

Erweiterung WM-Hefte *Online* um Informationen zu Zahlungsausfällen und Sonderheiten Stückzinsberechnung

KUNDENINFORMATION
K35 – 30.09.2009

VF1 (WM Variables Format)

FOF (WM Financial Object Feed)

ONLINE (Info-Line)

WM-Hefte *Online* mit Informationen zu Zahlungsausfällen

Im Zuge der immer noch aktuellen Finanzkrise werden die WM-Hefte *Online*, Teile II und Vb, im Abschnitt M) um die folgenden Informationen zu Zahlungsausfällen wie z. B. Sonderheiten bei der Stückzinsberechnung sowie Eröffnung von Insolvenzverfahren erweitert. In diesem Zusammenhang ändert sich die Überschrift im Abschnitt M) wie folgt:

M) Namensänderungen und Informationen zu Zahlungsausfällen

Beispiele: Insolvenzverfahren Ausland

Lehman Brothers Treasury Co.
B.V., Amsterdam (Niederlande)
CH0043088704 A1A E92 +
Zero Cpn. ST/ SF TWINWIN
Zertifikate 2009/12.09.2011 auf
Commodity-Basket
Insolvenzverfahren Ausland
07.09.2009

Lehman Brothers Holdings Inc.,
Wilmington/Del. (USA)
US52517PYW57 A1A MEC 23.M/J/S/D
(FLR) (20 x (30-Jahres-CMS minus
10-Jahres-CMS); bis März 2006: 15%
Festzins) DL Senior Registered
Floating Rate Medium Term Notes
2005/23.3.2020 Series G
**Antrag gemäß Chapter 11 des Federal
Bankruptcy Act**
Zahlung ausgesetzt 08.09.2009

Beispiel: Sonderheiten Stückzinsberechnung

Kommunalkredit Capital I Ltd., St.
Helier (Jersey)
DE000A0DHT43 A0D HT4 ■ + 20.12.
(FLR) (6,5%; ab 20.12.05 10-Jahres-
CMS plus 0,025%, max. 8%) EO
Subordinated Undated
Non-Cumulative Floating Rate
Capital Notes 2004 (Undated)
**flat (indirekte Stückzinsberechnung
über den Abrechnungskurs)**
02.09.2009

Mit Hilfe des WM-Hefte-Matching-Tool und der tagesaktuellen WM-Hefte *WM-Hefte Online Aktuell* können Sie damit Ihre Bestände hinsichtlich Änderungen sehr einfach und sicher überwachen.

Neue Version WM-Hefte-Matching-Tool: Im Zuge der Erweiterung wurde auch eine neue Matching-Tool-Version 2.5 bereitgestellt. Diese kann direkt über unsere Internetseite www.wmdata.com und dort unter WM-Hefte *Online* => WM-Hefte *Online Aktuell* heruntergeladen werden. Bitte beachten Sie, dass Sie für die Installation dieser Software über Administrationsrechte verfügen müssen. Gegebenenfalls benötigen Sie hierfür Ihre IT.

Direkter Link: zum Download WM-Hefte-Matching-Tool, Version 2.5

http://www.wmdata.com/intra/wmhefte_index_day_cas.php?link=37