

Einführung der CASCADE-Funktionalität „Direct Matching“ für Wertpapierüberträge mit Gegenwertverrechnung

Zum

29. Juni 2009

wird die CASCADE-Funktionalität des automatischen Instruktionsabgleichs (Matching) bestimmter Matchkriterien von Wertpapierübertrag (Auftragsart 01) und Match-Instruktion (Auftragsart 02) für Wertpapierüberträge mit Gegenwertverrechnung (Delivery versus Payment, im folgenden auch DvP) um ein weiteres optionales Eingabefeld erweitert.

Leistungsumfang

Die CASCADE-Auftragsarten "WP-Übertrag" und "Match-Instruktion" mit Gegenwert werden um ein weiteres optionales Eingabefeld ergänzt.

Wünschen Sie ein gezieltes Matching zu einer bereits in CASCADE vorhandenen Gegeninstruktion, kann das neue Referenzfeld "GEGEN-AUFTNR" befüllt werden. Dort können Sie die bekannte CASCADE-Auftragsnummer der Gegeninstruktion einstellen.

Diese zusätzliche optionale Referenz dient dem direkten Matching mit der definierten Gegeninstruktion. Cross-Matching-Fehler können somit zukünftig verhindert werden.

Das neue Feld wird sowohl in die Online-Dienste (CASCADE-Host, CASCADE-PC) als auch in die Dienste zum Datenaustausch (File-Transfer, SWIFT, IBM WebSphere MQ Series) im ISO-Standard 15022 (MT 537, 541, 542, 543 bis 548) integriert. Das Format ISO7775 wird nicht unterstützt.

CASCADE-Host: WP-Übertrag DvP

TRAN: KVEE FC: WE SB:		
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / FOLGEERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE:	AUFTNR: 1	WKN: I DE0007100000
BEGUENSTIGTE DEPOTBANK: BLZ	_____	
ENDBEGUENSTIGTER : KTO	_____	
NAME / ADRESSE:	_____	
AUFTRAGGEB. DEPOTBANK :	_____	
ORIG-AUFTRAGGEBER : _____		
NAME / ADRESSE:	_____	
GEGEN-AUFTNR:		
UEB-GRUND :	_____	
BELEGSCHAFT-SP: N SP-DATUM :	_____	KUPONINFO/RECORD-DATE: _____
TEXT :	_____	
-- ID-KZ: 7907000000 -- PW:		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF7:Zurück		

CASCADE-Host: Match-Instruktion DvP

TRAN: KVEE FC: MI SB:		
AUFTRAGSABWICKLUNG	MATCH-INSTRUKTION / ERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: _____	AUFTNR: 2	VWA: GS SVG
LAST-KTO : 1234 000	LIEFER-BANK AG	
GUT-KTO : 5678 000	EMPFANGS-BANK AG	
WKN : W 710000	DAIMLER AG O.N.	
I DE0007100000		
NOMINALE : 100	EINHEIT: ST	SELBSTBES (J/N/) : _
GEGENWERT: 100,00	WRG : EUR	EMISS-EINF (J/N) : N
SET-DAY : 30.06.2009	SET-ART: 3 MAS	SET-SP (J/N) : N
BEGUENSTIGTE DEPOTBANK: _____		
ENDBEGUENSTIGTER : _____		
AUFTRAGGEB. DEPOTBANK :	_____	
ORIG-AUFTRAGGEBER :	_____	
KURS / WRG : _____	SCHLUSSTAG : 29.06.2009	
REFERENZ-NR : _____	AUFTRAGS-REFERENZ :	
-- ID-KZ: 7907000000 -- PW:	GEGEN-AUFTNR:	
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch		

ISO15022 Standard

Im MT537 (Anzeige offener Geschäfte), MT541 (Match-Instruktion DvP), MT542 (WP-Übertrag ohne Gegenwert), MT543 (WP-Übertrag DvP) und MT548 (Settlement Status) wird das neue Feld GEGEN-AUFTNR wie folgt integriert:

SWIFT-Message Fields and Contents	Comments
MT537: :70E::TRDE//CPRE KP12340276543210 *	Kontrahenten CASCADE-Referenz
MT541: :70E::DECL//CPRE KP12340112345670 *	Kontrahenten CASCADE-Referenz
MT542 und 543: :70E::DECL//CPRE KP12340276543210 *	Kontrahenten CASCADE-Referenz
MT548: :70E::SPRO///CPRE KP12340276543210 *	Kontrahenten CASCADE-Referenz

*Die 16-stellige CASCADE-Referenz "KP12340112345670" enthält an den Stellen 9 bis 15 die CASCADE-(Gegen-) Auftragsnummer (weitere Details siehe Connectivity Handbuch, Kapitel 2.1.6.3, Beschreibung Feld 20 C).

Für bei CBF eingehende Nachrichten erfolgt die Integration des neuen Feldes "GEGEN-AUFTNR" analog der oben dargestellten Tabelle, für von CBF ausgehende Nachrichten (MT537 und MT548) gelten folgende Regeln:

Reporting im MT537 "Statement of Pending Instructions"

Im MT537 wird das neue Feld "GEGEN-AUFTNR" (sofern vorhanden) mit dem Label: /CPRE direkt nach dem Feld mit dem Label /QRYR integriert:

:70E::TRDE//QRYR Q02-01/CPRE KP12340276543210

Reporting im MT548 "Status and Processing Advice"

Bisher wurde im Feld :70E::SPRO der Nachricht MT548 nur der Inhalt des CASCADE Feldes "TEXT" übermittelt.

Hier wird das neue Feld "GEGEN-AUFTNR" (sofern vorhanden) mit Label /CPRE vor dem Feld "TEXT", das zukünftig mit dem Label /FREE eingeleitet wird, integriert:

:70E::SPRO///CPRE KP12340276543210/FREE "Freier Text"

Nächste Schritte

Mit Einführung des Matching für Wertpapiertransaktionen ohne Gegenwertverrechnung (geplanter Einsatztermin 23. November 2009), das so genannte Free of Payment Matching, wird die neue Direct Matching Funktionalität auch für Match-Aufträge und Match-Instruktionen ohne Gegenwertverrechnung ermöglicht werden.

Weitere Informationen

Bei Rückfragen steht Ihnen der Customer Service Domestic unter den folgenden Kontaktmöglichkeiten zu Verfügung:

Customer Service Domestic	
E-Mail:	csdomestic@clearstream.com
Telefon:	+49-(0) 69-211-1 11 77
Fax:	+49-(0) 69-211-61 11 77