

Handel von Wertpapieren in Fremdwahrung – Deutsche Borse AG

FACHINFORMATION
F21 – 17.07.2009

VF1 (WM Variables Format)

FOF (WM Financial Object Feed)

ONLINE (Info-Line)

Ausgangslage

Mit der Einfuhrung von Xetra Release 10.0 per 08.06.2009 hat die Deutsche Borse AG die Voraussetzungen fur den Handel von Wertpapieren in Fremdwahrung auf Xetra geschaffen. Ein Wertpapier kann damit entweder in Euro oder in einer anderen Wahrung gehandelt werden. Die Fremdwahrungsmoglichkeit gilt fur die Plattformen:

- Xetra Frankfurt
- Xetra Frankfurt 2
- Xetra International Market (Einfuhrung geplant fur November 2009)

Generell ist der Handel von Wertpapieren in Fremdwahrung nicht auf bestimmte Wertpapiergruppen beschrankt. Zunachst sind jedoch lediglich ETF/ETC und strukturierte Produkte fur den Handel in Fremdwahrung vorgesehen. Erste Wertpapiere in Fremdwahrung werden **ab dem 03.08.2009** erwartet. Hierbei kann es sich sowohl um neue Wertpapiere als auch um einen Wechsel der Wahrung bei bereits bestehenden Wertpapieren handeln.

WM-Umsetzung

WM Datenservice bietet bereits heute im Produkt Order/Handel/Clearing (OHC) eine detaillierte Darstellung der fur den Handel relevanten Wahrungen. Die Einfuhrung des Handels in Fremdwahrungen kann daher datentechnisch ohne anderungen in der Datenbankstruktur von WM-Datenservice umgesetzt werden.

a) Darstellung im Datenformat VF1

Die OHC-Datenstruktur liefert fur jedes Finanzinstrument und Listing einen eigenen Datensatz mit borsenplatzspezifischen Informationen, der u.a. die:

- Abrechnungswahrung
- Kurswahrung
- Wahrung zum Instrument (Nominalwahrung)

nach ISO-Norm 4217 enthalt.

Die aktuelle sowie kunftige Darstellung der relevanten Wahrungen konnen Sie dem folgenden Schaubild entnehmen:

Datenlieferung (OHC-Felder)	Prozentnotierte Instrumente		Stücknotierte Instrumente	
	derzeit	neu (ab 03.08.2009)	derzeit	neu (ab 03.08.2009)
XD242 Abrechnungswährung	EUR	EUR oder Fremdwährung	EUR	EUR oder Fremdwährung
XD243 Kurswährung	EUR oder Fremdwährung	EUR oder Fremdwährung	EUR	EUR oder Fremdwährung
XD240 Nominalwährung	EUR oder Fremdwährung	EUR oder Fremdwährung	XXX	XXX

b) Darstellung im Datenformat FOF

Für jedes Listing eines Finanzinstruments wird eine Instanz der Klasse *Listing* geliefert. Listingspezifische Währungsangaben sind in den unten aufgeführten Klassen/Attributen dargestellt.

Die Nominalwährung wird unverändert in *Instrument.nominalCurr* dargestellt.

Beschreibung	Klasse.Attribut	Prozentnotierte Instrumente		Stücknotierte Instrumente	
		derzeit	neu (ab 03.08.2009)	derzeit	neu (ab 03.08.2009)
Abrechnungswährung	TradingRule.currency	EUR	EUR oder Fremdwährung	EUR	EUR oder Fremdwährung
Kurswährung	Listing.currency	EUR oder Fremdwährung	EUR oder Fremdwährung	EUR	EUR oder Fremdwährung

Im Zuge dieser Umstellungen kommt es zu Änderungen des Attributs *idSymbol* in den Klassen *ListingGroupKey/ListingGroup*. Wir möchten Sie in diesem Zusammenhang nochmals darauf aufmerksam machen, dass es sich hierbei um ein technisches Attribut zur Verbindung der beiden Klassen handelt, dem keinerlei Nutzinformation entnommen werden darf.