

63. Änderungsdienst

Wirksam ab Montag, den 18.10.2010

KUNDENINFORMATION
K16 – 26.08.2010

VF1 (WM Variables Format)

FOF (WM Financial Object Feed)

ONLINE (Info-Line)

Zusammenfassung der in der WM-DOK beschriebenen neuen Felder und Ablauf zum 63. Release:

1. Umsetzung im VF1

1.1. Neue Felder/Änderungen/Löschungen

Produkt	eingefroren	Feldname	Neuaufnahme	Repräsen- Testdaten	Massen- Testdaten	Sonderdatei	Anzahl BIDs ca.
A&R		RISIKOGEWICHTUNGSSATZ IN % NACH GRUNDSATZ I *	RD006	X	X	X	ca. 1.010.000
		KZ NULLANRECHNUNG GEM. SOLVABILITÄTSRICHTLINIEN NACH GRUNDSATZ I *	RD007	X	X	X	ca. 1.010.000
		OECD COUNTRY RISK CLASSIFICATION	RD008	X	X	X	ca. 1.010.000
A&R (E)		OECD COUNTRY RISK CLASSIFICATION	MDW650	X	X	X	ca. 180.000
GAT(G)	GD190	WERTPAPIERGRUPPE **					
	GD195	WERTPAPIERART**					
		KENNZEICHEN PROLONGATION	GD730A	X	X	X	ca. 450
		KENNZEICHEN SWITCHOPTION (ZINS)	GD814B	X	X	X	ca. 250
		KENNZEICHEN LEERVERKAUFVERBOT	GD867	X	X	X	ca. 710
		NOMINALBETRAGSGARANTIE UNTER 100%	GD213D	X	X	X	ca. 275.000
GAT(K)		TEILNAHME QIB	KD117	X			
GAT(H)	HD012	12-TAGE-FRIST					
	HD029	LETZTER VERSANDTAG HV- EINLADUNG					
OHC	XD543A	MINIMALES QUOTIERUNGSVOLUMEN (XETRA)					
	XD543D	START UND ENDE CONTINUOUS AUCTIONS (XETRA)					
	XD543E	ISSUER SUB-GROUP WARRANTHANDEL (XETRA)					

Produkt	eingefroren	Feldname	Neuaufnahme	Repräs. Testdaten	Massen-Testdaten	Sonderdatei	Anzahl BIDs ca.
OHC	XD543F	WARRANT-KATEGORIE IM WARRANTHANDEL (XETRA)					
		CSD/ICSD (1)***	XD973A	X		X	ca. 8
		CSD/ICSD (2)***	XD973B	X		X	ca. 8
		CSD/ICSD (3)***	XD973C	X		X	ca. 8
		CSD/ICSD (4)***	XD973D	X		X	ca. 8
		CSD/ICSD (5)***	XD973E	X		X	ca. 8
		WEITERE KURSWÄHRUNG***	XV244	X		X	ca. 150
		CSD-SETTLEMENT-KALENDER (1)***	XV974	X		X	ca. 8
		CSD-SETTLEMENT-KALENDER (2)***	XV975	X		X	ca. 8
		CSD-SETTLEMENT-KALENDER (3)***	XV976	X		X	ca. 8
		CSD-SETTLEMENT-KALENDER (4)***	XV977	X		X	ca. 8
		CSD-SETTLEMENT-KALENDER (5)***	XV978	X		X	ca. 8
		SONDERHEITEN SETTLEMENT***	XV979	X		X	ca.8.600

*Es ist notwendig, die bereits zum 61. Änderungsdienst eingefrorenen Felder RD006 „RISIKOGEWICHTUNGSSATZ IN % NACH GRUNDSATZ I“ und RD007 „KZ NULLANRECHNUNG GEM. SOLVABILITÄTSRICHTLINIEN NACH GRUNDSATZ I“ wieder zu beliefern, da die parallele Anwendung des Grundsatzes I aufgrund einer Änderung der SolvV weiterhin vorgeschrieben ist.

**In der Fachinformation F16 „Klassifikation von Finanzinstrumenten“ vom 15.07.2005 hatten wir unter Punkt 3 angekündigt, die Belieferung der Felder GD190 und GD195 zum Oktober 2010 einzustellen.

***Über fachliche Vorgaben zu den genannten neuen Feldern, werden wir Sie in einer gesonderten Kundeninformation informieren, die kurzfristig veröffentlicht wird.

1.2 Auslieferung

1.2.1 Repräsentative Testdaten

Gemäß dieser Übersicht über das Release stehen ab 17.09.2010 auf Anforderung folgende Daten zur Verfügung:

- a) Grundaussstattungsdatei
- b) Veränderungsdatei mit Feldneubelegung und Storni.

Für Kunden mit einem Releasewechsel- Abonnement ist eine Bestellung nicht notwendig. Die Dateien werden Kunden des Releasewechsel- Abonnements automatisch zugestellt.

Kunden ohne Releasewechsel- Abonnement verwenden bitte das in der Anlage beigefügte Bestellformular.

1.2.2 Massen-Testdaten für GAT

Zur Performance-Messung stehen ab 24.09.2010 Massen-Testdaten auf Anforderung zur Verfügung. Diese Testdateien beinhalten annähernd 100 % bei maschinell generierbaren Positionen und annähernd 10 % bei manuell zu pflegenden Positionen der betroffenen Gattungen. Die ungefähren Mengenangaben entnehmen Sie bitte der Tabelle im Punkt 1.1. (Neue Felder/Änderungen/ Löschungen).

1.2.3 Sonderdateien

Zur Erstbelegung bei lebenden (aktiven) Gattungen stellen wir gemäß dieser Übersicht über das Release ab **16.10.2010** auf Anforderung LKZ2 zur Verfügung. Bitte verarbeiten Sie die Dateien wie folgt:

Datei	Vom	Selektionszeitraum von	Selektionszeitraum bis
Tages-Update	15.10.2010	14.10.2010 ca. 16.45*	15.10.2010 ca. 16.45*
Sonderdatei	16.10.2010	15.10.2010 ca. 16.45*	15.10.2010 ca. 16.45*
Tages-Update	18.10.2010	15.10.2010 ca. 16.45*	18.10.2010 ca. 16.45*

* Die exakten Uhrzeiten entnehmen Sie bitte dem Header der einzelnen Dateien.

1.3 Gelöschte/inaktive Gattungen

Bei Bedarf stellen wir Sonderdateien mit aktualisierten Bezugsgruppen zu einem späteren, individuell wählbaren Termin zur Verfügung.

1.4 Neue/geänderte Inhalte in bestehenden Feldern

Börsenkürzel

In der Fachinformation F16 „Neustrukturierung der Vergabe von Börsenkürzeln“ vom 28.04.2010 informierten wir über die Neustrukturierung der Vergabe von Börsenkürzeln. Die Börsenkürzel werden wie angekündigt zum Releasetermin bereinigt entsprechend dem bisherigen Verfahren. Die Börsenkürzel werden aus den bis einschließlich 11.10.2010 deaktivierten Finanzinstrumenten gelöscht.

Zur Vermeidung von Dubletten in Ihrem Datenhaushalt durch die Wiederbelegung der Börsenkürzel bieten wir Ihnen auf Anforderung eine Text-Datei im CSV-Format, wahlweise auch eine VF1-Datei oder aber eine individuelle Sonderdatei an, damit Sie die Felder in eigener Regie neutralisieren können.

Es handelt sich um:

- ca. 95.000 ISIN/WKN, deren Inhalte im AG G, im Feld GD625 und
- ca. 200.000 Bezugsgruppen im Produkt OHC, deren Inhalte im Feld XD050A gelöscht werden.

Die Datei enthält neben den betroffenen Börsenkürzeln die Werte (wie WKN, ISIN etc.) für die Gattungen und Bezugsgruppen.

Eine Wiederverwendung der Börsenkürzel wird ab dem 01.11.2010 vorgenommen.

Bestellung:

Bitte wählen Sie bei Bedarf Ihre Datei unter Angabe des gewünschten Formats und Zeichensatzes aus den drei folgenden Varianten und senden Sie Ihre Bestellung mit der Betreffzeile **Löschung Börsenkürzel per Oktober 2010** an die E-Mail-Adresse: help-desk@wmDaten.com

- Die Text-Datei (CSV) in Zeichensatz ANSI oder ASCII*
- die VF1-Datei im Zeichensatz ANSI, ASCII oder EBCDIC
- ggf. eine Sonderdatei (Format und Zeichensatz bitte genau definieren)

* **Tipp:** Wir empfehlen, die CSV-Datei in MS ACCESS zu importieren, da ein derart hohes Datenvolumen in MS EXCEL problematisch ist.

WM-Lieferung:

Die Auslieferung der Dateien beginnt am 13.10.2010.

Für eventuelle Fragen steht Ihnen unser Helpdesk unter +49 (0)69 2732 480 gerne zur Verfügung.

1.5 Neue geänderte Belieferung in bestehenden Feldern

Die folgenden Felder werden aus der normalen GAT-Lieferung herausgenommen und ab dem Zeitpunkt des 63.

Änderungsdienstes nur noch über einen Sonderfile angeboten:

Produkt	Feldname	Herausnahme aus der GAT-Lieferung
Derivatekennzahlen DKE	RISIKOKLASSIFIZIERUNGSSYSTEM DES DEUTSCHEN DERIVATE VERBANDES E.V	GD712
Derivatekennzahlen DKE	VALUE AT RISK (VAR) DES DEUTSCHEN DERIVATE VERBANDES E.V.	GD713
Derivatekennzahlen DKE	RISIKOKLASSIFIZIERUNGSSYSTEM DES DEUTSCHEN DERIVATE VERBANDES E.V. UND VALUE AT RISK (VAR) PER	GD714

Hintergrund für die Herausnahme der Felder sind die enormen Datenvolumen, die in den täglichen Updatefiles zur Verfügung gestellt werden und bei einer Vielzahl von Kunden zu Problemen in der Verarbeitung dieses Files führen. Um diesen Sonderfile zu beziehen, setzen Sie sich bitte mit Frau Silke Lehnen (Tel.: +49-69-2732-435, Mail: service@wmdaten.com) in Verbindung, um bei Bedarf die gesonderte Bereitstellung abzustimmen. Die Bereitstellung erfolgt bis auf weiteres kostenlos.

1.6 Individuelle Feldprofile

Kunden, die individuelle Feldprofile beziehen, werden gebeten, Ihre Software entsprechend diesem Release auszurichten. Sie werden weiterhin gebeten, uns das aktualisierte Feldprofil bis zum 30.09.2010 zur Anpassung der täglichen Updates aufzugeben.

Als Ansprechpartnerin steht Ihnen diesbezüglich Frau Silke Lehnen zur Verfügung unter:

service@wmdaten.com bzw. Tel.: +49 (0)69 2732 435.

1.7 Sonderdatei per FTP**1.7.1 ASCII- oder ANSI-Zeichensatz**

Die Sonderdateien erhalten im ANSI-Zeichensatz die Endung „ANS“ und im ASCII-Zeichensatz die Endung „ASC“. Diese sind grundsätzlich komprimiert und erhalten zusätzlich die Endung „.zip“.

Beispiele für Dateikonventionen: RW_GAT_101016_ANS.zip

RW_OHC_101016_ASC.zip

1.7.2 EBCDIC-Zeichensatz

Zusätzlich bietet WM die Download-Möglichkeit für EBCDIC-Dateien per FTP, komprimiert mit FLAM Release III (ADC), an.

1.7.3 Test-/Sonderdatei im Abonnement

Es besteht die Möglichkeit, die Dateien zum Release-Wechsel im Abonnement zu beziehen. In diesem Fall entfällt eine Bestellung über das beigefügte Formular → K09 vom 15.03.2006.

http://www.wmdaten.de/pdf_kundeninfo/KI2006-09.pdf

Als Ansprechpartner steht Ihnen diesbezüglich Herr Bernd Vahle zur Verfügung unter: service@wmdata.com bzw. Tel.: +49 (0)69 2732 286

2. Darstellung im FOF

2.1 Ursprüngliche/neue Darstellung der Daten zum Release

2.1.1 Neue und geänderte Inhalte/Attribute

Sachverhalt	Bereich	Darstellung in WMS	Reprä. Test-daten	Massen Test-daten	Anzahl Instan-zen ca.	Sonder-datei
OECD Country Risk Classification	GeographicUnit ¹⁾	GenericInformation mit idSymbol = "OECDCountryRisk Classification"				
Art der Prolongation	Instrument	RepaymentPlan mit repaymentPlanType = 2 (Laufzeitverlängerung) und InstrumentGroupKey mit schemeSymbol = „Prolongations Typ“	X	X	450	Dateien mit Produktionsdatum 16.10.2010
Switch-Option für die Art der Verzinsung	Instrument	InstrumentGroupKey mit schemeSymbol = „SwitchoptionZins“	X	X	250	Dateien mit Produktionsdatum 16.10.2010
Leerverkaufsverbot	Instrument	InstrumentGroupKey mit schemeSymbol = „Leerverkaufsverbot“	X	X	710	Dateien mit Produktionsdatum 16.10.2010
Nominalbetragsgarantie unter 100 %	Instrument	ReportingGroupKey mit schemeSymbol = „NominalbetragsgarantieUnterPari“	X	X	275.000	CSV-Sonderdatei
Teilnahme von „Qualified Institutional Buyers“	Instrument/ Cash Flow	CFGroupKey mit schemeSymbol = "QIB_Partizipation"	X			
Teilnahme von „Qualified Institutional Buyers“	Institution/ CompanyEvent	CompanyEvent: GenericInformation mit name = "QIB_Partizipation"	X			

Sachverhalt	Bereich	Darstellung in WMS	Repräs. Test-daten	Massen Test-daten	Anzahl Instanzen ca.	Sonderdatei
CSD-Settlement-Kalender	InstrumentService	CustodyDepository mit InstrumentServiceID .schemeSymbol = „CSD“ GenericInformation mit idSymbol = "SettlementCalendar"	X		8	Dateien mit Produktionsdatum 16.10.2010
Sonderheiten Settlement (Tradegate)	Instrument	Listing ²⁾				

¹⁾ Die Daten zur OECD Country Risk Classification werden auf der Ebene der GeographicUnit geliefert und nicht auf Instrument- und Institutionsebene, da andernfalls sehr große Datenmengen zu verarbeiten wären.

²⁾ Die Details der Darstellung sind noch offen.

2.1.2 Eingefrorene Inhalte/Attribute

Sachverhalt	Bereich	Darstellung WMS
Ablauf der Publikationsfrist	Institution	Assembly.latestDispatchDay
Wertpapiergruppe	Instrument	InstrumentGroupKey mit schemeSymbol = "Wertpapiergruppe"
Wertpapierart	Instrument	InstrumentGroupKey mit schemeSymbol = "Wertpapierart"
letzter Versandtag HV-Einladung	Institution	GenericInformation mit name = „AssemblyRegistrationPeriod.lastPostageDate“
minimales Quotierungsvolumen in Stück im Warranhandel	Institution	TradingRule.priceLowerLimit
Start und Ende Continuous Auctions (XETRA)	Instrument	TradingSession.openingTime TradingSession.closingTime
Issuer Sub-Group Warranhandel (XETRA)	Instrument	ListingGroupKey, schemeSymbol beginnend mit "IssuerSubGroup"
Warrant-Kategorie im Warranhandel (XETRA)	Instrument	ListingGroupKey, schemeSymbol beginnend mit "Warrantkat"

2.2 Anpassung der Lieferprofile

Bitte beauftragen Sie die Aktualisierung Ihrer Profile bis zum **20.09.2010** und passen Sie Ihre Software an.

2.3 Lieferdateien

2.3.1 Referenzdaten

Referenzdaten werden bis zum **20.09.2010** zur Verfügung gestellt und mit dem laufenden Datenstrom ausgeliefert.

2.3.2 Repräsentative Testdaten

Auf Anforderung stehen repräsentative Testdaten ab dem **17.09.2010** zur Verfügung.

2.3.3 Massentestdaten

Massentestdaten stehen auf Anforderung ab dem **24.09.2010** zur Verfügung.

2.3.4 Sonderdateien

Beginnend mit Dateien mit Produktionsdatum **16.10.2010 (zusätzlicher Produktionstag)** werden wir sukzessive die neuen Daten – ihrem individuellen Profil entsprechend - ausliefern.

In der Tabelle im Abschnitt 2.1.1. „Neue und geänderte Inhalte/Attribute“ sind die dafür zu erwartenden Mengen angegeben. Die Mengenangaben beziehen sich dabei auf den Gesamtbestand lebender Finanzinstrumente im Datenhaushalt der WM und reduzieren sich für Sie in Abhängigkeit von der Anzahl der WKNs/ISINs in Ihrer individuellen Bestell-Liste, die von Updates betroffen sind.

Die Daten für die „Nominalbetragsgarantie unter 100%“ werden aufgrund der großen Datenmengen nicht über die o.g. Dateien mit dem Produktionsdatum 16.10.2010 ausgeliefert, sondern hierfür steht bei Bedarf eine CSV-Datei zur Verfügung (s. Kennzeichnung in der Spalte „Sonderdatei“ in der Tabelle im Abschnitt 2.1.1.).

Als Ansprechpartner steht Ihnen Herr Holger Maier Moritz zur Verfügung unter:
service@wmDaten.com bzw. Tel.: +49 (0)69 2732 462

Börsenkürzel-Löschungen

In der Fachinformation F16 „Börsenkürzel Neustrukturierung der Vergabe von Börsenkürzeln“ vom 28.04.2010 informierten wir Sie über die Neustrukturierung der Vergabe von Börsenkürzeln. Die Börsenkürzel werden wie angekündigt bereinigt gemäß dem bisherigen Verfahren. Gelöscht werden Börsenkürzel von Finanzinstrumenten, die bis zum 11.10.2010 deaktiviert wurden. Die Wiederbelegung der Börsenkürzel beginnt am 01.11.2010.

Damit Sie die Löschung der Börsenkürzel aus Ihrem Datenbestand vornehmen können, bieten wir Ihnen **auf Anforderung** Text-Dateien im CSV-Format an. Die Dateien enthalten neben den zu löschenden Börsenkürzeln die zur Zuordnung benötigten Attribute. Es wird eine Datei auf der Ebene Instrument mit

WKN, ISIN, Name des Finanzinstruments, Börsenkürzel sowie
eine Datei auf der Ebene Listing mit

WKN, ISIN, Name des Finanzinstruments, provider2ID des Listings, Börsenkürzel
geliefert.

Es handelt sich um:

- a.) ca. 95.000 Instrumente und
- b.) ca. 200.000 Listing-Instanzen,

deren Börsenkürzel gelöscht werden.

Da es sich um eine große Datenmenge handelt, werden wir die **Löschung am 23./24.10.2010** vornehmen.

Bestellung:

Bitte senden Sie Ihre Bestellung mit der Betreffzeile „Löschung Börsenkürzel FOF per Oktober 2010“ an die E-Mail-Adresse: help-desk@wmdaten.com. Die Bestellung kann ab sofort bis zum 18.10.2010 vorgenommen werden.

Auslieferung:

Die Auslieferung der Dateien beginnt am 13.10.2010.

Für eventuelle Fragen steht Ihnen unser Helpdesk unter +49 (0)69 2732 480 gerne zur Verfügung.

Als Ansprechpartner steht Ihnen Herr Holger Maier Moritz zur Verfügung unter:
service@wmdaten.com bzw. Tel.: +49 (0)69 2732 462

3. Nächstes WM-Release

Der 64. Änderungsdienst wird wirksam zum 28.02.2011.

Als Ansprechpartner steht Ihnen diesbezüglich Herr Siehl zur Verfügung unter:
service@wmdaten.com bzw. Tel.: +49 (0)69 2732 256.

Bestellschein: Test- und Sonderdateien zum 63. Änderungsdienst

Bitte an Fax-Nr.: 069 / 2732 – 7590 senden

Dieser Bestellschein ist nur für Kunden bestimmt, die Test- und Sonderdateien nicht per Abonnement beziehen.

Hiermit bestellen wir:

Datei VF1	<input type="checkbox"/> Repr. Testdatei GAT <input type="checkbox"/> Repr. Testdatei OHC <input type="checkbox"/> Repr. Testdatei A&R <input type="checkbox"/> Repr. Testdatei A&R (E)	<input type="checkbox"/> Massen-Testdatei GAT <input type="checkbox"/> Massen-Testdatei A&R <input type="checkbox"/> Massen-Testdatei A&R (E)	<input type="checkbox"/> Sonderdatei GAT <input type="checkbox"/> Sonderdatei A&R <input type="checkbox"/> Sonderdatei A&R (E) <input type="checkbox"/> Sonderdatei OHC
Datei FOF	<input type="checkbox"/> Repr. Testdatei (XML)	<input type="checkbox"/> Massen-Testdatei (XML)	<input type="checkbox"/> Individuelle Sonderdatei (XML) <input type="checkbox"/> Individuelle Sonderdatei (CSV)
Datenträger	<input type="checkbox"/> E-Mail <input type="checkbox"/> FTP	<input type="checkbox"/> FTP*	<input type="checkbox"/> FTP*
Zeichensatz	<input type="checkbox"/> EBCDIC** <input type="checkbox"/> ASCII <input type="checkbox"/> ANSI		
Handling- preise	Repr. Testdateien VF € 185,- Repr. Testdatei XML € 185,-	Massen- Testdateien VF € 1.050,- Massen- Testdatei XML € 1.050,-	Sonderdateien (eine oder alle) € 600,- Individuelle Sonderdatei XML € 600,-
Alle Preise gelten zzgl. ges. MwSt. und nur für Bezieher der Update-Lieferungen der einzelnen Produkte.			

* Die Dateien stehen am Samstag, den 16.10.2010, ab ca. 10.00 Uhr im FTP-Account für Sie bereit.

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

Bei Bestellung mehrerer Dateien bitte nur ein Bestellblatt verwenden

<input type="checkbox"/> Bestelladresse:	<input type="checkbox"/> Rechnungsadresse:	<input type="checkbox"/> Lieferadresse:
Firma:	Firma:	Firma:
Herrn/Frau:	Herrn/Frau:	Herrn/Frau:
Straße:	Straße:	Straße:
Ort:	Ort:	Ort:
Telefon:	Telefon:	Telefon:
E-Mail-Adresse:	E-Mail-Adresse:	E-Mail-Adresse:

Datum/Unterschrift

Bitte beachten Sie, dass mit der Bestellung sämtlicher Daten zum Änderungsdienst (Tabellen- + Testdaten + Sonderdatei) lediglich die Eigennutzung lizenziert wird. Eine Nutzung durch Dritte ist nicht gestattet.