

# Erweiterung der WM-Währungstabellen

FACHINFORMATION  
F15 – 23.04.2010

VF1 (WM Variables Format)

FOF (WM Financial Object Feed)

ONLINE (Info-Line)

## 1. Hintergrund

Ab dem 62. Änderungsdienst, der ab Montag, den 28.6.2010, wirksam wird, werden die WM Währungstabellen W01 und W02 um folgende Werte erweitert:

Tabelle W01 / Schema „Wahrung_BdB“ Währungsschlüssel des Bundesverbandes deutscher Banken e.V.	Tabelle W02 / Schema „Wahrung_ISO4217“ Währungsschlüssel gem. ISO-Norm 4217 und weitere	Bezeichnung
L1	GBX	British Pence
D1	USX	US Cents
R1	BRX	Centavos (Brasilien)
X1	XX1	nicht aufgliederbare Fremdwährungsanteile gemäß §294 (6) SolvV
X2	XX2	Gesamtfremdwährungsanteil des Fonds gemäß Mitteilung des Emittenten

Die neuen Tabellenwerte werden in dem Eildienst Nr. 3 zum 62. Änderungsdienst veröffentlicht.

Die neuen Währungsschlüssel sind keine ISO-Codes, entsprechen für British Pence, US Cents und Centavos (Brasilien) jedoch international üblichen Abkürzungen. Der Bedarf resultiert aus Änderungen im Börsenhandel in Deutschland, da für den Handel an Xetra International Market sowie für Single Stock Futures und Aktienoptionen an der Eurex für britische Aktien die Ausprägung GBX benötigt wird. Die neuen Tabellenwerte für US Cents und Centavos (Brasilien) werden prophylaktisch eingerichtet (noch keine Datenlieferungen).

Die neuen Schlüssel „nicht aufgliederbare Fremdwährungsanteile gem. § 294 (6) SolvV“ und „Gesamtfremdwährungsanteil des Fonds gemäß Mitteilung des Emittenten“ werden im Bereich der Stammdaten ausschließlich für die Darstellung der Fremdwährungsanteile bei Fonds (Feld GV222 / ReportingDetail, schemeSymbol beginnend mit „FremdwahrungGoldanteil“) benötigt. Nähere Details hierzu werden in einer gesonderten Fachinformation in Kürze bekanntgegeben.

WM Datenservice wird die neuen Währungsschlüssel GBX, USX und BRX ausschließlich in den Positionen unter 2.1. und 2.2. genannten Feldern / Attributen liefern. In den Termindaten (VF1: Erträge, Versammlungen, Kapital, Umtausch, Tilgung; FOF: CompanyEvent, Assembly, Cash-Flow (außer Eurex-Optionen, s.u.)) werden diese Codes nicht geliefert, es erfolgt hier weiterhin die Darstellung und Lieferung ausschließlich in den Hauptwährungen (GBP, USD, BRL). Gleiches gilt für die im Rahmen der Stammdaten gelieferten Daten zu Kapital, Nennwert etc., sowie für die Kursdaten (IFP, EBK).

Im Bereich der Handelsdaten (VF1: OHC, FOF: Listing) werden künftig Handels- und Abrechnungswährung für bestimmte Instrumente an britischen Märkten sowie für britische Instrumente an Xetra International Market (XIM) gem. Usancen in GBX geliefert. Für o.g. Eurex-Produkte erfolgt die Bereitstellung der Handels- und Abrechnungswährung, der Tick-Größen-Intervalle, der Tick-Wert-Intervalle und der Basispreise gem. Usancen in GBX. Im Bereich der Daten zu Options&Futures (VF1: O&F, FOF: Klasse TradedOption) werden die Währungen der genannten Eurex-Produkte in GBX bereitgestellt.

## 2. Umsetzung

### 2.1. Lieferformat VF1

Die unter Punkt 1 genannten Bruchwährungen British Pence, US Cents und Centavos (Brasilien) finden in den WM-Produkten OHC und O&F bzw. die nicht aufgliederbaren Fremdwährungsanteile gemäß §294 (6) SolvV und der Gesamtfremdwährungsanteil des Fonds gemäß Mitteilung des Emittenten in GAT, in den folgenden Feldern, denen die Tabelle W02 zugeordnet ist, Anwendung:

OHC – XD242 ABRECHNUNGSWÄHRUNG  
OHC – XD243 KURSWÄHRUNG  
OHC – XV551 TICK-GRÖSSEN-INTERVALLE  
OHC – XV561 TICK-WERT-INTERVALLE  
OHC – XD800 WÄHRUNG ZU BASISPREISINTERVALLEN  
O&F – DD032 WÄHRUNG ZUM BASISPREIS  
GAT – G222 FREMDWÄHRUNGS- BZW. GOLDANTEIL IN %

### 2.2. Lieferformat FOF

Für die unter Punkt 1 genannten Bruchwährungen British Pence, US Cents und Centavos (Brasilien) werden neue Instanzen der Klasse CurrencyInstrument mit den üblichen InstrumentID-Schemata „Waehrung\_BdB“ und „Waehrung\_ISO4217“ geliefert. Verweise auf diese CurrencyInstrumente werden in den folgenden Klassen und Attributen Verwendung finden:

Listing.currency  
TradingRule.currency  
ContractSpecification.settlementCurrency  
OptionPayment.exerciseInstrument (nur für Eurex-Derivate)  
ReportingDetail.schemeSymbol (schemeSymbol beginnend mit „FremdwaehrungGoldanteil“).

## 3. WM-Datenbereitstellung

### Datenbereitstellung der Lieferformate VF1 und FOF

Hinsichtlich der weiteren liefertechnischen Details wird auf die Kundeninformation zum 62. Änderungsdienst, die demnächst veröffentlicht wird, hingewiesen.