

Dateien zum 24. und 31.12.2009 (Target2-Tage)

KUNDENINFORMATION
K45 – 07.12.2009

VF1 (WM Variables Format)

FOF (WM Financial Object Feed)

ONLINE (Info-Line)

1. Dateien am 24.12.2009

Wie in unserer Kundeninfo K01 – „Liefer- und Präsenztage des WM Datenservice in 2009/Verfügbarkeit von Target2“ vom 05.01.2009 angekündigt werden wir Ihnen am 24.12.09 Datenströme zur Verfügung stellen, obwohl keine WM-Präsenz gegeben ist. An diesem Tag werden Ihnen die Datenströme wie folgt bereitgestellt.

1.1. Datenbereitstellung im VF1

Wir werden am 24.12.2009 **gegen 13:00 Uhr** Tages-Dateien für folgende Produkte bereitstellen:

- **GAT** (Arbeitsgebiete B bis V)
- **A&R1/A&R1-E** (Anlage-/Risiko-Management)
- **MiR** (MiFID Reference)
- **RKL** (Risikoklassen)
- **OHC** (Order Handel Clearing)
- **IFK** (Investmentfonds Kennzahlen)
- **S&P, Moody's, Fitch** (Ratings)

Sollten für einzelne der genannten Produkte keine Daten vorliegen, erhalten Sie eine Leerdatei mit Vorlauf-/und Datenendesatz.

Da es sich am 24.12.2009 **nicht** um einen **Börsentag** handelt, werden für folgende Produkte **keine Dateien** bereitgestellt (ausgenommen sind die Daten vom 23.12.09 für **EBK** und **O&F**):

- **IFP** letzte Lieferung am: 23.12.2009, gegen 20:30 Uhr,
nächste Lieferung am: 28.12.2009, gegen 7:00 Uhr.
- **BBP** letzte Lieferung am: 23.12.2009,
nächste Lieferung am: 28.12.2009, zur üblichen Zeit.
- **EBK** letzte Lieferung am: 24.12.2009, zur üblichen Zeit frühmorgens,
nächste Lieferung am: 29.12.2009, zur üblichen Zeit frühmorgens.
- **O&F** letzte Lieferung am: 24.12.2009, zur üblichen Zeit frühmorgens,
nächste Lieferung am: 29.12.2009, zur üblichen Zeit frühmorgens.
- **uGAT*** letzte Lieferung am: 23.12.2009, gegen 18:00 Uhr,
nächste Lieferung am: 28.12.2009, gegen 5:00 Uhr.
- **uOHC**** letzte Lieferung am: 23.12.2009, gegen 18:00 Uhr,
nächste Lieferung am: 28.12.2009, gegen 5:00 Uhr.

* GAT untertäglich

** OHC untertäglich

Produktions-/Erstellungsdatum, Name	Selektionszeitraum	Terminierung
24.12.2009 (WM091224.xxxxx)	23.12.2009 ca. 17:00 bis 24.12.2009 ca. 12:00	Umsetzungen bis 28.12.2009

1.2. Datenbereitstellung im FOF

Der **24.12.2009** ist für den WMS-Betrieb regulärer Produktionstag, und WM Datenservice wird Update-Dateien mit Produktionsdatum 24.12.2009 ausliefern.

Die Lieferung erfolgt auf dem üblichen Weg.

1.3. Datenbereitstellung Info-Line

siehe Punkt 2.3.

2. Dateien zum 31.12.2009 (Jahreswechsel)

Wie in unserer Kundeninfo K01 - „Liefer- und Präsenztage des WM Datenservice in 2009/Verfügbarkeit von Target2“ vom 05.01.2009 angekündigt werden wir Ihnen zum Jahreswechsel Datenströme wie folgt bereitstellen.

2.1. Datenbereitstellung im VF1

Um Ihnen eine exakte Terminabgrenzung zum Jahreswechsel 2009/2010 zu ermöglichen, werden wir **am 30.12.2009 zwei Dateien** bereitstellen.

1. Datei:

Produkte:

- **GAT** (Arbeitsgebiete B bis V)
- **A&R1/A&R1(E)** (Anlage-/Risiko-Management)
- **MiR** (MiFID Reference)
- **RKL** (Risikoklassen)
- **OHC** (Order Handel Clearing)
- **IFK** (Investmentfonds Kennzahlen)
- **S&P, Moody's, Fitch** (Ratings)

Produktions-/Erstellungsdatum, Name	Selektionszeitraum	Terminierung
30.12.2009 (WM091230.xxxxx)	29.12.2009 ca. 16:45 bis 30.12.2009 ca. 16:45	Umsetzungen bis 31.12.2009

2. Datei:

In **GAT** sind **keine** neuen und geänderten Bezugsgruppen der **Arbeitsgebiete B, E, H, K, M, U und V** enthalten.

- **GAT** (Arbeitsgebiete G und P)
- **A&R1/A&R1(E)** (Anlage-/Risiko-Management)
- **MiR** (MiFID Reference)
- **RKL** (Risikoklassen)
- **OHC** (Order Handel Clearing)
- **IFK** (Investmentfonds Kennzahlen)
- **S&P, Moody's, Fitch** (Ratings)

Liegen für einzelne Produkte keine Daten vor, erhalten Sie eine **Leerddatei** mit Vorlauf- und Ende-Satz.

Produktions-/Erstellungsdatum, Name	Selektionszeitraum	Terminierung
30.12.2009 (WM091231.xxxxx)	30.12.2009 ca. 16:45 bis 31.12.2009 ca. 16:45	Umsetzungen bis 04.01.2010

Aufgrund der erstmaligen Lieferung von Tick Sizes im Feld XD546 für Xetra zum 04.01.2010 erwarten wir erhöhte Datenmengen im Produkt OHC. Es werden ca. 16.000 Datensätze zusätzlich geliefert. Die Abstimmung zu diesem Thema ist noch nicht endgültig abgeschlossen. Wenn sich hier noch Änderungen ergeben, werden wir Sie so zeitnah wie möglich unterrichten.

Zum 01.01.2010 erhält Tradegate (Code AJ9) den Status „Regulierter Markt“ gemäß MiFID (bisher MTF). Dies bewirkt für die ca. 8.500 auf Tradegate handelbaren Instrumente eine Änderung in den Feldern GD663D (§9-WPHG-MELDEPFLICHT FÜR DEUTSCHE FREIVERKEHRE) und XD022 KZ REGULIERTER MARKT/MTF GEM. MIFID. Betroffen sind die Produkte **GAT** (Arbeitsgebiet G), **OHC** und **MIR**. Die Daten werden im zweiten Datenstrom vom 30.12.09 geliefert.

Zurzeit werden Daten zu Tradegate im Produkt **OHC** mit dem Code AJ9 bereitgestellt. Die Abstimmung, ob der neue Status als „Regulierter Markt“ eine Änderung des Börsencodes notwendig macht, ist noch nicht abgeschlossen. Auch hierzu werden wir Sie so zeitnah wie möglich unterrichten.

Lieferwege und Bereitstellungstermine

Lieferweg am 30.12.2009	1. Datei	2. Datei
WM-FTP	18:00 Uhr	20:00 Uhr
WM-Connect: Direct	18:00 Uhr	20:00 Uhr
Deutsche Börse Systems AG	17:30 Uhr	18:30 Uhr
ONGUM der dwpbank	18:00 Uhr	Allgemein: 19:30 OHC, IFK, MiR: 31.12.09 3:00 Uhr

Verarbeitungsreihenfolge

- Update vom 30.12.2009** mit Terminumsetzungen bis 31.12.2009
- Update vom 30.12.2009** mit Terminumsetzungen bis 04.01.2010
- Update vom 04.01.2010** mit Terminumsetzungen bis 05.01.2010

- IFP (WM-Investmentfonds)
- EBK (Einheitliche Bewertungskurse)
- BBP (Berechnete Bondpreise)
- O&F (Options & Futures)
- uGAT (untertägige? Gattungsdatei)
- uOHC (" Order/Handel/Clearing

Diese Produkte werden für das Jahr 2009 vollumfänglich letztmalig für den 30.12.2009 zu den üblichen Lieferzeiten (das bedeutet für EBK und O&F am 31.12.2009 frühmorgens) bereitgestellt.

2.2. Datenbereitstellung im FOF

Alle Terminumsetzungen bis zum **31.12.2009** werden in den Update-Dateien mit **Produktionsdatum 30.12.2009** bereitgestellt.

Alle Terminumsetzungen bis zum **04.01.2010** werden in den Update-Dateien mit **Produktionsdatum 31.12.2009** ausgeliefert.

In den Dateien mit Produktionsdatum 31.12.2009 sind zusätzlich folgende Daten zu erwarten:

Aufgrund der erstmaligen Lieferung von Tick Sizes in der ListingGroup mit schemeSymbol „Regelung_Tickgroesse_XONTRO“ für Xetra zum 04.01.2010 erwarten wir erhöhte Datenmengen im Bereich Listing. Es werden ca. 16.000 Listing-Instanzen zusätzlich geliefert. Die Abstimmung zu diesem Thema ist noch nicht endgültig abgeschlossen. Wenn sich hier noch Änderungen ergeben, werden wir Sie so zeitnah wie möglich unterrichten.

Zum 01.01.2010 erhält Tradegate (InstrumentService mit InstrumentServiceID.idSymbol = AJ9 im Schema mit schemeSymbol = ‚Boerse‘) den Status „Regulierter Markt“ gemäß MiFID (bisher „MTF“). Dies bewirkt für die ca. 8.500 auf Tradegate handelbaren Instrumente eine Änderung bei der §9-WPHG-Meldepflicht für deutsche Freiverkehrer (ReportingGroupKey mit schemeSymbol = ‚Meldepfl_WpHG_EWR_EU‘) und im Kennzeichen „Regulierter Markt gemäß MiFID“ (GenericInformation mit name = ‚TradingPlace.regulatedMarket‘).

Zurzeit wird für den TradingPlace „Tradegate“ der Börsencode AJ9 (InstrumentServiceID.idSymbol = AJ9 im Schema mit schemeSymbol = ‚Boerse‘) verwendet. Die Abstimmung, ob der neue Status als „Regulierter Markt“ eine Änderung des Börsencodes notwendig macht, ist noch nicht abgeschlossen. Auch hierzu werden wir Sie so zeitnah wie möglich unterrichten.

2.3. Datenbereitstellung Info-Line

Types of Corporate Actions

Keine Lieferung am 24.12. u. 31.12.2009

Alle Informationen des 23. und 24.12. werden in der Nacht zum 28.12.2009 versendet; die des 30.12. in der Nacht zum 04.01.2010.

Event Calendar (alle Profile):

Keine Lieferung am 31.12.2009

Die Informationen des 24.12. werden in der Nacht zum 28.12.2009 versendet; die des 30.12. in der Nacht zum 04.01.2010.

WM-HefteOnline:

Am 24. und 31.12.2009 werden keine tagesaktuellen Hefte (WM-HefteOnlineAktuell) produziert.

Die Wochenhefte (WM-HefteOnlineArchiv) der Kalenderwochen 52 und 53 erscheinen am 28.12.2009 bzw. am 04.01.2010.

WM-DatenOnline:

Alle Module von WM-DatenOnline stehen vollumfänglich auch an allen Feiertagen zur Verfügung. Ihre Aktualisierung ist abhängig von den jeweiligen Datenanlieferungen der Emittenten und der elektronischen Verarbeitung im Hause. Hier kann es situativ zu einer verzögerten Datenbereitstellung kommen.