

# Order/Handel/Clearing – Marktsegmentwechsel

FACHINFORMATION  
F12 – 17.03.2010

**VF1** (WM Variables Format)

**FOF** (WM Financial Object Feed)

**ONLINE** (Info-Line)

## 1. Hintergrund

WM Datenservice liefert in den OHC-Daten bzw. im Listing detaillierte Daten zum Status der Börseneinführung. Reguläre Notierungseinstellungen, z.B. wegen Endfälligkeit werden mit Code 9/Notierungseinstellung (VF1) bzw. listingStatusType = 9 (Streichung der Notierung – nicht zugelassen) und tradingStatusType = 7 (Handelseinstellung aus anderen Gründen) (FOF) geliefert, während besondere, marktsegmentbezogene Notierungseinstellungen mit Code A/Notierungseinstellung wegen Segmentwechsel (VF1) bzw. listingStatusType= 9 (Streichung der Notierung – nicht zugelassen) und tradingStatusType = 6 (Handelseinstellung auf Wunsch der Gesellschaft) (FOF) geliefert werden.

Ein Marktsegmentwechsel liegt nur dann vor, wenn

- eine Börsennotierung bereits gegeben ist (also nicht nur eine Notierung vorgesehen ist u.ä.),
- die Notierungseinstellung in einem Segment und die Notierungsaufnahme in einem anderen Segment, d.h. Segmente, die sich auf einen gemeinsamen allgemeinen Börsenschlüssel beziehen, zum gleichen Zeitpunkt stattfindet und ursächlich im Zusammenhang stehen.

Die Börseneinführungsschritte „Notierung vorgesehen“, „Antrag gestellt“ oder „Antrag abgeschlossen“ für das neue Marktsegment werden bei Marktsegmentwechseln nicht verwendet. Notierungsaufnahmen in einem Segment (z.B. Freiverkehr) bei gleichzeitigem Vorhandensein einer vorgesehenen Notierung o.ä. an einem anderen Segment dieser Börse (z.B. Regulierter Markt) werden nicht als Marktsegmentwechsel behandelt.

## 2. Umsetzung

### 2.1. Lieferformat VF1

- a) Im Lieferformat VF1 wird, wenn eine Börsennotierung vorliegt (XD030 = 5 – 8, Tab. X02), ein Marktsegmentwechsel wie folgt dargestellt:

Feldident	altes Marktsegment	neues Marktsegment
XD110 Datum Wirksamwerden	Datum aus XD539B + 1 Tag	Datum aus XD480
XD030 Status der Börseneinführung - Tabelle X02	<b>A/ Notierungseinstellung wegen Segmentwechsel</b>	5/Tag der ersten Notierung
XD480 Tag der Einführung - Datum	---	erster Handelstag im neuen Segment (letzter Handelstag des alten Segmentes + 1 Tag)
XD539B letzter Handelstag - Datum	letzter Handelstag im alten Segment	---

- b) **Besonderheit:** Im Falle der Korrektur eines fehlerhaft angelegten Marktsegmentes mit aktivem Notierungsstatus (XD030/Status der Börseneinführung = 5 – 8) und gleichzeitiger Neuanlage eines Marktsegmentes dieser Börse (kein offizieller Marktsegmentwechsel) wird die alte OHC-BID storniert (XD001/Status der OHC-BID = S/Storno der Gesamtmeldung) und zusätzlich der Status A (Notierungseinstellung w/Segmentwechsel) in dem Feld XD030 geliefert. XD539B (letzter Handelstag) wird in diesem Falle nicht belegt; XD480 (Tag der 1. Notierung) in der neuen (korrekten) OHC-BID wird sachbezogen – soweit bekannt – belegt (d.h. aus der stornierten OHC-BID übernommen).

## 2.2. Lieferformat FOF

- a) Wenn eine Börsennotierung vorliegt (Listing.listingStatusType 4 (Notierung effektiv), 5 (Notierung vorläufig eingestellt) oder 6 (Streichung der Notierung beantragt)), wird ein Marktsegmentwechsel wie folgt dargestellt:

Klasse/Attribut	altes Marktsegment	neues Marktsegment
Listing.listingStatusType	9 (Streichung der Notierung - nicht zugelassen)	4 (Notierung effektiv)
Listing.tradingStatusType	6 (Handelseinstellung auf Wunsch der Gesellschaft)	4 (Handel)
Listing.firstTradingDate	---	erster Handelstag im neuen Segment (letzter Handelstag des alten Segmentes + 1 Tag)
Listing.lastTradingDate	letzter Handelstag im alten Segment	---

- b) **Besonderheit:** Im Falle der Korrektur einer fehlerhaft angelegten Listing-Instanz mit aktivem Notierungsstatus (Listing.listingStatusType 4, 5 oder 6) wird diese Listing-Instanz mit dem listingStatusType 13 (Notierung hinfällig) gekennzeichnet, lastTradingDate wird in diesem Fall nicht belegt. Es wird eine neue Listing-Instanz mit Verweis auf das neue (korrigierte) Börsensegment geliefert. Bei der neuen Listing-Instanz wird das Attribut Listing.firstTradingDate – sofern vorhanden - aus der stornierten OHC-BID übernommen.

## 2.3. Info-Line

In WM Daten*Online* werden die geänderten Informationen zum Status der Börseneinführung in den Modulen Static Data und Risk & Reporting in dem Segment Börsennotierung dargestellt.

# 3. WM-Datenbereitstellung

## Lieferformate VF1, FOF und WM*Online*

Die beschriebenen Verfahrensweisen werden ab sofort in den WM-Daten abgebildet.