

# Zusätzliche Daten in der 2. Datei zum 31.12.2009 – Tick Size und Tradegate als Regulierter Markt

KUNDENINFORMATION  
K47 – 21.12.2009

**VF1** (WM Variables Format)

**FOF** (WM Financial Object Feed)

**ONLINE** (Info-Line)

Wie in unserer Kundeninformation K45 – Dateien zum 24. und 31.12.2009 (Target2-Tage) vom 07.12.2009 angekündigt, werden wir in der zweiten Datei am 30.12.2009 zusätzlich Informationen zu Tick Size Xetra, Änderungen der Tick-Size-Regelung für Xontro sowie zur Erlangung des Status „Regulierter Markt“ durch Tradegate liefern. Eine Fachinformation zu den Änderungen der Tick-Size-Regelungen veröffentlichen wir in Kürze.

## 1. Datenbereitstellung im VF1

In der zweiten Datei am 30.12.2009 liefern wir Ihnen mit DaWi 04.01.2010 die folgenden zusätzlichen Daten:

### Im Produkt GAT (Arbeitsgebiet G)

liefern wir Ihnen ca. 8.500 Datensätze mit einer geänderten Belegung im Feld GD663D \$9-WPHG-MELDEPFLICHT FÜR DEUTSCHE FREIVERKEHRE wegen Tradegate.

### Im Produkt OHC

liefern wir Ihnen ca. 15.000 Datensätze mit der erstmaligen Belegung im Feld XD546 TICK-GRÖSSE für die Tick Size Regelung in Xetra.

Weiterhin liefern wir Ihnen ca. 57.000 Datensätze mit einer geänderten Belegung im Feld XD546 TICK-GRÖSSE für die geänderte Tick-Size-Regelung in Xontro.

Für die Änderungen zu Tradegate liefern wir Ihnen ca. 8.500 Datensätze mit einer geänderten Belegung im Feld XD021 BÖRSENART (Umstellung von Schlüssel 8 „Handelssystem“ in „Wertpapierbörse“ Schlüssel 1).

### Im Produkt MIR

liefern wir Ihnen ca. 8.500 Datensätze mit einer geänderten Belegung in den Feldern GD663D \$9-WPHG-MELDEPFLICHT FÜR DEUTSCHE FREIVERKEHRE und XD022 KZ REGULIERTER MARKT/MTF GEM. MiFID wegen Tradegate.

## 2. Datenbereitstellung im FOF

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

### Tick Size

Im Bereich Listing ist aufgrund erstmaliger und geänderter Belegung der Tick Size mit folgendem Datenaufkommen zu rechnen:

ca. 15.000 Listing-Instanzen für die erstmalige Lieferung von Tick Sizes für Xetra,

ca. 57.000 Listing-Instanzen für die geänderte Belegung der Tick Sizes in Xontro.

Die Auslieferung erfolgt in ListingGroup mit schemeSymbol „Regelung\_Tickgroesse\_XONTRO“.

## Tradegate

### *auf Instrumentenebene*

Für ca. 8.500 Instrumente ergeben sich die folgenden Änderungen:

- a) §9-WPHG-Meldepflicht für deutsche Freiverkehr:  
ReportingGroupKey mit schemeSymbol = ‚Meldepfl\_WpHG\_EWR\_EU‘
- b) Kennzeichen „Regulierter Markt gemäß MiFID“:  
GenericInformation mit name = ‚TradingPlace.regulatedMarket‘

### *auf Ebene InstrumentService*

Die Kennzeichnung der Börsenart erfolgt im Attribut `methodType` in der Klasse `TradingPlace` (Unterklasse von `InstrumentService`). Angepasst wird die Instanz von `InstrumentService`, die über die Klasse `InstrumentServiceID` mit `schemeSymbol = Boerse` und `idSymbol = AJ9` identifiziert ist.