Die Courtage-Zusatzangabe ‚PC‘, die nur bei maklervermittelten Geschäften erfaßt werden kann, wird z.Zt. innerhalb des Datenträgers in ‚AC‘ umgesetzt.

Der Einsatztermin für die Abbildung der Zusatzangabe Prozentcourtage ‚PC‘ innerhalb des Datenträgers wird noch bekanntgegeben.

Etikett 71B: Abrechnungsdaten Finanzierungsschätze**2. Zeile****Feld: - Diskonttage / Diskontbetrag**

Diskonttage und Diskontbetrag werden generell ohne Vorzeichen geliefert. In dem Falle, dass das Feld Diskontsatz oder Diskonttage mit Null belegt ist, werden trotzdem alle Felder gefüllt.

Etikett 72: Information Sender an Empfänger**1. Zeile****Feld: - Eingeber**

Dieses Feld enthält die 4-stellige KV-Nummer der eingebenden Bank bzw. des eingebenden Maklers.

- bei Xetra - Geschäften wird die Eingebenummer '7501',
- bei INVESTRO - Geschäften wird die 4-stellige KV-Nummer des Auftrags-empfängers
- in den Orderschlussnoten wird die Eingebenummer '8501' verwendet.

Für ETS - Geschäfte wird eine neue Eingebenummer eingerichtet. Diese wird kurzfristig nachgereicht.

Feld: - Ursprünglicher Makler/ - Geschäftsnummer/ - Schlusstag

Die Kombination der Felder 'Ursprünglicher Makler', 'Ursprüngliche Geschäftsnummer' und 'Ursprünglicher Schlusstag' ist nur bei Aufgabenschließungen und Aufgabenweitergaben möglich.

Durchlieferungen beinhalten die Felder 'Ursprüngliche Geschäftsnummer' und 'Ursprünglicher Schlusstag'.

Außerdem kann auch bei der Schließung von taggleichen Aufgaben und den daraus resultierenden Schlussnoten ein 'Ursprünglicher Schlusstag' angezeigt werden.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade****Etikett 72: Information Sender an Empfänger****2. Zeile****Feld: - Empfänger der Geschäftsbestätigung**

Dieses Feld enthält die 4-stellige KV-Nummer der empfangenden Bank der Geschäftsbestätigung. Es handelt sich um das Institut (Filiale oder Zentrale), das am Geschäftsabschluss beteiligt war. Im Header der Nachricht steht generell die SWIFT-Adresse der Zentrale bei allen Nachrichten.

Wurde im Rahmen der Verarbeitungssteuerung die Auswahl ‚Incl. Filialen‘ getroffen, steht hier die Filialnummer, deren Daten die Zentrale erhält.

Feld: - WKN

Das Feld wird im Format an die geplante Umstellung der numerischen auf die alphanumerische WKN angepasst. Es wird von mandatory auf optional geändert, weil die alphanumerische WKN nur eine Zwischenlösung bis zur generellen Einführung der ISIN sein wird.

XONTRO Trade wird das Feld versorgen, sofern und solange es verfügbar ist.

Feld: - Ausgabeaufschlag

Das Feld ist als reines Vorratsfeld vorgesehen. Über die Befüllung wird im Rahmen des nächsten INVESTRO-Releases entschieden.

3. Zeile**Feld: - (Abweichendes) Abschlussdatum / - Abschlussuhrzeit**

Dieses Feld dient der Meldepflicht gemäß §9 WpHG und ist derzeit immer identisch mit dem (ggf. Abweichenden) Schlusstag (Etikett 31P).

Ab 29.10.2001 kann dieses Feld mit einem ‚Abweichenden Abschlussdatum‘ belegt sein, welches **k e i n** Börsentag ist. Hiermit sollen die Geschäfte abgebildet werden, die von den Teilnehmern außerhalb der Börsentage abgeschlossen werden. In diesen Fällen ist das Abschlussdatum nicht mehr identisch mit dem (ggf. Abweichenden) Schlusstag (Etikett 31P)!

Feld: - Xetra: Trade-Code-Suffix

Durch das Order Level Netting wird zukünftig bei jeder Teilausführung in Xetra ein Update (durch hochzählen des Suffix) auf den Trade getätigt und keine neue Tradenummer vergeben. Deshalb werden unter ein und derselben Geschäftsnummer (Etikett 20) mehrere Xetra-Handels-Schlussnoten im Handels-Schlussnoten-DT sein. Um die Eindeutigkeit zwischen den einzelnen Xetra-Handels-Schlussnoten zu gewährleisten, wird der ‚Xetra: Trade Code Suffix‘ mit Einsatz des CCP in de Xetra-Handels- und -Orderschlussnoten aufgenommen. Aus diesem Grund wird der Text ‚Xetra / – Geschäftsnummer‘ in Etikett 72 Zeile 3 in ‚Xetra:Trade-Code-Suffix‘ geändert und der o.g. Wert anstelle Xetra-Geschäftsnummer eingestellt.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/
Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

Feld: - Identifizierungs-KennzeichenXONTRO Trade Direktgeschäfte

Hier werden die letzten 6 Stellen des Identifizierungs-Kennzeichens des Eingegers dokumentiert.

Xetra – Geschäfte

Bei Xetra-Geschäften wird in diesem Feld die Händlernummer geliefert, die sich aus dem „User Group Code“ und dem „User Id Code“ zusammensetzt. (Der User Group Code wäre zum Beispiel 'TRD' und der User Id Code '001'.)

4. Zeile**Feld: - Textfeld**

In diesem Feld wird der Text aus XONTRO Trade, XONTRO Order, Xetra, ETS bzw. INVESTRO angezeigt.

Besonderheit bei Xetra – Geschäften

Mit dem Xetra® Release 7.0 wird die in Xetra eingegebene Executor ID als zusätzliche Information in das Textfeld des Schlussnoten-Datenträgers integriert, indem die Executor ID (Format 5x) an das von Xetra übernommene Textfeld, durch „/“ getrennt, angehängt wird. Daraus ergibt sich für Schlussnoten, die für Xetra Geschäfte erstellt werden, das folgende Format für das Textfeld:

XETRA/Textfeldxxxx/ABCFR

Die Best Executor ID setzt sich aus der Best Executor Institute ID (Format 3x) und der Best Executor Branch ID (Format 2x) zusammen.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/
Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

Etikett 72: Information Sender an Empfänger

Die folgenden Felder werden nur von INVESTRO-Teilnehmern benötigt!

5. Zeile**Feld: - Bonisatz**

Es handelt sich hierbei um den Bonisatz aus der Konditionstabelle INVESTRO:

- es wird der Bonisatz 1 eingestellt, wenn der Kauf nicht zur Wiederanlage erfolgte,
- es wird der Bonisatz 2 eingestellt, wenn der Kauf zur Wiederanlage erfolgte.

Feld: - Wiederanlagerabatt

Es handelt sich um den Wiederanlagerabatt aus WSS.

Das Feld wird gefüllt, sofern ein Wiederanlagerabatt in WSS hinterlegt ist.

Feld: - Zwischengewinn

Es handelt sich um den Zwischengewinn aus WSS.

Das Feld wird gefüllt, sofern ein Zwischengewinn in WSS hinterlegt ist.

Bei einem negativen Zwischengewinn wird das entsprechende negative Vorzeichen in Etikett 72, 2. Zeile abgebildet.

6. Zeile**Feld: - Ausgabepreis**

Es handelt sich um den Ausgabepreis aus WSS.

Das Feld wird gefüllt bei Kaufaufträgen, die zum Wiederanlagepreis oder zum Rücknahmepreis preisausgezeichnet wurden.

Feld: - akkumulierter, ausschüttungsgleicher Ertrag

Es handelt sich um den akkumulierten, ausschüttungsgleichen Ertrag aus WSS.

Das Feld wird gefüllt, sofern ein akkumulierter, ausschüttungsgleicher Ertrag in WSS hinterlegt ist.

Bei einem negativen akkumulierten ausschüttungsgleichen Ertrag wird das entsprechende negative Vorzeichen in Etikett 72, 2. Zeile abgebildet.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/
Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade**

Dieses Etikett wird mit der Einführung des CCP relevant werden.

Etikett 57B: Informationen bei einem CCP-Geschäft***Feld: Kennzeichen 'CCP-Geschäft':***

Alle Parkett- und Xetra-Geschäfte die zu einem CCP-Geschäft führen, werden als solche gekennzeichnet. Diese CCP-Geschäfte sind im Brutto Liefermanagement (BLM) des CCP enthalten.

Feld: Clearing Teilnehmer

Hier wird der Clearer des Handelsteilnehmers (= NCM gemäß CCP-Kriterien) bei einem CCP-Geschäft (Xetra und Parkett) mit seiner CBF-Nummer mitgeteilt. In den Fällen, wo ein Eintrag in den Kundenstammdaten nicht vorhanden ist, wird dieses Feld nicht belegt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/**Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRON Trade****Free-Form-Nachricht (MT 599)**

(Zuordnung von Orders zu Schlussnoten)

Funktion: Dieser Nachrichtentyp wird zur Übermittlung der von einer Schlussnote betroffenen Orders und deren Nominalen verwendet, sofern eine Referenzierung gemäß Parametrisierung in der Verarbeitungssteuerung gewählt wurde.

Dieser Nachrichtentyp wird nur in Verbindung mit einem MT512 angewendet.
(Weitere Hinweise siehe MT512, Feld 21:)

MT 599	FREE-FORM-NACHRICHT	
O/M ETIKETT	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
M 20:	Auftragsnummer (TRN, lfd.Nr.)	6nZn
M 79:	1.Zeile: Geschäftsnummer, der die nachfolgenden Angaben (2.-35-Zeile) zuzuordnen sind (Feld 20 aus MT512)	3n6nZn
	2.-35. Zeile: Unterfeld 01: DWZ-Order-Nr. aus MT 596 mit Voranstellung 'DWZ' als Konstante <u>oder</u> bankinterne Order-Nr. aus MT 500/501	DWZ6nZn 16x
	Unterfeld 02: Art des Wertpapiers (analog Feld 35A) Stück oder Nennwert (Nominale)	/3a 10n, 3n

Regeln Wurde das Kennzeichen 'Bankinterne Ordernummer' in der Verarbeitungssteuerung ausgewählt und sind keine bankinternen Ordernummern vorhanden, wird im Unterfeld 01 die DWZ-Ordernummer (ohne Konstante DWZ) eingestellt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten/

Geschäftsbestätigungen/ECCP-Geschäfte aus XONTRO Trade

Vorsatz und Endesatz für Schlussnoten-Datenträger aus XONTRO Trade (MT598)

Funktion: Dieser Nachrichtentyp wird für den Vor- und Endesatz des Schlussnoten Datenträgers aus XONTRO Trade verwendet.

MT 598		VORSATZ/ENDESATZ FÜR SCHLUSSNOTEN-DATENTRÄGER	
O/M	ETIKETT	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
M	20:	Auftragsnummer (TRN) - JJMMTT (Börsentag) - Lfd. Nr.	6nZn 6n Zn
M	12:	Nachrichtentyp, der in dieser Nachricht übermittelt wird 000 - Vorsatz 002 - Endesatz	3n
M	77E:	Nachricht gem. besonderer Vereinbarung (siehe Regeln)	73x

Regeln:

Feld 20 (Ifd. Nr.):

Dieses Feld enthält die DWZ-interne Übertragungsnummer pro Bank. Sie wird für alle von XONTRO Trade übermittelten Übertragungen pro Bank und Börsentag fortlaufend hochgezählt. Die DWZ-internen Übertragungsnummern in Vor- und Nachsatz sind pro übertragenem Stapel identisch.

Feld 77E:

Vorsatz einer Übertragung (Feld 12: 000)

Übertragungskennung 10x6n6n6n/[1a]

'BOEGA-SDT ' (Parkett-Datenträger) 10x

oder

'BOEGA-SDTX' (separater Xetra - Datenträger)

oder

'BOEGA-SDTS' (separater Orderschlussnoten – DT;

wird mit Einsatz des CCP erstellt.)

oder

'BOEGA-SDTB' (separater ETS - Datenträger)

Erstellungsdatum (JJMMTT) 6n

Erstellungsuhrzeit (HHMMSS) 6n

Börsentag (JJMMTT) 6n

Kennzeichen - letzte Übertragung von XONTRO TRADE- [1a]

SDT vom Börsentag 'L' - letzte Übertragung

Endesatz einer Übertragung (Feld 12: 002)

Übertragungskennung 'BOEGA-SDT ' 10x6n/10n,3n/12n,2n

Anzahl übertragener Sätze (inkl. Vor- und Endesatz) 10x

Nominalbetrag (Feld 35A; Addition aus allen MT512; 6n

Überlauf wird vernachlässigt) /10n,3n

Abrechnungsbetrag (Feld 34B; Addition aus allen /12n,2n

MT512; Überlauf wird vernachlässigt)

XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 7

INHALTSVERZEICHNIS

1	Zusammenfassung	2
2	Fachliche Erläuterungen	3
2.1	CCP	3
2.2	Berliner Börse.....	3
3	Technische Erläuterungen zum Schlussnotendatenträger	4
3.1	Wesentliche Änderungen wegen der Einführung des CCP	4
3.2	Wesentliche Änderungen wegen der Einführung des ETS	7

1 Zusammenfassung

In XONTRO® werden mit Einführung des CCP bzw. des neuen Handelssystems der Berliner Börse (ETS) folgende Änderungen wirksam:

- Neue Ausprägungen in bestehenden Feldern
- Einführung neuer Felder im Zusammenhang mit dem CCP
- Erstellung eines separaten Datenträgers für Orderschlussnoten
- Erstellung eines separaten Datenträgers für Geschäfte aus ETS

2 Fachliche Erläuterungen

2.1 CCP

Die Frankfurter Wertpapierbörse plant die Einführung eines zentralen Kontrahenten (CCP) für den Aktienhandel auf Xetra und XONTRO.

Eine detaillierte Beschreibung der Auswirkungen auf die Handelssysteme XONTRO/Xetra kann dem gleichnamigen Dokument entnommen werden.

Änderungen am Schlussnotendatenträger werden in einem separaten Kapitel aufgeführt. Diese werden erst mit der Einführung des CCP im 1.Quartal 2003 produktiv eingesetzt, stehen aber bereits während der CCP-Simulationsphase ab Mitte November 2002 zur Verfügung. Bitte beachten Sie, dass ca. 14 Tage vor Beginn der Simulation im IMS27 die beschriebenen Änderungen aktiv sind. Auch für diejenigen Banken und Vendors, die zu diesem Zeitpunkt noch nicht an der Simulation teilnehmen möchten, enthält der Schlussnotendatenträger aus IMS27 bereits die neuen CCP-Informationen. Aus diesem Grund ist allen Schlussnotenbeziehern zu empfehlen, ihre Verarbeitungsprogramme an die Änderungen des Schlussnotendatenträgers bereits bis zum November 2002 anzupassen. Genaue Informationen über den zeitlichen Ablauf und Inhalt der Simulation erhalten Sie zu gegebener Zeit direkt vom CCP-Projekt zur Verfügung gestellt.

2.2 Berliner Börse

Die Berliner Börse plant die Einführung eines neuen elektronischen Handelssystems (ETS). Geschäfte, die in ETS entstehen, werden einmal täglich – nach Handelsende – an XONTRO übertragen und von dort zur Abwicklung an die Clearstream Banking Frankfurt übergeben. Für die Teilnehmer der Berliner Börse wird, sofern sie XONTRO-Datenträgerbezieher sind, standardmäßig ein separater SNO-File erstellt, der nur die Geschäfte aus ETS enthält.

Die Simulation für das ETS ist für den Herbst 2002 vorgesehen.

Aus diesem Grund ist allen Schlussnotenbeziehern, die Geschäfte aus dem ETS verarbeiten wollen, zu empfehlen, ihre Verarbeitungsprogramme rechtzeitig an die Änderungen des Schlussnotendatenträgers anzupassen.

Genaue Informationen über den zeitlichen Ablauf und Inhalt der Simulation erhalten Sie zu gegebener Zeit direkt vom Projekt zur Verfügung gestellt.

3 Technische Erläuterungen zum Schlussnotendatenträger

Für die zum Einsatz kommende Version 19.2 des Schlussnotendatenträgers liegen nunmehr weitere Informationen vor.

Wir haben daher die Beschreibung des Schlussnotendatenträgers aktualisiert und bei dieser Gelegenheit noch einige weitere Klarstellungen vorgenommen. In der Neufassung der Beschreibung beachten sie bitte die Änderungsmarkierungen.

Die vollständige Dokumentation des Schlussnotendatenträgers und der technischen Anbindung entnehmen sie bitte unserer Homepage www.xontro.de unter der Rubrik Produkte/XONTRO/Dokumentation/Kreditinstitute/Systemanschluss.

3.1 Wesentliche Änderungen wegen der Einführung des CCP

1. **ALT:** Settlement-Schlussnote **NEU:** Order-Schlussnote

Aufgrund der Einführung des CCPs werden in XONTRO Handelsschlussnoten und Order-Schlussnoten erstellt. Über die Verarbeitungssteuerung besteht für die Schlussnotenbezieher die Möglichkeit zu wählen, ob Handels- und Orderschlussnoten oder nur Handelsschlussnoten generiert werden sollen.

Xetra-Teilnehmer, die in Xetra keine Aggregation auf Orderebene gewählt haben, erhalten für ihre Xetra-Geschäfte gegen den zentralen Kontrahenten wie bisher ausschließlich Handelsschlussnoten. Das Feld: Kennzeichen Netting – Type ist in dieser Handelsschlussnote nicht belegt.

XONTRO-Teilnehmer erhalten für ihre XONTRO-Geschäfte gegen den zentralen Kontrahenten ebenfalls ausschließlich Handelsschlussnoten, da die Möglichkeit zur Aggregation auf Orderebene nur für Xetra-Geschäfte besteht.

Xetra-Teilnehmer, die in Xetra eine Aggregation auf Orderebene gewählt haben, erhalten für ihre Xetra-Geschäfte gegen den zentralen Kontrahenten optional zusätzlich Orderschlussnoten zur Verfügung gestellt. Diese beinhalten u.a. die orderbezogene aggregierte Information („Menge“, „Ausmachender Betrag“), die zur Disposition der Geschäfte auf Orderebene notwendig ist.

Die Order-Schlussnoten erhalten zur Unterscheidung zu den Handelsschlussnoten die neuen Satzarten 018 (Kauf) und 028 (Verkauf) und einen neuen Börsenplatz (096). Als weiteres Unterscheidungskriterium zu den bisherigen SNO-Datenträgern enthält der Vorsatz die Übertragungskennung BOEGA-SDTS. Das Feld: Kennzeichen Netting – Type ist in der Handelsschlussnote und in der Orderschlussnote mit O belegt.

2. Neues Etikett O 57B: Informationen bei einem CCP-Geschäft

Das neue Etikett enthält die beiden Felder

- Kennzeichen CCP-Geschäft
- CBF-Nummer des Clearing-Teilnehmers

3. Rollen von Xetra-Teilnehmern

Mit der Einführung des CCP wird die Eurex Clearing-Struktur in die existierende Handels- und Abwicklungsstruktur des Kassamarktes integriert. Dies führt zu einer Unterscheidung zwischen den Bereichen Handel, Clearing und Abwicklung. Aus diesem Grund haben wir in der Beschreibung der Etiketten 82D: Kontrahent und Etikett 87F: Käufer/Verkäufer redaktionelle Änderungen vorgenommen. Der bisher so genannte Xetra-Clearer wird nunmehr terminologisch korrekt als Settlement Institution respektive Abwicklungsinstitut bezeichnet.

Eine genaue Rollen-Beschreibung aus Sicht des CCP findet sich im Dokument „Zentraler Kontrahent Aktien (CCP) – Clearing Leitfaden“.

4. Wo steht der Kontrahent CCP?

Mit der Einführung des CCP wird in den bisherigen Feldern 82D und/oder 87F anstelle des heutigen Kontrahenten der CCP als Kontrahent aufgeführt werden. Es ändert sich somit nichts an der heutigen Verarbeitungslogik in Ihren In-House-Systemen. Anstelle einer Bank wie z.B. die 7003 für ein Geschäft in Frankfurt, steht nunmehr der CCP mit der vom Handelsplatz abhängigen CBF-Nummer, für Frankfurt ist das 8501.

Mit der Einführung des CCP an den Regionalbörsen wird die jeweils dort gültige CBF-Nummern des CCP aufgeführt sein. Für das generelle Erkennen von CCP-Geschäften empfehlen wir Ihnen das neue Feld im Etikett 57B Kennzeichen CCP-Geschäft und nicht die Abfrage auf CBF-Nummern des CCP.

5. Schlussnotenbezug für den Clearer

Der Bezug des Schlussnotendatenträgers für den Schlussnotenbezieher wird in der Verarbeitungssteuerung BCIN / BV innerhalb des XONTRO-Systems festgelegt. Diese Funktionalität bleibt von der Einführung des zentralen Kontrahenten unberührt.

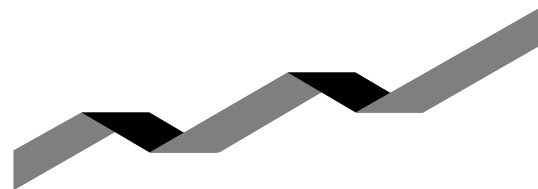
Zusätzlich wird jedoch sichergestellt, dass der Clearingteilnehmer eines Handelsteilnehmers dessen Schlussnoten auch dann beziehen kann, wenn er nicht mit dem heutigen Schlussnotenbezieher (Handels-/Abwicklungsteilnehmer) übereinstimmt. In diesem Fall stehen dem Clearingteilnehmer zukünftig über die Verarbeitungssteuerung vergleichbare Parameter wie dem heutigen Schlussnotenbezieher zur Verfügung (z.B. Intervall, (stündlich/Tagesende), Schlussnotenbezug für XONTRO/Xetra etc.); diese können nur von BrainTrade geändert werden.

3.2 Wesentliche Änderungen wegen der Einführung des ETS

Der separate File für ETS – Geschäfte wird im Vorsatz (Feld 77E) mit der Kennung „BOEGA-SDTB“ versehen.

In den Datensätzen werden keine neuen Felder aufgenommen, lediglich die Wertebereiche ändern sich in zwei Etiketten:

Etikett 21: Orderreferenz	Konstante 'BER' bei ETS – Ordernummer
Etikett 72: Information Sender an Empfänger	bei ETS – Geschäften Stelle 1-7: Text ' BERLIN ' ab Stelle 8: variabler (maximal 12- stelliger) Text Im Feld Eingabe wird für ETS – Geschäfte eine neue Nummer eingrichtet. Diese wird kurzfristig bekannt gegeben.



An die FWB Teilnehmer, Xetra® Teilnehmer und Vendoren sowie Unternehmensberatungen

Empfängerkreis: Projektkoordinatoren, Back Office Ansprechpartner,
IT Verantwortliche

FWB
Frankfurter
Wertpapierbörse

Geschäftsführung

Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt am Main

Postanschrift
60485 Frankfurt am Main

20. Juni 2002

Telefon
+49(0)69-21 01-16 40
+49(0)69-97 70-16 40

Agenda der CCP-Roadshow Sommer 2002 Central Counterparty (CCP) – Innovating the Equity Value Chain

Telefax
+49(0)69-21 01-16 41
+49(0)69-97 70-16 41

Internet
deutsche-boerse.com

Sehr geehrte Damen und Herren,

bereits heute liegen uns zahlreiche Anmeldungen zur CCP-Roadshow Sommer 2002 vor, auf der wir Sie über die technik- und abwicklungsrelevante Aspekte der Implementierung des CCP informieren möchten und zu der wir Sie mit unserem CCP-Rundschreiben 16/02 vom 07. Juni 2002 eingeladen haben.

Heute übersenden wir Ihnen Agenda und Anfahrtsbeschreibungen für die Veranstaltungen

am Dienstag, den 02. Juli 2002 in Frankfurt
(Sheraton Conference Center) und
und **am Montag, den 08. Juli 2002 in London**
(The Grange Holborn Hotel).

Sollten Sie Ihre Anmeldung für diese Veranstaltungen bisher noch nicht vorgenommen haben, bitten wir, uns diese bis spätestens **Donnerstag, den 27. Juni 2002** unter Nutzung des dem CCP-Rundschreiben 16/02 beigefügten Faxback-Formulares zuzusenden.

Zielgruppe dieser Veranstaltungen sind neben den Zentralen Projektkoordinatoren die für Technik und Abwicklung verantwortlichen Mitarbeiter Ihrer Projektteams. Wir bitten Sie zu berücksichtigen, dass die Veranstaltung in Frankfurt in deutscher, die Veranstaltung in London in englischer Sprache abgehalten wird.

Geschäftsführer:

Edward Backes
Dr. Heiko Beck
Rudolf Ferscha
Frank Gerstenschläger
Volker Potthoff

Die Ihnen heute übersandten Dokumente werden in Kürze auch auf der CCP-Website in der Rubrik „Projektnews“ veröffentlicht. Den Zugang zu den in der geschlossenen Benutzergruppe „Members Only“ verfügbaren Informationen erhalten Sie über www.xetra.de unter Eingabe des User Name „ccp“ und des Passworts „go“.

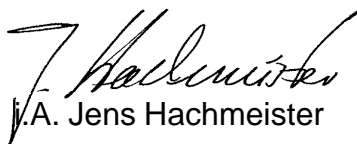
Für Rückfragen und weitere Auskünfte steht Ihnen das CCP Change Management Team unter

Telefon: +49(0)69-21 01-16 40

Fax: +49(0)69-21 01-16 41

gerne zur Verfügung.

Mit freundlichen Grüßen


i.A. Jens Hachmeister


i.A. Christian Ochsner

Anlagen

CCP – Roadshow Sommer 2002
„Central Counterparty (CCP) – Innovating the Equity Value Chain“

02. Juli 2002 – Sheraton Frankfurt Conference Center, Frankfurt

08. Juli 2002 – The Grange Holborn Hotel, London

08:30 – 09:00 **Registrierung & Begrüßungskaffee**

09:00 – 11:00 **Plenarveranstaltung – Teil I**

Vorsitz: Gerhard Leßmann (Member of the Executive Board, Deutsche Börse Systems AG)

09:00 – 09:15 Begrüßungsansprache
Gerhard Leßmann (Member of the Executive Board, Deutsche Börse Systems AG)

09:15 – 09:30 „Die CCP-Funktionalitäten im Überblick“
Alexander Merkelbach (Head of Clearing Development, Eurex Clearing AG)

09:30 – 10:30 „CCP: Auswirkungen auf die Abwicklung“
Christine Hoffmann (Head of CSC Customer Service, Clearstream Banking Frankfurt)

10:30 – 11:00 Q&A Session zu abwicklungsrelevanten Aspekten der CCP-Implementierung
Expertenforum

11:00 – 11:30 **Kaffeepause**

11:30 – 14:00 **Plenarveranstaltung – Teil II**

Vorsitz: Gerhard Leßmann (Member of the Executive Board, Deutsche Börse Systems AG)

11:30 – 12:45 „CCP-Architektur und Anbindungsvarianten“
Michael Wellenbeck (Senior Project Manager, Deutsche Börse Systems AG)

12:45 – 13:30 „Die CCP-Simulationsphase: Vorbereitung und Ablauf“
Jens Hachmeister (Head of Xetra Customer Services, Deutsche Börse AG)

13:30 – 14:00 Q&A Session zu technischen Aspekten der CCP-Implementierung
Expertenforum

14:00 – 15:00 **Business Lunch**

15:00 **Veranstaltungsende**