

# Order/Handel/Clearing – Tick Sizes

## Ausweitung der WM-Datenlieferungen auf Scoach Europa

FACHINFORMATION  
F14 – 12.04.2010

**VF1** (WM Variables Format)

**FOF** (WM Financial Object Feed)

**ONLINE** (Info-Line)

## 1. Hintergrund

Bezugnehmend auf die Fachinformationen F31 vom 22.12.2009 (Order/Handel/Clearing – Tick Sizes, Neuregelungen für die XONTRO-Börsen, Ausweitung der WM-Datenlieferungen auf Xetra-Börsenplätze) und F11 vom 11.3.2010 (Order/Handel/Clearing – Tick Sizes, Änderungen für Aktien an den Börsen Berlin, Düsseldorf, Hamburg, Hannover, Stuttgart) teilen wir Ihnen mit, dass die WM-Datenlieferung für Tick Sizes ab 28.6.2010 auf Scoach Europa ausgeweitet wird.

Folgende Ausprägungen kommen zur Anwendung:

Schlüssel A – **stücknotierte Wertpapiere – Scoach Europa:**

Art der Notierung	Kurs	Tick Sizes
stücknotierte Werte	< 0,25 €	0,001 €
stücknotierte Werte	> = 0,25 €	0,01 €

Schlüssel B – **prozentnotierte Wertpapiere – Scoach Europa:**

Art der Notierung	Restlaufzeit	Tick Sizes
prozentnotierte Werte	< 2 Jahre	0,001 %
prozentnotierte Werte	> = 2 Jahre	0,005 %
prozentnotierte Werte	> = 7 Jahre	0,01 %
prozentnotierte Werte	ohne Tilgungstermin oder Tilgungs- termin überschritten	0,01 %

Die Schlüssel A und B (Tabelle X12) wurden im Eildienst Nr. 2 zum 62. Änderungsdienst veröffentlicht.

Schlüssel 4 – **Sonderregelung diverse:**

Art der Notierung	Restlaufzeit	Tick Sizes
prozentnotierte Werte	---	0,001 %

Für prozentnotierte Floater, Zeros, Strips an der Scoach Europa findet der bereits im 4. Eildienst zum 61. Änderungsdienst veröffentlichte Schlüssel 4 Verwendung.

Diese Ausweitung der Tick-Size-Darstellung betrifft folgende Börsensegmentschlüssel:

AK8	Deutsche Börse – Frankfurter Wertpapierbörse (FWB) – Xetra Frankfurt 2 – Scoach Europa – Regulierter Markt
AK9	Deutsche Börse – Frankfurter Wertpapierbörse (FWB) – Xetra Frankfurt 2 – Scoach Europa – Freiverkehr

## 2. Umsetzung

### 2.1. Lieferformat VF1

Die zur Anwendung kommende Tick-Size-Regelung ist in dem Feld XD546 dargestellt; o.g. Tick-Size-Ausprägungen sind in der Tabelle X12 hinterlegt.

Die genannten Börsenschlüssel gem. Tabelle G32 sind in dem Feld XD020 (Börse/Börsensegment) hinterlegt.

### 2.2. Lieferformat FOF

Die Darstellung der Tick-Size-Regelung erfolgt in der Klasse ListingGroupKey, und zwar in den Instanzen mit scheme-Symbol = Regelung\_Tickgroesse\_XONTRO. Das Attribut idSymbol enthält den Schlüssel. Die betroffenen Listings erhalten eine entsprechende Änderung des idSymbols auf den Wert A, B resp. 4.

Die Tick-Size-Ausprägungen selbst werden in neuen Instanzen der Referenzdatenklasse ListingGroup mit scheme-Symbol „Regelung\_Tickgroesse\_XONTRO“ und idSymbol A, B, bzw. 4 dargestellt. Die oben genannten Regelungen werden als Text in dem Attribut ListingGroup.description abgebildet.

## 3. WM-Datenbereitstellung

### 3.1. Datenbereitstellung im Lieferformat VF1

Die Datenbereitstellung betrifft derzeit ca. 413.000 OHC-Datensätze. Die Datenauslieferung erfolgt in der Sonderdatei zum 62. Änderungsdienst (auf diese Sonderdatei wird in einer separaten Kundeninformation hingewiesen).

### 3.2. Datenbereitstellung im Lieferformat FOF

Die Bereitstellung betrifft ca. 413.000 Listing-Objekte bzw. Instrumente.

Die Detailinformationen zur Belieferung erfolgen im Rahmen einer separaten Kundeninformation zum 62. Änderungsdienst.