

Indexgewichtung im Produkt Gattungsdatei (GAT)

KUNDENINFORMATION
K08 – 01.04.2010

VF1 (WM Variables Format)

FOF (WM Financial Object Feed)

ONLINE (Info-Line)

1. Hintergrund

In Rahmen des Produktes Gattungsdatei (GAT) stellen wir Ihnen verschiedene Indexinformationen zur Verfügung. Hierbei handelt es sich um die Zuordnung eines Finanzinstruments zu einem Index und um die Indexkomponenten in einem Index. Innerhalb der Felder/Attribute liefern wir neben der WKN und ISIN des Indices oder Finanzinstruments auch die Gewichtung des Finanzinstruments innerhalb der Indices, wenn diese uns zur Verfügung steht.

Derzeit liefern wir diese Daten für die Indices der DAX- und STOXX-Indexgruppe, sowie für die meisten gängigen Indices.

Die Indexinformationen für die DAX- und STOXX-Indices bezieht WM von der Deutsche Börse AG (DBAG) und STOXX Ltd. Zukünftig müssen die Daten zur Gewichtung (bei STOXX Indices evtl. auch die Indexzusammensetzung) direkt bei der DBAG oder STOXX lizenziert werden.

Mit der Deutsche Börse AG wurde als Umstellungstag der 28.06.2010 vereinbart. Mit STOXX Ltd. befinden wir uns derzeit noch in Verhandlungen, wie und wann die Umstellung erfolgen muss.

Der Umstellung ist geplant mit dem 62. Release 28. Juni 2010. Spätestens zu diesem Zeitpunkt werden dann alle Indexgewichtungen (auch der gängigen Indices) in separaten Feldern bereitgestellt und nur noch auf der Ebene Index ausgeliefert (die bisherige zusätzliche Lieferung auf der Ebene Komponente entfällt).

Für die separate Bereitstellung dieses Sonderfiles berechnen wir eine Wartungspauschale in Höhe von EUR 700,- p.a. zzgl. MwSt. Bzgl. der Lizenzierung wenden Sie sich bitte direkt an die zuständigen Mitarbeiter bei der DBAG.

2. Darstellung VF1

Im VF1 sind folgende Felder betroffen:

GV791, GV792 – Menge bzw. Gewichtung im Index (1) und (2)

GV333-GV347 – Index-Inhaltskomponente (1-15)

Sobald die Details mit der DBAG final abgestimmt sind, werden wir die Daten zur Gewichtung in diesen Feldern nicht mehr liefern, sondern nur noch in speziellen Feldern bereitstellen. Die Struktur der oben genannten Felder bleibt unverändert, lediglich die Feldsegmente C, D, E in den genannten Feldern bleiben zukünftig leer.

Über die neuen Felder werden wir Sie in Kürze informieren.

Auf Wunsch stellen wir Ihnen gerne eine Sonderdatei zur Löschung der bisher gelieferten Gewichtungsdaten zur Verfügung. Bitte senden Sie dafür das beigefügte Antwortfax an uns zurück.

3. Darstellung FOF

Im FOF/XML ist das folgende Attribut betroffen:

`ComponentInstrumentProperties.componentAmount`

Dieses Attribut wird bei den o.g. lizenzpflichtigen Indices zukünftig nur noch an Sie geliefert, wenn Sie die Daten zur Gewichtung bei der DBAG lizenziert haben. Bei nicht lizenzpflichtigen Indices und bei anderen Finanzinstrument-Typen, bei denen das Attribut `componentAmount` Verwendung findet, wird es weitergeliefert wie bisher.

Im Zuge der Umstellung der Belieferung erfolgt keine aktive Löschung des Attributs `componentAmount` durch WM. Sobald jedoch nach der Umstellung ein Update für einen nicht lizenzierten Index geliefert wird, erfolgt die Lieferung ohne dieses Attribut.

Antwortfax

Indexdaten in der Gattungsdatei

(Bitte an Fax Nr.: 069 / 2732 – 291 senden)

1. Allgemeine Fragen zu Indexdaten

- Ja, wir nutzen die Gewichtungen innerhalb der Indices von WM.
- ja, wir sind interessiert an weiteren Indexgruppen. Wenn ja bitte Indexgruppe nennen:

2. Bestellung Sonderdatei zur Löschung der Gewichtungen im Index

Hiermit bestellen wir:

Datei	Sonderdatei Indexgewichtung im Format: <input type="checkbox"/> Variables Format VF1 (Die Datei steht ab dem 26.06.2010 vormittags zum Abruf bereit)
Bereitstellung	<input type="checkbox"/> FTP <input type="checkbox"/> E-Mail
Zeichensatz	<input type="checkbox"/> EBCDIC* <input type="checkbox"/> ASCII <input type="checkbox"/> ANSI
Handlingpreis	EUR 150,- zzgl. MwSt.

* Die Dateien sind mit Zeichensatz EBCDIC über FTP nur mit FLAM-Komprimierung erhältlich.

Absender:

Firma:

Herrn/Frau:

Telefon:

E-Mail-Adresse:

Datum/Unterschrift