

MTF TRADEGATE -> Tradegate Exchange - OHC, GAT, MiR

FACHINFORMATION
F05 – 19.01.2010

 **VF1** (WM Variables Format)

 **FOF** (WM Financial Object Feed)

 **ONLINE** (Info-Line)

1. Hintergrund

Das MTF TRADEGATE, das bis zum 31.12.2009 als Handelsplatz nach europäischem Recht ohne inländische Regulierung i. S. einer Aufsicht für eine amtliche Börse betrieben wurde, erhielt mit Start des Börsenbetriebs zum Jahresbeginn 2010 den Status „Regulierter Markt im Sinne der MiFID“. Die Börse Tradegate Exchange als Regulierter Markt besteht aus zwei Segmenten: Regulierter Markt und Freiverkehr.

Zum Börsenstart 4.1.2010 von Tradegate Exchange wurden ausschließlich die bisherigen MTF-Werte, die in den WM-Daten mit dem Börsenschlüssel AJ9 (VF1: Tabelle G32 / FOF: InstrumentServiceID mit schemeSymbol = Boerse) dargestellt werden, weitergehandelt. In das Segment „Regulierter Markt“ wurden bisher keine Werte einbezogen.

WM Datenservice stellt folgende Börsenschlüssel (VF1: Tabelle G32 / FOF: InstrumentServiceID mit schemeSymbol = Boerse) für Tradegate Exchange bereit:

AT7 Tradegate Exchange (allgemeiner Börsenschlüssel)

AT9 Tradegate Exchange – Regulierter Markt

AJ9 Tradegate Exchange – Freiverkehr

Die Neuvergabe der Tabellenwerte AT7 und AT9 sowie die Änderung des Tabellenwertes AJ9 von „TRADEGATE“ in „Tradegate Exchange – Freiverkehr“ wurden am 8.1.2010 in dem Eildienst Nr. 5 zum 61. Änderungsdienst mit Datum Wirksamwerden 25.1.2010 publiziert.

2. WM-Umsetzung

2.1 Datenformat VF1

Die OHC-Datensätze mit dem Börsenschlüssel AJ9 (XD020), die bis zum 31.12.2009 das MTF TRADEGATE darstellten, bilden nun die Freiverkehrswerte der Tradegate Exchange ab. Von der Änderung betroffen sind folgende OHC-Felder:

XD900 (Börsenname): Tradegate Exchange (davor: TRADEGATE)

XD021 (Börsenart): 1/ Wertpapierbörse (davor: 8/Handelssystem)

XD020A (allgemeiner Börsenschlüssel): AT7 (bisher: AJ9)

XD022 (Marktkennzeichnung nach der Richtlinie 2004/39/EG) wurde aufgrund einer Mitteilung von Tradegate Exchange mit Datum Wirksamwerden 4.1.2010 von 1 (MTF) auf 2 (Regulierter Markt) geändert; diese Änderung wurde mit Datum Wirksamwerden 15.1.2010 aufgrund einer erneuten Mitteilung der Börse wieder zurückgenommen (s. a. www.wm Daten.com, WM-Xpress, Hotlist-Meldung v. 12.1.2010). Die Zurücknahme der Datenänderungen betraf auch die MiFID-Felder GD663B, GD663C und GD663D in den Produkten GAT und MiR.

2.2 Datenformat FOF

Börsennotierungen sind im Bereich Listing dargestellt.

Bei den Instrumenten mit Listing am Börsenplatz AJ9 wird der Verweis auf den allgemeinen Börsenplatz über die Relation Listing.tradingPlaces von ‚Boerse AJ9‘ auf ‚Boerse AT7‘ geändert (die Identifikation der Börsenplätze erfolgt über die Klasse InstrumentServiceID mit den Attributen ‚schemeSymbol‘ und ‚idSymbol‘).

Gleichzeitig wird eine neue Instanz der Klasse TradingPlace angelegt, die den allgemeinen Börsenplatz ‚Tradegate Exchange‘ repräsentiert. Die Identifizierung erfolgt über die Klasse InstrumentServiceID mit schemeSymbol = Boerse und idSymbol = AT7.

Die gem. Mitteilung von Tradegate vorgenommene und wieder zurückgezogene Anpassung der Marktkennzeichnung nach der Richtlinie 2004/39/EG ist auf der Ebene InstrumentService abgebildet. Betroffen war die Instanz von InstrumentService, die über die Klasse InstrumentServiceID mit schemeSymbol = Boerse und idSymbol = AJ9 identifiziert ist.

Die sich hieraus ergebenden Änderungen auf Instrument-Ebene betreffen Instanzen der Klasse ReportingGroupKey mit folgenden schemeSymbols:

MiFID_PreTrade

MiFID_PostTrade

Meldepfl_WpHG_EWR_EU

2.3 Info-Line

Die geänderten Informationen sind in WM Daten-Online seit dem 15.1.2010 verfügbar.

3. WM-Datenbereitstellung

Die Änderungen des Börsennamens und der Börsenart (VF1: XD900 und XD021 / FOF: TradingPlace) wurden mit Datum Wirksamwerden 15.12.2009 bzw. 4.1.2010 vorgenommen. Die Änderungen des allgemeinen Börsenschlüssels (VF1: XD020A / FOF: Listing.tradingPlaces) werden am 25.1.2010 vorgenommen und im Tagesdienst am 25.1.2010, abends, ausgeliefert. Dies betrifft ca. 8.600 OHC-Datensätze (VF1) bzw. 8.600 Instanzen der Klasse Listing (FOF).