

# **CASCADE Handbuch Band 3**

für Kunden der Clearstream Europe AG

(Effektiver Wertpapierbereich)

## **CASCADE Handbuch Band 3**

Clearstream Europe AG

Dokument-Nummer: F-CON04

Juni 2026

Die im vorliegenden Dokument enthaltenen Informationen können ohne weitere Mitteilung geändert werden und stellen keine Zusage seitens Clearstream Europe AG (nachfolgend als Clearstream Europe AG oder CEU bezeichnet) oder eines anderen zur Clearstream Holding AG gehörenden Unternehmens dar. Ohne die ausdrückliche schriftliche Zustimmung von Clearstream Europe AG darf kein Teil des vorliegenden Handbuchs zu irgendeinem Zweck in irgendeiner Form oder auf irgendeine Weise, einschließlich der Erstellung von Fotokopien und Aufzeichnungen, reproduziert oder übertragen werden.

Vorbehaltlich gegenteiliger Angabe erfolgen alle Zeitangaben in Mitteleuropäischer Zeit (MEZ).

© Copyright Clearstream Europe AG (2026). Alle Rechte vorbehalten.

# Vorwort

Dieses Benutzerhandbuch informiert den Kunden von Clearstream Europe AG (nachfolgend CEU) über die Bedienung der Online-Anwendung CASCADE-Host der CASCADE-Abwicklungsplattform. Neben der Beschreibung der Online-Funktionalitäten liefert das Benutzerhandbuch auch Hintergrundinformationen zur Wertpapierabwicklung über CASCADE.

Das Benutzerhandbuch untersteht den Allgemeinen Geschäftsbedingungen von CEU. Die im CASCADE-Benutzerhandbuch enthaltenen Informationen gelten in Verbindung mit anderen CEU-Publikationen (CEU-Kundenhandbuch, CEU Connectivity Handbook, Market Link Guides), Kundeninformationen und sonstigen Benutzerhandbüchern, die weitere Details hinsichtlich der Nutzung der Serviceleistungen von CEU beschreiben. Gültig ist jeweils die aktuelle Fassung auf der Website [www.clearstream.com](http://www.clearstream.com). Für Fragen zu Inhalten dieses Handbuchs wenden Sie sich bitte an Clearstream Client Services oder Ihren Relationship Officer.

Das CASCADE-Benutzerhandbuch ist in drei Bände aufgeteilt. Die vorliegende Dokumentation ist der dritte Band und beinhaltet die CASCADE-Funktionalitäten, wie sie für den effektiven Wertpapierbereich genutzt werden können.

## Band 1

- Allgemeine Informationen zur CASCADE-Plattform und Systeminformationen zur Online-Schnittstelle
- Abwicklung von Börsengeschäft für nicht CCP (Central Counterparty) Geschäfte
- Abwicklung von OTC-Geschäft
- Abwicklung von Lieferinstruktionen des CCP
- Geldregulierung

## Band 2

- Bestandsführung und Depotumsätze
- Custody Services (Income und Non Income)
- Special Services zu Namensaktien
- Collateral Services
- Reporting (Listen und Auswertungen)
- Tabellen und Schlüsselverzeichnisse
- Glossar

## Band 3

- eMission Service
- Allgemeine Informationsdienste (z. B. Umsatzinformationen)
- Auswertungen
- Depotdisposition und Depotbuchung für Ein- und Auslieferungen
- Autodispo-Service
- Euro-Umstellung für Wertpapiere
- Anhänge: Tabellen und Schlüsselverzeichnisse

Leerseite

# Inhalt

## Vorwort

## 1 Zentrale Abwicklungsplattform

## 2 Wertpapierzulassung mit T2S

## 3 eMission Service

|       |  |     |
|-------|--|-----|
| 3.1   | eMission All-In .....                  | 3-1 |
| 3.2   | eMission Trades Only .....             | 3-2 |
| 3.3   | eMission Security Box .....            | 3-2 |
| 3.3.1 | Pre-Admission .....                    | 3-2 |
| 3.3.2 | Zulassung mittels Auto Admission ..... | 3-3 |
| 3.3.3 | Zulassung ohne Auto Admission .....    | 3-3 |
| 3.4   | eMission Data Sprint .....             | 3-3 |
| 3.5   | eMission-Zulassungen .....             | 3-4 |
| 3.5.1 | Aktien .....                           | 3-4 |
| 3.5.2 | Investmentfonds .....                  | 3-4 |
| 3.5.3 | Landesschatzanweisungen .....          | 3-5 |

## 4 Kontakte

|     |                       |     |
|-----|-----------------------|-----|
| 4.1 | Ansprechpartner ..... | 4-1 |
|-----|-----------------------|-----|

## 5 Anmeldung zu den Online-Serviceleistungen

## 6 Das Zugriffsschutz-System

## 7 Online-Passwortänderung

## 8 Allgemeingültige Feldeingaberegeln

## 9 Tastenbelegung

## 10 Allgemeingültige Felddescriptions und Formalprüfungen

## 11 Spezifische Felddescriptions und Formalprüfungen

|        |   |      |
|--------|---|------|
| 11.1   | Stückenummern .....   | 11-1 |
| 11.1.1 | Erfassung der Stückenummern – Begriffe und Zeichensatz .....              | 11-1 |
| 11.1.2 | Erfassung von Ziffern, Buchstaben und Zeichen für Stückenummerneingabe .. | 11-4 |
| 11.1.3 | Anzeige der Stückenummern in der Anwendung .....                          | 11-4 |
| 11.1.4 | Bearbeitung der erfassten Stückenummern .....                             | 11-5 |
| 11.2   | Die Kundenreferenz .....  | 11-7 |
| 11.2.1 | Format der Kundenreferenz .....   | 11-7 |

## 12 Spezifische Felddescriptions und Formalprüfungen

|      |                     |      |
|------|---------------------|------|
| 12.1 | Stückenummern ..... | 12-1 |
|------|---------------------|------|

|        |  |      |
|--------|--|------|
| 12.1.1 | Erfassung der Stückenummern – Begriffe und Zeichensatz                 | 12-1 |
| 12.1.2 | Erfassung von Ziffern, Buchstaben und Zeichen für Stückenummerneingabe | 12-4 |
| 12.1.3 | Anzeige der Stückenummern in der Anwendung                             | 12-4 |
| 12.1.4 | Bearbeitung der erfassten Stückenummern                                | 12-5 |
| 12.2   | Die Kundenreferenz   | 12-7 |
| 12.2.1 | Format der Kundenreferenz  | 12-7 |

## 13 T2S-bedingte Validierungen in AA16 / AA18 Instruktionen

## 14 Hauptauswahlmenü CASCADE-Auftragsabwicklung

## 15 Erfassung von Aufträgen (EW)

|        |  |       |
|--------|--|-------|
| 15.1   | Erfassung von Aufträgen zur laufenden Einlieferung von Wertpapieren (EL)                                   | 15-3  |
| 15.1.1 | Direktive 2014/91/EU   | 15-3  |
| 15.1.2 | Buchungsrelevante Auftragsdaten  | 15-4  |
| 15.1.3 | Wertpapierrelevante Folgedaten   | 15-7  |
| 15.1.4 | Folgedaten Stückenummern   | 15-10 |
| 15.1.5 | Änderung Kennzeichen SAMMELURKUNDE (J/N)   | 15-14 |
| 15.2   | Erfassung Neuzulassung/Valutierung (NV)  | 15-15 |
| 15.2.1 | Berechtigungsprüfung bei Valutierung   | 15-15 |
| 15.2.2 | Autom. Buchungsfreigabe Valutierung  | 15-16 |
| 15.2.3 | Untertägige Tresorvereinnahmung und automatische Überleitung in den Kontrollierten CARAD Bestand           | 15-16 |
| 15.2.4 | Neuzulassung Rahmenurkunde mit gleichzeitiger Valutierung  | 15-16 |
| 15.2.5 | Buchungsrelevante Auftragsdaten  | 15-18 |
| 15.2.6 | Wertpapierrelevante Folgedaten   | 15-22 |
| 15.2.7 | Stückenummern Folgedaten   | 15-24 |
| 15.3   | Erfassung von Aufträgen zur effektiven Auslieferung oder Revalutierung/Teilreduzierung von Emissionen (AL) | 15-27 |
| 15.3.1 | Direktive 2014/91/EU   | 15-27 |
| 15.3.2 | Berechtigungsprüfung bei Revalutierung ohne Auslieferung Rahmenurkunde                                     | 15-28 |
| 15.3.3 | Autom. Buchungsfreigabe Revalutierung ohne Auslieferung  | 15-28 |
| 15.3.4 | Buchungsrelevante Auftragsdaten  | 15-29 |
| 15.3.5 | Folgedaten Versand   | 15-32 |
| 15.3.6 | Stückenummern und Stückelung Folgedaten  | 15-33 |

## 16 Autodispo-Service

|      |   |      |
|------|---|------|
| 16.1 | Einführung der automat. Valutierung und Revalutierung für Zertifikate, Optionsscheine und definierte Anleihen | 16-1 |
| 16.2 | Prozessvoraussetzungen  | 16-2 |

## 17 Änderung/Löschung (EB)

|      |                        |      |
|------|------------------------|------|
| 17.1 | Änderung von Aufträgen | 17-1 |
|------|------------------------|------|

|           |  |      |
|-----------|--|------|
| 17.1.1    | Änderung fehlerhafter Aufträge (AF) .....  | 17-2 |
| 17.1.2    | Änderung eines Auftrages über die Auftragsnummer (AN) .....  | 17-3 |
| 17.2      | Löschung von Aufträgen .....   | 17-5 |
| 17.2.1    | Löschung fehlerhafter Aufträge (LF) .....  | 17-5 |
| 17.2.2    | Löschung eines Auftrages über die Auftragsnummer (LN) .....  | 17-6 |
| <b>18</b> | <b>Information (EI)</b>  |      |
| <b>19</b> | <b>Kontrolle (EC)</b>  |      |
| 19.1      | Kontrolle über die Vollanzeige .....   | 19-2 |
| 19.2      | Kontrolle über die tabellarische Kurzanzeige .....   | 19-5 |
| 19.2.1    | Kontrollvorgänge .....   | 19-6 |
| 19.3      | Automatische Löschung von Einlieferungsaufträgen im Erfassungsstatus .....   | 19-8 |
| <b>20</b> | <b>Information (AI)</b>  |      |
| 20.1      | Aktuelle Aufträge (AA, AN, AD, AK, SR) .....   | 20-2 |
| 20.2      | Historische Aufträge (HA) .....  | 20-5 |
| 20.3      | Information über Vollanzeige .....   | 20-6 |
| <b>21</b> | <b>Änderung/Löschung (AA)</b>  |      |
| 21.1      | Markierung zur Änderung (MA) .....   | 21-1 |
| 21.2      | Markierung zur Löschung (ML) .....   | 21-4 |
| 21.3      | Autom. Löschung von Einlieferungsaufträgen zu denen keine Stücke eingeliefert wurden<br>21-7                       |      |
| 21.3.1    | Systeminformationen zu Fristen (KVAV) .....  | 21-7 |
| 21.3.2    | Online-Information zu den gültigen Fristen (IS) .....  | 21-7 |
| 21.3.3    | Prüfung auf Fristüberschreitung .....  | 21-7 |
| 21.4      | Automatische Löschung von Aufträgen bei Redenomination .....   | 21-8 |
| <b>22</b> | <b>Belege</b>  |      |
| 22.1      | Einlieferungsauftrag .....   | 22-1 |
| <b>23</b> | <b>Auswertungen</b>  |      |
| <b>24</b> | <b>Listen aus CASCADE</b>  |      |
| 24.1      | CASCADE-Tageslisten Erfassungsstatus .....   | 24-1 |
| 24.1.1    | Liste der Aufträge für Einlieferungen, die bereits fünf Bankarbeitsarbeitstage im<br>Erfassungsstatus stehen ..... | 24-2 |
| 24.2      | CASCADE-Tageslisten Auftragsstatus .....   | 24-2 |
| 24.3      | Erfassungs- und Auftragsstatus CASCADE .....   | 24-3 |
| 24.3.1    | Oppositionsliste zu Einlieferungen .....   | 24-3 |
| 24.4      | Weitere Auswertungen für Einlieferungen .....  | 24-4 |
| 24.4.1    | Avisé .....  | 24-4 |
| 24.5      | Auswertungen für die Einlieferung von Namensaktien vor dem GS-Stichtag .....                                       | 24-4 |

|        |   |      |
|--------|---|------|
| 24.6   | List-Identifikation .....                   | 24-5 |
| 24.6.1 | CASCADE-Auftragsabwicklung .....            | 24-5 |
| 24.6.2 | CASCADE-Verarbeitung .....                  | 24-6 |
| 24.6.3 | CASCADE-Dienste für Namensaktien (RS) ..... | 24-6 |

**25 Depot-Disposition und Buchung**

|        |   |      |
|--------|---|------|
| 25.1   | Die Auftragsarten „Einlieferung“ und „Auslieferung“ ..... | 25-1 |
| 25.1.1 | Gesamtablauf im zeitlichen Überblick .....                | 25-1 |
| 25.2   | Rückgabe von Aufträgen .....                              | 25-2 |
| 25.2.1 | Rückgabe von Einlieferungen .....                         | 25-2 |
| 25.2.2 | Rückgabe von Auslieferungen .....                         | 25-2 |

**26 Euro-Umstellung**

|      |  |      |
|------|--|------|
| 26.1 | Top-Down mit Eingabe der Nominale in EUR .....   | 26-1 |
| 26.2 | Bottom-Up mit Eingabe der Nominale in EUR .....  | 26-3 |
| 26.3 | Bottom-Up mit Eingabe der Nominale Urkunde ..... | 26-5 |

**Anhang 1: Transaktionscodes und die zugehörigen Funktionscodes**

|                                       |      |
|---------------------------------------|------|
| Clearing und Settlement/Custody ..... | 27-1 |
|---------------------------------------|------|

**Anhang 2: Tabellen (Schlüsselverzeichnisse)**

**Anhang 3: Tabellen (Berechtigungsprüfung)**

**Anhang 4: Tabellen (Buchungstextschlüssel)**

# 1 Zentrale Abwicklungsplattform

Der Wunsch nach schneller und benutzerfreundlicher Verfügbarkeit einer Vielzahl von Abwicklungs-Dienstleistungen war der Grund für die Entwicklung von CASCADE (Central Application for Settlement, Clearing and Depository Expansion). CASCADE umfasst die Dienstleistungen Auftragserteilung und Auftragsverwaltung für den Giro- und Effektivbereich. Die Abwicklung von Wertpapiertransaktionen in Zentralbankgeld leistet CEU unter Nutzung der TARGET2-Securities (T2S) Plattform des Eurosystems.

Zusätzlich zur Abwicklung von Wertpapieraufträgen im Effektivbereich während der Nachtverarbeitung (für Informationen zu Settlementzyklen siehe CEU Kundenhandbuch) ermöglicht T2S:

- Real-Time-Settlement – also die sofortige Buchung für Ein- und Auslieferung von effektiven Wertpapieren, insbesondere zur Abwicklung von Neu-Emissionen

Mit der Erfassung von Einlieferungsaufträgen wird auf die vorgegebenen Stückenummern eine real-time Prüfung zu den von WM gelieferten Oppositionsdaten vorgenommen. Gleichzeitig wird auch gegen den zu diesem Zeitpunkt vorhandenen Stückenummernbestand im CEU-System CARAD und aller im Auftragsstatus befindlichen Einlieferungen, eine real-time Prüfung durchgeführt. Nur nach erfolgreicher Prüfung können diese Aufträge zur Kontrolle bearbeitet werden.

Auslieferungen werden direkt auf möglichen Tresorbestand geprüft.

Die konsequente Anwendung des Vier-Augen-Prinzips bei der Online-Auftragserteilung vermeidet Erfassungsfehler und stellt ein wesentliches Kontrollinstrument für Qualität der erteilten Aufträge dar.

Für CASCADE Ein- und Auslieferung stehen zwei Kommunikationswege zur Verfügung:

- Online-Eingabe über Terminal
- Elektronischer Datenaustausch (File Transfer)

Standardisierte Datenformate nach ISO-Swift ermöglichen es dem Kunden, Auftragsdaten aus dem eigenen Inhouse-System automatisiert direkt in das CASCADE-System zu leiten bzw. von dort zu erhalten.

Leerseite

## 2 Wertpapierzulassung mit T2S

Mit der Nutzung der Abwicklungsplattform T2S erstreckt sich die Wertpapierzulassung für Papiere in Girosammelverwahrung, bei denen CEU der Issuer CSD ist, auch über diese Plattform. Nach einer Neuemission eines Wertpapiers durch den Emittenten in WM, folgt der CEU Zulassungsprozess im CEU Wertpapier Service System (WSS), wenn CEU der Issuer CSD ist. Der Zulassungsprozess beinhaltet das Aufsetzen von Wertpapieren in WSS. Im Anschluss daran werden T2S-fähige Gattungen auch in T2S aufgesetzt. Der T2S Prozess „Static Data“ für Wertpapiere erfordert:

- das Einrichten des Wertpapiers in T2S
- die Zuordnung des CSDs
- die Zulassung in verschiedene Cross-Border Links

Sobald der T2S Prozess „Static Data“ für Wertpapiere erfolgreich abgeschlossen ist, kann in T2S die Wertpapierabwicklung erfolgen.

Leerseite

## 3 eMission Service

In diesem Kapitel werden alle vorhandenen eMission-Services näher erläutert. Diese bieten den Kunden der CEU die Möglichkeit ihre Zulassungen auf elektronischem Wege einzureichen.

Voraussetzung dafür, dass CEU mit der Prüfung und dem Zulassungsprozess beginnen kann, ist die Übermittlung eines vollständigen Datenpaketes. Dieses besteht aus den Emissionsunterlagen in maschinenlesbarer elektronischer Form und den jeweils wertpapiergattungsabhängigen Unterlagen.

Da die Urkunden von CEU erzeugt werden und standardisiert sind, ist darauf zu achten, dass die Emissionsbedingungen keine Vorgaben zur Urkundengestaltung enthalten. Hier ist es zwingend notwendig, die Emissionsbedingungen auf mögliche Aspekte hin, insbesondere die Angabe zu Unterschriften auf der Urkunde, zu überprüfen. Für einen möglichen Abgleich zwischen den Emissionsbedingungen und der CEU Urkunde, kann das CEU Urkunden-Template zur Verfügung gestellt werden.

Die Details zur Übertragung der Datensätze sind in separaten Dokumenten, den sogenannten Formatspezifikationen, definiert. Für die Services Trades Only und Security Box ist dort auch die Liste der zugelassenen Wertpapiergattungen vorhanden.

Der Standardprozess sieht vor, dass die Stammdaten aller Wertpapiergattungen nach abgeschlossener Zulassungsprüfung unverzüglich zur Freischaltung an das T2S Abwicklungssystem weitergeleitet werden. Zusätzlich wird der CASCADE-Einlieferungsauftrag erzeugt. Gleichzeitig wird von CEU die Globalurkunde erzeugt und mit den dazugehörigen Emissionsbedingungen in ausgedruckter Form zusammengeführt. Diese Unterlagen werden in den CEU-Tresor eingeliefert und es erfolgt eine entsprechende Gutschrift der Bestände auf dem CEU-Hauptkonto des Kunden.

Die Abläufe der Services Trades Only, Security Box und Datasprint weichen an bestimmten Punkten davon ab. Nähere Erläuterungen sind in den jeweiligen Kapiteln zu finden.

Zu jedem generierten und gebuchten Einlieferungs- und Begebungsauftrag erhält der Kunde ein Clearing & Settlement Statement über den von ihm gewählten Kommunikationsweg.

Sollte ein Handelsgeschäft in einem Wertpapier vor der Übermittlung der zugehörigen Emissionsunterlagen erfolgen, so wird CEU bei einer möglichen temporären technischen Ablehnung im Fall von Börsengeschäften die abgelehnten Abwicklungsaufträge am nächsten auf die jeweilige Ablehnung folgenden Geschäftstag erneut an das T2S Abwicklungssystem senden. Dies gilt nicht für außerbörslich abgeschlossene Handelsgeschäfte. Mögliche auf Grund dessen entstandene Fremdkosten trägt der Kunde.

Sofern der elektronische Zulassungsantrag vollständig und fristgerecht bei CEU eingeliefert wurde, sorgt CEU für die rechtzeitige Aufnahme in die Girosammelverwahrung, vorbehaltlich einer positiven Zulassungsprüfung.

Alle weiteren wertpapiergattungsabhängigen Details sind in den einzelnen Abschnitten aufgeführt.

### 3.1 eMission All-In

**All-In:** Elektronische Zulassung von Optionsscheinen, Zertifikaten und bestimmten Fixed Income-Produkten / Anleihen

Folgende Unterlagen sind bei diesem Service für die Zulassung notwendig:

- Allgemeine Emissionsbedingungen
- Endgültige Emissionsbedingungen
- eMission Upload Excel

Der Annahmeschluss unterscheidet je nach Wertpapiergattung:

- Fixed Income-Produkte / Anleihen:  
Handelstag -1, 13:00 Uhr
- Optionsscheine und Zertifikate:  
Handelstag -1, 15:00 Uhr

### 3.2 eMission Trades Only

**Trades Only:** Elektronische Zulassung bereits gehandelter Anleihen, Optionsscheine oder Zertifikate

Nachdem ein Wertpapier gehandelt wurde, erzeugt CEU mit unmittelbarer Wirkung für und gegen den Emittenten den Einlieferungs- und Begebungsauftrag pro emittierter Wertpapiergattung und leitet diesen an das T2S Abwicklungssystem weiter.

Die Nutzung von Trades Only ist nur für solche Wertpapiergattungen möglich, die als Anleihen, Optionsscheine oder Zertifikate eingestuft sind. Andere Wertpapiergattungen sind bei Trades Only nicht zulässig.

Gemäß den Einreichungsfristen zur Nutzung von Trades Only findet die Übermittlung der zugehörigen Emissionsunterlagen in der Regel nach einem oder mehreren bereits getätigten Handelsgeschäften statt. Die Einreichungsfrist ist am Handelstag +1 um 10:00 Uhr.

Zur Vermeidung etwaiger Fremdkosten durch abgelehnte Abwicklungsaufträge aufgrund der späten Datenbereitstellung auf dem T2S Abwicklungssystem empfiehlt CEU bei Nutzung von Trades Only, diese mit der Nutzung des eMission Data Sprint-Service zu kombinieren. Hierdurch kann die Freischaltung der Stammdaten auf T2S vor Einreichung der Emissionsunterlagen erfolgen. Näheres ist im Kapitel Data Sprint enthalten.

### 3.3 eMission Security Box

**Security Box:** Zweistufiger Prozess der elektronischen Zulassung für Anleihen, Optionsscheine oder Zertifikate

Die Nutzung der Security Box ist eingeschränkt auf das Einreichen von Wertpapiergattungen, die als Anleihen, Optionsscheine oder Zertifikate eingestuft sind. Andere Wertpapiergattungen sind in der Security Box nicht zulässig.

#### 3.3.1 Pre-Admission

Die Pre-Admission ist die erste Stufe des Security Box Prozesses. Hier wird für jede Wertpapiergattung, die am Kapitalmarkt zum Handel angeboten wird, vor Handelsbeginn die Zulassungsprüfung durchgeführt. Dieser Prozessschritt stellt zwar noch nicht die Aufnahme in der Girosammelverwahrung dar, sie gewährleistet aber die spätere Aufnahme in der Girosammelverwahrung, sofern die Wertpapiergattung gehandelt wurde.

CEU wird bereits in der „Pre-Admission“ die Emissionsbedingungen erzeugen und im CEU-Tresor hinterlegen. Es existiert jedoch noch keine Globalurkunde.

Jede Wertpapiergattung in der „Pre-Admission“ wird unverzüglich an das T2S Abwicklungssystem weitergeleitet, um die Freischaltung der Stammdaten für die betreffende ISIN zu gestatten.

Der Annahmeschluss in der Pre-Admission unterscheidet je nach Wertpapiergattung

- Anleihen:  
Handelstag -1, 13:00 Uhr
- Optionsscheine und Zertifikate:  
Handelstag -1, 15:00 Uhr

Nachdem eine Wertpapiergattung gehandelt wurde, kann diese aus der Pre-Admission in die Girosammelverwahrung überführt werden. Hierzu werden in der zweiten Stufe der Security Box zwei Optionen angeboten.

### 3.3.2 Zulassung mittels Auto Admission

CEU überwacht alle eingereichten Wertpapiergattungen des Kunden in der „Pre-Admission“ und nimmt im Falle eines Wertpapierhandels die entsprechende Gattung in die Girosammelverwahrung auf. Nun wird durch CEU die entsprechende Urkunde erstellt und zusammen mit den Emissionsbedingungen im Tresor eingelagert.

### 3.3.3 Zulassung ohne Auto Admission

Beim Service Security Box ohne Auto Admission liegt die Verantwortung und die Überwachung aller eingereichten Wertpapiergattungen beim Kunden. Wurde eine Wertpapiergattung gehandelt, muss der Kunde rechtzeitig vor der Einreichungsfrist bei CEU die Aufnahme in der Girosammelverwahrung veranlassen.

Anleihen, Optionsscheinen und Zertifikate können bis zum Handelstag +1 bis 13:00 Uhr eingereicht werden.

## 3.4 eMission Data Sprint

**Data Sprint:** Weiterleitung und Bekanntmachung von Wertpapiergattungen im T2S Abwicklungssystem

Dieser Service gilt für Anleihen, Optionsscheine und Zertifikate, welche mit dem Hinweis auf eine „beabsichtigte Girosammelverwahrung (GS)“ versehen werden können.

Jede Wertpapiergattung, die über Data Sprint an CEU übermittelt wird, wird unverzüglich an das T2S Abwicklungssystem weitergeleitet, um die Freischaltung der Stammdaten für die betreffende ISIN zu gestatten. Nach Hinterlegung der Stammdaten im T2S Abwicklungssystem werden sowohl außerbörsliche als auch börsliche (LION) Aufträge zur Verarbeitung im Einklang mit dem T2S-Lebenszyklus angenommen.

Der Kunde ist allein für die CEU zur Verfügung gestellten Daten verantwortlich. CEU ist nur verantwortlich für die Weiterleitung der Daten. Eine Plausibilitätsprüfung durch CEU findet nicht statt.

**Hinweis:** Die Nutzung von Data Sprint ersetzt nicht das eMission-Zulassungsverfahren zur Girosammelverwahrung.

## 3.5 eMission-Zulassungen

### 3.5.1 Aktien

Für die Zulassung von Aktien sind folgende Zulassungsdokumente erforderlich:

- Satzung des Emittenten
- Gesellschaftsbeschlüsse zur Ausgabe von Aktien
- Ggf. Zahlstellenerklärung
- Aktueller HR-Auszug (max. ein Monat alt)
- Ggf. Börsenbeschlüsse für Aufnahme Regulierter Markt

Für Namensaktien ist als zusätzliches Dokument der CASCADE-RS Eintragungsauftrag erforderlich, welcher durch das emissionsbegleitende Institut erstellt wird.

Der Annahmeschluss unterscheidet je nach Wertpapiergattung

- Inhaberaktien:  
Handelstag -2, 14:00 Uhr
- Namensaktien:  
Handelstag -3, 14:00 Uhr

**Hinweis:** Der Service ist derzeit nur für Aktien unter deutschem Recht verfügbar.

### 3.5.2 Investmentfonds

Für die Zulassung von Fonds sind folgende Zulassungsdokumente erforderlich:

- Aktuelle „Allgemeine Anlagebedingungen“ (AAB) in finaler Form
- „Besondere Anlagebedingungen“ (BAB) in finaler Form
- Ggf. Zahlstellenerklärung
- Kopie der Genehmigung der zuständigen Aufsichtsbehörde (BaFin)

Für Spezial-Fonds ist als zusätzliches Dokument der Rahmenvertrag der Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG) mit CEU (einmalig) erforderlich.

Im Falle von Namenspapieren wird CEU ein Blankoindossament im Namen des emissionsbegleitenden Instituts anbringen, damit die Wertpapiere girosammelverwahrfähig werden.

Für alle Fondsarten ist der Annahmeschluss am Handelstag -3 um 14:00 Uhr.

#### 3.5.2.1 Pfandbriefe

Für die Zulassung von Pfandbriefen sind folgende Zulassungsdokumente erforderlich:

- Allgemeine Emissionsbedingungen
- eMission Upload Excel
- Bestätigung vom Treuhänder über den Deckungsbetrag

Die Treuhänderbestätigung wird ebenfalls über das eMission-Portal eingereicht. Hierfür erhält der Treuhänder von der Pfandbriefbank einen Zugang mit eigener Nutzerkennung zum eMission-Portal. Bei der Anmeldung gilt es zu beachten, dass der Treuhänder die Kontonummer des Instituts einträgt, für welches er agiert und wodurch eine eindeutige Zuordnung entsteht.

Somit reicht das emissionsbegleitende Institut den Zulassungsantrag mit den allgemeinen Bedingungen bei CEU ein und der Treuhänder bestätigt in einem vom Treuhänder unterschriebenen Formular den Deckungsbestand gegenüber CEU.

Das Formular für die Treuhänderbestätigung kann bei CEU angefordert werden.

Erst nachdem alle erforderlichen Unterlagen durch das emissionsbegleitende Institut (Emissionsbedingungen, Upload Excel) und durch den Treuhänder (Formular zum Deckungsbestand) eingereicht wurden, wird CEU die Zulassungsprüfung durchführen.

CEU erzeugt die Globalurkunde und unterschreibt diese in Vollmacht des Emittenten. Als Anlage zur Globalurkunde druckt CEU das durch den Treuhänder unterschriebene Formular zum Deckungsbestand aus.

Die Globalurkunde, das vom Treuhänder unterschriebene Formular zum Deckungsbestand und die endgültigen Bedingungen werden im Tresor hinterlegt.

Der Annahmeschluss liegt bei Pfandbriefen am Handelstag -1 um 13:00 Uhr.

### 3.5.3 Landesschatzanweisungen

Für die Zulassung von Landesschatzanweisungen sind folgende Dokumente erforderlich:

- Auszug aus dem Landesschuldenbuch
- Bedingungen
- eMission Excel Upload - LSA

Der Annahmeschluss liegt bei Landesschatzanweisungen am Handelstag -1 um 13:00 Uhr.

**Hinweis:** Der Auszug aus dem Landesschuldenbuch muss spätestens am Valutatag vorliegen.

Leerseite

## 4 Kontakte

### 4.1 Ansprechpartner

---

Weitere Informationen erhalten Sie von Clearstream Client Services oder Ihrem Relationship Officer.

Leerseite

## 5 Anmeldung zu den Online-Serviceleistungen

Die Einrichtung einer Dialogverbindung erfordert folgende Maßnahmen:

- Der Kunde der Clearstream Europe AG (CEU) fordert einen Systemfragebogen von der Kundenbetreuung der CEU an. Dieser ist ausgefüllt an die vorgegebene Adresse zurückzusenden.
- Vom Kunden sind die gewünschten Anwendungen bei der CEU zu beantragen, d. h. aufgrund der Dialogverbindung besteht (nach Bedarf) die Möglichkeit einer universellen Nutzung aller Anwendungen (CASCADE, WSS).
- Die Betriebssicherheit IT der Gruppe Deutsche Börse wird davon in Kenntnis gesetzt und der Haupt-Security-Beauftragte sendet dem Kunden den Antrag „Berechtigung zur Nutzung von Anwendungen der Gruppe Deutsche Börse“.

Leerseite

## 6 Das Zugriffsschutz-System

Mit Einführung der Datenbanksoftware „IMS“, die auch Basis für CASCADE ist, wurde gleichzeitig ein Security-System installiert, das einen weitestgehenden Schutz der IMS-Online-Anwendungen vor Missbrauch ermöglicht.

Voraussetzung für das Security-System ist eine Security-Datenbank (Benutzer-Datenbank), in der jeder Benutzer mit seinem eindeutigen Identifizierungs-Kennzeichen (ID-KZ) und Passwort sowie seinen Transaktionsberechtigungen gespeichert ist. Diese Transaktionsberechtigungen werden von dem Kunden-Security-Beauftragten den verschiedenen Mitarbeitern zugeordnet.

In jeder Bank müssen zwei Security-Beauftragte benannt sein, die sich in ihren Aufgabenbereichen folgendermaßen unterscheiden:

- Der Bank Security-Beauftragte zur Pflege  
Aufgaben: Pflegen der Berechtigungsdaten in der Security-Datenbank, d. h. Funktionscodeberechtigungen können erfasst, geändert, gelöscht sowie angezeigt werden.
- Der Bank Security-Beauftragte zur Freigabe  
Aufgaben: Kontrolle und Freigabe der Anwendungsberechtigungen, die der Kunden-Security Beauftragte zur Pflege vergeben hat.

Im Folgenden wird der Aufbau des Mitarbeiter-Security-Daten-Formulars erläutert, das Sie von Ihrem „Security-Beauftragten“ erhalten haben. Hier wird Ihnen mitgeteilt, für welche Transaktionen und Funktionen von CASCADE (oder von anderen IMS-Anwendungen der Gruppe Deutsche Börse) Ihnen eine Zugriffsberechtigung zugewiesen worden ist.

Im oberen Teil des Formulars wird neben dem User-Identifizierungskennzeichen, dem Namen und Vornamen der zugriffsberechtigten Person auch das Ersterfassungs-Passwort angegeben. Dieses Passwort wird beim Ersteinstieg in das System vom User im Online-Passwortänderungsdienst in ein eigenes Passwort umgeändert. Außerdem wird der Status „Ersterfassung“, „Änderung“ oder „Löschung“ aufgeführt.

Im unteren Teil des Formulars können drei Transaktionscodes zugeteilt werden.

Für weitere Transaktionscodes müssen zusätzliche Blätter ausgefüllt werden. Insgesamt stehen pro Transaktionscode 100 Stellen zur Verfügung:

- Stelle 1-4: 4-stelliger Transaktionscode
- Stelle 9-10: Hier kann angegeben werden, ob der Mitarbeiter für einen Funktionscode zugelassen ist („=" --> positiv Steuerung) oder nicht („/=“ bzw. „=/“ --> negativ Steuerung)
- Stelle 11-12: Leer
- Stelle 13: Angabe des Tresors (CEU-intern)
- Stelle 14-100: Angabe von zweistelligen Funktionscodes zu einem Transaktionscode, die durch eine Leerstelle voneinander getrennt sein müssen.

### Beispiele:

Für den Transaktionscode „KVEC“ existieren folgende Funktionscodes:

- „VA“
- „VN“
- „VP“
- „VL“
- „VG“

- „TA“
- „TN“
- „TP“
- „TL“
- „TG“

1. Der Anwender soll beim Transaktionscode „KVEC“ die Zugriffsberechtigung für die Funktionscodes „VA“, „VN“, „VP“, „VL“ und „VG“ erhalten.

```

      1                2
1 2 3 4 9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9
K V E C =      V A  V N  V P  V L  V G
    
```

Abbildung 6.1 Zugriffsberechtigung Funktionscodes (1/3)

2. Der Anwender erhält beim Transaktionscode „KVEC“ die Zugriffsberechtigung für alle Funktionscodes außer „VA“ und „VP“.

```

      1                2
1 2 3 4 9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9
K V E C / =    V A  V P
    
```

Abbildung 6.2 Zugriffsberechtigung Funktionscodes (2/3)

3. Der Anwender erhält beim Transaktionscode „KVEC“ die Zugriffsberechtigung für alle Funktionscodes.

```

      1                2
1 2 3 4 9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9
K V E C *
    
```

Abbildung 6.3 Zugriffsberechtigung Funktionscodes (3/3)

\* Keine Eingaben

## 7 Online-Passwortänderung

Mit Hilfe dieser Funktion kann die Änderung eines Passwortes durchgeführt werden:

Transaktionscode „MENU“ (1. Zeile) durch „PWAD“ überschreiben.

Als Ergebnis erscheint das Passwortänderungs-Menü:

```
TRAN: PWAD FC:      SB:
----- P A S S W O R T - A E N D E R U N G -----

IDENTIFIZIERUNGS-KZ      :
ALTES PASSWORT           :
NEUES PASSWORT           :
WIEDERHOLUNG NEUES PASSWORT:

PFK1: HELP FUNKTION   PFK4: VORGANGSABBRUCH
-- ID-KZ: 7930200001 -- PW:          ----- B793042V -- 19/11/01 -- 10:47:32 --****
SY0010R BITTE GEBEN SIE IDENTIFIZIERUNGS-KZ, ALTES UND NEUES PASSWORT EIN
```

Abbildung 7.1 Passwortänderung

\*\*\*\* Nur Musterdaten

### Folgende Eingaben sind notwendig:

- Identifizierungskennzeichen
- Altes Passwort
- Neues Passwort
- Wiederholung des neuen Passwortes

**Hinweis:** Ein Passwort muss 8-stellig sein und kann aus den Zeichen „A“ bis „Z“ bzw. „0“ bis „9“ bestehen.

Werden die Daten korrekt eingegeben, wird die Passwortänderung durch eine Bildschirm-Meldung bestätigt.

Grundsätzlich kann eine Passwortänderung zu jedem Zeitpunkt vorgenommen werden. Darüber hinaus wird in folgenden Fällen automatisch der Passwortänderungsdienst aufgerufen:

Zur Änderung des Ersterfassungs-Passwortes

- muss das vom Bank-Security-Beauftragten erhaltene Erst-Passwort vor Nutzung des Systems geändert werden.

Bei Ablauf des Passwort-Gültigkeitszeitraumes

- Der Gültigkeitszeitraum eines Passwortes beträgt drei Monate, d. h. im Abstand von drei Monaten muss das Passwort geändert werden.

Durch Drücken der PF4-Taste kann der Passwortänderungsdienst abgebrochen werden.

Informationen zur Passwortänderung können durch Betätigen der PF1-Taste abgerufen werden.

## 8 Allgemeingültige Feldeingaberegeln

### (A) Allgemeine Eingabeformen

Falls eine Eingabe nicht die maximale Anzahl von Stellen umfasst, die für dieses Feld vom Programm zugelassen ist, kann die Eingabe wahlweise linksbündig, rechtsbündig oder in der Mitte des Feldes erfolgen. Jede Eingabeform wird vom Programm verarbeitungsgerecht aufbereitet (numerische Felder = rechtsbündig, alphanumerische Felder = linksbündig).

### (B) Numerische Eingaben

Die Eingabe führender Nullen bei den Vorkommastellen und abschließender Nullen bei den Nachkommastellen ist möglich, aber nicht erforderlich. Die Eingabe des Kommas ist nur erforderlich, wenn Nachkommastellen eingegeben werden. Bei der Eingabe von Nachkommastellen ist die Eingabe mindestens einer Stelle vor dem Komma erforderlich, ggf. einer „0“.

Beispiel:

|      |         |
|------|---------|
| 0,11 | richtig |
| ,11  | falsch  |

### (C) Datumseingaben

Folgende Datumseingaben werden akzeptiert:

|             |            |
|-------------|------------|
| TTMM:       | 2011       |
| TT.MM:      | 20.11      |
| TTMMJJ:     | 201102     |
| TT.M.JJ:    | 20.11.02   |
| TT.MM.JJ:   | 20.11.02   |
| TTMMJJJJ:   | 20112002   |
| TT.MM.JJJJ: | 20.11.2002 |

Von der Anwendung wird das eingegebene Datum in der Form „TT.MM.JJJJ“ aufbereitet.

### (D) Änderung eines Feldinhaltes

Die Änderung eines angezeigten Feldinhaltes ist durch Überschreiben möglich. Nicht überschriebene Stellen der Anzeige müssen gelöscht werden.

### (E) Löschung eines Feldinhaltes

Zur Löschung eines angezeigten Feldinhaltes existieren folgende Möglichkeiten:

- Den Cursor an der ersten Stelle des Feldes positionieren und die Taste „ENDE“ („END“) betätigen (Löschung des gesamten Feldes).
- Den Cursor an der ersten Stelle des Feldes positionieren und die Taste „ENTF“ („DEL“) betätigen (Löschung Zeichen für Zeichen).

### (F) Anzeige Fehlermeldungen

Bei fehlerhaften Feldeingaben werden in der Zeile 24 auf Ihrem Bildschirm Fehlermeldungen angezeigt.

Leerseite

## 9 Tastenbelegung

| Taste                    | Erklärung  |
|--------------------------|--|
| ENTER bzw. Datenfreigabe | (1) Auswahlmenümasken:<br>Prüfung der Eingaben; sind die Eingaben korrekt, wird in die nächste Ebene verzweigt.<br>Erfassungsmaske:<br>Prüfung der Eingaben<br>Tabellarische Anzeigemasken:<br>Prüfung der Eingaben. Mit der Eingabe im Feld KZ = „I“ und ENTER wird in die Vollanzeige des gekennzeichneten Auftrages verzweigt.  |
| Tabulatortaste           | Vor-/Rückwärtsspringen auf das nächste eingabefähige Feld.   |
| PF1                      | Führt in verschiedenen Transaktionen zur Anzeige einer Hilfemaske.   |
| PF2                      | Führt zu einem Online Druck aus der Informationsvollanzeige heraus. Weiterhin kann im Rahmen der tabellarischen Kurzanzeige der Transaktion KVAI ein Online Druck mit PF2 und durch Kennzeichnung mit „D“ in der KZ Spalte vorgenommen werden. Wird die Kennzeichnung mit „S“ eingegeben kann ein Einlieferungsbeleg Online ausgedruckt werden. Zusätzlich kann aus der tabellarischen Anzeige der Transaktion „KVAV“ ein Online-Druck aktiviert werden. (Voraussetzung für den Ausdruck ist eine leitungsbezogene Bildschirmzuordnung zum Drucker). |
| PF3                      | Führt zu einer Verarbeitung der eingegebenen Daten (= Eingabebestätigung).   |
| PF4                      | Mit PF4 wird ein Dialog ohne Verarbeitung abgebrochen. Anschließend wird das jeweilige Auswahlmenü angezeigt.  |
| PF5                      | Nur bei tabellarischen Anzeigen, wenn aufgrund einer Zeitüberschreitung die Datenbanksuche abgebrochen werden musste; PF5 initiiert somit ein Weitersuchen nach Aufträgen in der Datenbank.  |
| PF6                      | Führt zu einer Verarbeitung der eingegebenen Daten und blättert gleichzeitig innerhalb eines Vorganges bei bestimmten CASCADE-Auftragsarten vor.   |
| PF7                      | Ermöglicht ein Zurückblättern zur vorangegangenen Maske innerhalb eines Vorganges.<br>Voraussetzung ist jedoch, dass innerhalb eines Maskentyps Folgemasken existieren.<br>Infolgedessen funktioniert PF7 erst dann, wenn zuvor mit PF8 vorwärts geblättert werden konnte.   |
| PF8                      | Ermöglicht ein Vorwärtsblättern zur Folgemaske innerhalb eines Vorganges (Voraussetzungen siehe PF7).  |
| PF9                      | Nicht belegt.  |
| PF10                     | Nicht belegt.  |
| PF11                     | Wie bei PF4 erfolgt ein Abbruch des Dialogs ohne Verarbeitung; bewirkt zusätzlich die Abmeldung vom System CASCADE und den Rücksprung in das Gruppe Deutsche Börse-Einstiegsmenü.  |
| PF12                     | Nicht belegt.  |

Leerseite

## 10 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

| Feld auf der Maske         | Bedeutung                                       | Formal korrekt               | Eingabe      | Erklärung   |
|----------------------------|---|------------------------------|--------------|---|
| AA<br>AUFTRAGSART          | Auftragsart                                     | 2-stellig<br>numerisch       | <sup>a</sup> | Numerisches Kennzeichen für eine Auftragsart<br><br>Folgende Ausprägungen stehen für den effektiven Wertpapierbereich zur Verfügung: <ul style="list-style-type: none"> <li>• 16 = Einlieferung</li> <li>• 18 = Auslieferung</li> </ul>   |
| ABWEICHENDE<br>BEZEICHNUNG | Abweichende<br>Bezeichnung                      | 3-stellig<br>numerisch       | muss         | Existieren zu einer Stückelung gleiche Stücknummern, z. B. aufgrund einer Fusion, muss zur weiteren Identifizierung diese Angabe eingetragen werden. Die Eingabe erfolgt über einen Schlüssel. Das Feld wird immer mit 0 (keine abweichende Gattungsbezeichnung) vorbelegt.<br><br>Andere Ausprägungen können bei CEU erfragt werden. |
| ABW.<br>VERSANDADRESSE     | Abweichende<br>Versandadresse                   | 1-stellig<br>alphanumerisch  | muss         | Folgemaske wird aufgerufen, wenn an Dritte ausgeliefert werden soll.<br><br>Vorbelegung; „N“ = Nein   |
| ADRESSE                    | Adresse   | 70-stellig<br>alphanumerisch | kann         | Bei Aufträgen zu Einlieferungen wird hier die Adresse von Dritten (z. B. Drittbank) eingegeben, für die der Kunde der CEU einliefert.   |
| AKTIONÄRSNUMMER            | Aktionärs-Nummer                                | 10-stellig<br>alphanumerisch | muss         | Hier wird die Aktionärsnummer bei Namensaktien eingegeben, die physisch auf der Zession steht. Bei fehlender Aktionärsnummer muss der Eingabe außerhalb des Systems über den Emittenten die Information anfordern.  |
| AN ADRESS-NR               | Interne Nummer<br>zur Versandadresse<br>der CEU | numerisch                    | kann         | Versand der Urkunden erfolgt an eine Drittbank (Vereinbarung mit der CEU notwendig)   |
| ANZ-STKE                   | Anzahl Stücke                                   | 9-stellig<br>numerisch       | keine        | Anzahl Urkunden pro Stückelung  |
| ANZ-URKUNDEN               | Anzahl Urkunden                                 | 9-stellig<br>numerisch       | keine        | Anzahl Urkunden pro Stückelung  |

| Feld auf der Maske                      | Bedeutung                     | Formal korrekt  | Eingabe      | Erklärung   |
|---|-------------------------------|---|--------------|---|
| AUFTRNR<br>AUFTRAGSNR<br>AUFTNR<br>A-NR | Auftragsnummer                | 1-7-stellig<br>numerisch  | muss         | Eindeutigkeit je Eingabe muss systemseitig vorliegen. Von den Systemnutzern kann eine 7-stellige Nummer zwischen 1 und 6999999 frei vergeben werden.<br><br>WP-Überträge, die automatisch in CASCADE erzeugt wurden, erhalten vom System eine eigene Nummer zwischen 9500000 und 9999999 zugewiesen.<br><br>Automatisch generierte Aufträge aus Umlegungen und Stornos erhalten Auftragsnummern zwischen 8000000 und 9499999. |
| AUFTRAGSNR                              | Auftragsnummer                | 11-stellig<br>numerisch<br>(teilweise)                              | <sup>a</sup> | Umsatzanzeige:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>• Stellen 1-4: Eingabe</li> <li>• Stellen 5-11: Auftragsnummer</li> </ul>  |
| AUSG-NR                                 | Ausgangsbuch-<br>Nummer       | 6-stellig numerisch   | keine        | Interne fortlaufende CEU-<br>Nummer.<br><br>Wird bei der ersten Überleitung zur Disposition/Buchung eines Auslieferungsauftrages technisch vergeben.  |
| AUSLIEFERUNG<br>RU                      | Auslieferung<br>Rahmenurkunde | 1-stellig<br>alphanumerisch<br><br>J oder N                         | muss         | Auslieferung einer<br>Rahmenurkunde<br><br>Mögliche Eingaben:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>• „J“ = Ja</li> <li>• „N“ = Nein</li> </ul> Vorbelegung: „N“  |
| AUSLIEF-VERF                            | Auslieferungs-<br>Verfahren   | 1-stellig numerisch,<br>Textanzeige<br>15-stellig<br>alphanumerisch | muss         | Folgende Auslieferungsverfahren können die Kunden mit CEU vereinbaren:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>• 1 = per Bankbote</li> <li>• 2 = per Container</li> <li>• 3 = per Wertpost</li> <li>• 4 = DHL</li> <li>• 5 = Brinks Wertransport</li> <li>• 6 = Auslieferung w/KADI</li> <li>• 7 = Vernichtung</li> </ul>   |
| AUSLIEF-VORG                            | Auslieferungs-<br>vorgang     | 1-stellig numerisch   | muss         | Mögliche Eingaben:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>• 1 = Auslieferung</li> <li>• 2 = Revalutierung</li> <li>• 3 = Teilreduzierung</li> <li>• 5 = Revalutierung mit Reduzierung der Rahmennominale</li> </ul> Vorbelegung:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>• 1 = Auslieferung</li> </ul>   |
| BANK                                    | Siehe Last-/Gut-<br>Bank      |   |              |   |

## Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

| Feld auf der Maske         | Bedeutung                          | Formal korrekt               | Eingabe                     | Erklärung  |
|----------------------------|------------------------------------|------------------------------|-----------------------------|--|
| BANK-NUMMER                | Bank-Nummer                        | 4-stellig numerisch          | muss                        | Ortskennzeichen und Hauptkontonummer   |
| BEARB-STATUS               | Bearbeitungsstatus<br>Einlieferung | 3-stellig numerisch          | keine                       | Hier wird mit einem Kennzeichen der aktuelle Bearbeitungsstatus der Einlieferung bei der CEU ausgewiesen.<br><br>(Siehe Anhang 2: Tabellen (Schlüsselverzeichnisse) <u>"BEARBEITUNGSSTATUS EINLIEFERUNG"</u> )   |
| BEARB-STATUS               | Bearbeitungsstatus<br>Auslieferung | 3-stellig numerisch          | keine                       | Hier wird mit einem Kennzeichen der aktuelle Erfassungsstand der Bank und nach Kontrolle durch die Bank der Bearbeitungsstand der Auslieferung bei der CEU ausgewiesen.<br><br>(Siehe Anhang 2: Tabellen (Schlüsselverzeichnisse) <u>"BEARBEITUNGSSTATUS AUSLIEFERUNG"</u> ) |
| BEGIN-DATUM-KE<br>DATUM-KE | Ex-Tag oder<br>Ausübungs-datum     | TT.MM.JJJJ                   | muss bei<br>RS              | Bei Valutierung eines Options Scheins:<br><br>• BEGIN-DATUM-KE = Start Optionsfrist und DATUM-KE = tatsächlicher Ausübungstag  |
| BESONDERHEIT               | Besonderheit                       | 3-stellig numerisch          |                             | Diese Eingabe wird erforderlich bei einer abweichenden internen Verwahrmöglichkeit zur WKN/ISIN (siehe Anhang 2 - Schlüsselverzeichnis „Besonderheiten“).  |
| BIC-CODE                   | BIC-Code                           | 11-stellig<br>alphanumerisch | kann                        | BIC-Code-Angabe dient zur automatischen Ermittlung der Adressinformationen (noch nicht aktiv).   |
| BUCHUNGS-NOMINALE          | Buchungs-<br>Nominale              | 10,3-stellig<br>numerisch    | kann,<br>Zusatz-<br>auswahl | Nominalbetrag aus Auftrag  |
| BUCHUNGSVALUTA<br>BUCH-VAL | Buchungs-Valuta                    | 10-stellig<br>alphanumerisch | kann,<br>Zusatz-<br>auswahl | Datum, zu dem der Auftrag gebucht wurde  |
| DEPOTBUCH-BESTAND          | Depotbuch-<br>Bestand              | 15,3-stellig<br>numerisch    | keine                       | Depotbestand pro WKN/ISIN und KONTO (mit Mitbesitzübergang)  |
| EING-NR                    | Eingangsbuch-<br>Nummer            | 7-stellig numerisch          | keine                       | Interne fortlaufende Nummer für das Eingangsbuch der CEU (jährliche bei Eins beginnende Perforationsnummer). Die Nummer wird je Einlieferungsposten bei der Annahme der Einlieferung automatisch durch das System vergeben.  |
| EINHEIT<br>EINH            | Einheit                            | 2-stellig                    | keine                       | Depotwährung (z. B. „ST“, „DEM“, „EUR“ alphanumerisch)   |

| Feld auf der Maske    | Bedeutung                      | Formal korrekt            | Eingabe     | Erklärung  |
|-----------------------|--------------------------------|---------------------------|-------------|--|
| EINLIEF-ART           | Einlieferungs-Art              | 1-stellig numerisch       | muss (DFÜ)  | Spezifiziert die jeweilige laufende Einlieferung. Derzeit stehen zur Verfügung: <ul style="list-style-type: none"> <li>• 1 =Einlieferung</li> <li>• 2 = Neuzulassung Globalurkunde</li> <li>• 3 = Neuzulassung Rahmenurkunde</li> <li>• 4 = Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde</li> <li>• 5 = Valutierung</li> </ul>  |
| EINLIEFERUNG VON NAME | Einlieferung von Name          | 35-stellig alphanumerisch | kann        | Beinhaltet den Namen von Dritten (Banken, Filialen, etc.), die nicht Kontoinhaber bei der CEU sind und deshalb über einen anderen Kunden eine Einlieferung an die CEU tätigen.<br><br>Beispielsweise eine Sparkasse, die mit USER-ID einer Landesbank arbeiten darf. Handelt es sich um internationale Clearingpartner, wird die zugehörige Kurzbezeichnung automatisch hinzugefügt  |
| EINLIEF-GRUND         | Einlieferungsgrund             | 3-stellig numerisch       | muss        | Kennzeichnet den jeweiligen Einlieferungsgrund bei Neuzulassung und Valutierung. Derzeit stehen zur Verfügung: <ul style="list-style-type: none"> <li>• 001 = aus Emission</li> <li>• 002 = Barbezug – unbedingte Kapitalerhöhung (KE)</li> <li>• 003 = Kapitalerhöhung bedingt – Optionsscheinausübung</li> <li>• 004 = Rahmenurkunden Ersteinlieferung RS</li> <li>• 005 = Urkundenumtausch</li> <li>• 007 = Gratisaktien</li> <li>• 008 = Sperre, Revaluierung möglich</li> </ul> |
| ERFASSER              | Erfasser                       | 4-stellig numerisch       | muss        | Über das Feld wird festgelegt, wer die Listanforderung bearbeitet. Das Feld wird vorbelegt mit den ersten vier Stellen des ID-Kennzeichens   |
| E<br>E/O              | Ersatzurkunde                  | 1-stellig alphanumerisch  | kann        | Kennzeichnet eine Stücknummer als Ersatzurkunde (E)  |
| EX-TAG/BEGIN          | Ex-Tag Beginn Options-ausübung |                           | muss bei RS | Neuzulassung/Valutierung bei Namensaktien aus Kapitalmaßnahmen   |
| FC                    | Funktions-Code                 | 2-stellig                 | muss        | Auswahl einer Funktion   |
| GES-NOM               | Gesamtnominale                 | 10,3-stellig numerisch    | keine       | Ergibt sich aus der Summe der Stückelung mal den Anzahl Stücke je Stückelung und entspricht der einzuliefernden Nominale   |

## Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

| Feld auf der Maske            | Bedeutung  | Formal korrekt                | Eingabe | Erklärung   |
|-------------------------------|--|-------------------------------|---------|---|
| GRUNDEINHEIT                  | Grundeinheit der WKN/ISIN                          | 9,7-stellig numerisch         | keine   | Wird automatisch vom System über den „Nennwert zum Stück“ zugesteuert   |
| GUT-BANK<br>Einlieferung      | Gutschrift-Bank                                    | 4-stellig numerisch           | muss    | Bank-Nummer des Kunden bei CEU (= Habenkonto)   |
| GUT-KTO<br>Auslieferung       | Gutschrift-Konto                                   | 7-stellig numerisch           |         | CEU interne Kontonummer für die Tresorbestandsführung<br>Vorbelegung bei Eingabe, keine Änderung durch Kunden möglich   |
| GUT-KTO<br>Einlieferung       | Gutschrift-Konto                                   | 7-stellig numerisch           | muss    | Dieses Feld beinhaltet bei einer Einlieferung die Kontonummer des Kreditinstitutes, dem der Umsatz gutgeschrieben werden soll. Der Inhalt wird mit der User-ID und der Hauptkontonummer vorbelegt.  |
| HINWEISTEXT                   | Hinweistext  | 420-stellig, alphanumerisch   | keine   | Internes CEU Feld.<br>Anzeige aus CEU Adressendatenbank (KUSTA) für Effekten-Ausgang.   |
| HINWEISTEXT<br>(Auslieferung) | Hinweise   | 5 x 35-stellig alphanumerisch | kann    | Der Auftraggeber kann hier allgemeine Hinweise zur dieser Auslieferung eintragen.   |
| HLG                           | Hinterlegungsart CEU                               | 2-stellig numerisch           | muss    | Mögliche Hinterlegungsarten: <ul style="list-style-type: none"> <li>• 01 = Girosammelverwahrung</li> <li>• 03 = GS Vorratslager-Bank</li> <li>• 10 = Haussammelverwahrung</li> <li>• 20 = Lagerstelle</li> <li>• 22 = Treuhand CEU</li> <li>• 30 = Fremdtresor</li> <li>• 40 = Edelmetall</li> <li>• 41 = Edelmetall SD</li> <li>• 92 = Dokumentenverwaltung</li> <li>• 99 = GS vorgesehen (für RS vor dem GS-Stichtag)</li> </ul> Vorbelegung: <ul style="list-style-type: none"> <li>• 01 = Girosammelverwahrung</li> </ul> |
| ID AENDERUNG<br>ID-LOESCHUNG  | Identifizierungszeichen zur Änderung bzw. Löschung | 10-stellig numerisch          | keine   | User-ID des Benutzers, der einen Auftrag zur Änderung bzw. zur Löschung markiert hat.   |
| KE-TYP                        | Kapitalerhöhungstyp                                |                               |         | Sammelbezeichnung für die Eingabefelder WKN DES RECHTS und EXTAG/BEGINN bei Neuzulassungen/Aufstockung und zusätzlich DATUM-KE bei Valutierung von Kapitalerhöhungsmaßnahmen in Namensaktien (RS)   |
| KONTO                         | Konto (Vorgang ab)                                 | 7-stellig numerisch           | muss    | Siehe LAST-/GUT-KTO   |

| Feld auf der Maske                                 | Bedeutung   | Formal korrekt  | Eingabe      | Erklärung  |
|--|---|---|--------------|--|
| KONTROLL-KENNZEICHEN                               | Kontroll-Kennzeichen  | 1-stellig<br>alphanumerisch   | muss         | Dieses Feld ist in der Funktion „Kontrolle“ zu füllen. Die verschiedenen eingebbaren Kennzeichen finden Sie im Kapitel <a href="#">Kontrolle (EC) auf Seite 19-1.</a>  |
| KUNDENREFERENZ                                     | Kundenreferenz  | 3-stellig<br>alphanumerisch,<br>11-stellig<br>alphanumerisch,<br>3-stellig<br>alphanumerisch,<br>13-stellig<br>alphanumerisch,<br>2-stellig<br>numerisch, | <sup>a</sup> | In diesen Feld können Informationen zum Auftraggeber spezifiziert werden. Bei Einlieferung von RS identifiziert die Kundenreferenz Institut und Depotnummer für Übernahme in den Hauptbestand.                                       |
| KZ   | Kennzeichen-spalte  | 1-stellig<br>alphanumerisch   | kann         | Zu den verschiedenen eingebbaren Kennzeichen siehe die Vorgänge in den einzelnen Kapiteln.   |
| KZ-BST   | Kennzeichen Bestand   | 2-stellig<br>alphanumerisch   | <sup>a</sup> | In diesem Feld wird für die Einlieferung von Namensaktien (RS) die Bestandsart, in die die Einlieferungen gebucht werden sollen, benannt.<br>FM = Freier Meldebestand<br>HB = Hauptbestand<br>Vorbelegung:<br>• „HB“ = Hauptbestand' |
| L/G  | Lastschrift/<br>Gutschrift                                      | L/G   | keine        | Anzeige eines Last- oder Gutschriftauftrages   |
| LAND/PLZ/ORT                                       | Land  | 3-stellig<br>alphanumerisch,  | kann         | Adresse des Empfängers (manuelle Eingabe)  |
|  | Postleitzahl  | 5-stellig<br>alphanumerisch,  | kann         |  |
|  | Ort   | 30-stellig<br>alphanumerisch  | kann         |  |
| LAND/PLZ/ORT                                       | Land  | 3-stellig<br>alphanumerisch,  | keine        | Internes CEU Feld<br>Adresse des Empfängers aus CEU Adressendatenbank (KUSTA) für Effekten-Ausgang   |
|  | Postleitzahl  | 5-stellig<br>alphanumerisch,  |              |  |
|  | Ort   | 30-stellig<br>alphanumerisch  |              |  |
| LAND/PLZ/ORT<br>POSTFACH<br>STRASSE (Auslieferung) | Strasse<br>Postfach<br>Länderkennzeichen<br>Postleitzahl<br>Ort | Alphanum.   | kann         | Angaben zur drittbegünstigten Bank für den Empfänger der Stücke  |
| LAST-BANK  | Lastschrift-Bank  | 4-stellig numerisch   | <sup>a</sup> | Banknummer des Auftraggebers bei CEU (= Sollkonto)   |
| LAST-BANK  | Lastschrift-Bank  | 4-stellig numerisch   | muss         | Dieses Feld beinhaltet die Kontostamnummer der Bank, der bestimmte Vorgänge zugeordnet werden.   |

## Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

| Feld auf der Maske                      | Bedeutung                                       | Formal korrekt  | Eingabe | Erklärung   |
|---|---|---|---------|---|
| LAST-KONTO<br>Auslieferung              | Last-Konto                                      | 7-stellig numerisch   | muss    | Kundenkonto-Vorbelegung durch User-ID des Eingabers   |
| LAST-KONTO<br>Einlieferung              | Lastschrift-Konto                               | 7-stellig numerisch   |         | Internes CEU-Feld. Der Inhalt wird vorbelegt und kann nur von CEU geändert werden.  |
| LETZTE AEND AM                          | letzte Änderung am                              | 10-stellig alphanumerisch   | keine   | Datum der letzten Änderung  |
| LETZTE AEND                             | Letzte Änderung von                             | 10-stellig numerisch  | keine   | USER-ID des Anwenders, welcher den Auftrag zuletzt bearbeitet hat   |
| LETZTER KUPON                           | Letzter Kupon                                   | 10-stellig TT.MM.JJ<br>oder 3-stellig alphanumerisch                          | keine   | Sammelbezeichnung für den letzten zu einem Wertpapier gehörenden Ertrags-, Dividenden- oder Zinsschein bzw. Talon   |
| LETZTER LEG. SCHEIN/<br>OPTIONS-SCHEINE | Letzter Legitimations-schein/<br>Optionsscheine | 2-stellig alphanumerisch  | keine   | Sammelbezeichnung für den letzten zu einem Wertpapier gehörenden Ertrags-, Dividenden- oder Zinsschein bzw. Talon.  |
| MANGEL<br>MAN<br>M                      | Mangel  | 3-stellig numerisch<br>1. Stelle Tresor M/B/U<br>2. Stelle Mangelausprägung A | kann    | Spezifiziert den Mangel eines Wertpapiers und benennt Oppositionsgründe. Bei Ersteinlieferungen für Namensaktien werden hier auch Abweichungen in den Daten Aktionärsnummer/<br>Stücknummer zum Aktienbuch des Emittenten ausgewiesen. Schlüssel Tabellen für die verschiedenen Mängel (Schlüssel ab 50) und Oppositionsgründe (Schlüssel 0 bis 49) siehe Anhang <a href="#">Mangel auf Seite 28-7</a> .  |
| NACHWEISART                             | Nachweisart                                     | 2-stellig numerisch   | muss    | Kennzeichen, wie die zum Einlieferungsauftrag gehörenden Urkunden bei der CEU eingereicht werden.<br><br>Folgende Ausprägungen sind möglich: <ul style="list-style-type: none"> <li>• 01 = Einlieferung effektiver Urkunden</li> <li>• 02 = Urkunden liegen bereits vor</li> <li>• 03 = Urkunden von Druckerei</li> <li>• 04 = Einlieferung ohne Urkunden (mit Rahmenvertrag) (nur für Namensaktien-RS)</li> <li>• 05 = Einlieferung mit Urkunden (nur für RS)</li> <li>• 06 = Um-/Festschreibung</li> <li>• 07 = Zession fehlt</li> <li>• 08 = Einlieferung aus eMission</li> <li>• 09 = Edelmetall</li> </ul> |

| Feld auf der Maske                                    | Bedeutung  | Formal korrekt                | Eingabe   | Erklärung   |
|---|--|-------------------------------|---|---|
| NAECHSTER KUPON                                       | Nächster Kupon   | 10- oder 3- stellig numerisch | <sup>a</sup>  | Sammelbezeichnung für den nächsten zu einem Wertpapier gehörenden Ertrags-, Dividenden- oder Zinsschein bzw. Talon (nicht bei nur im Mantel verbriefte Anleihen).   |
| NAECHSTER LEGSCHEIN                                   | Nächster Legitimations-schein  | 2-stellig alphanumerisch      | <sup>a</sup>  | Das Kennzeichen für den nächsten Legitimationsschein (bei Optionsscheinen)  |
| NAME (Auslieferung)                                   | Name   | 70-stellig alphanumerisch     | <sup>a</sup>  | Name des Empfängers (manuelle Eingabe)  |
| NAME (Auslieferung)                                   | Name   | 70-stellig alphanumerisch     | keine   | Name des Empfängers.<br>Anzeige aus CEU Adressendatenbank (KUSTA) für Effekten-Ausgang.   |
| NAME (Einlieferung)                                   | Name   | 70-stellig alphanumerisch     | <sup>a</sup>  | Hier werden der Name und Wohnort des Aktionärs gemäß Aktienbuch des Emittenten angezeigt.   |
| NAME (Auslieferung)                                   | Name   | 70-stellig alphanumerisch     | kann  | Hier kann der Name der drittbegünstigten Bank zum Direktversand der Urkunden eingegeben werden (Vertrag mit CEU erforderlich).  |
| NAMENSZUSATZ  | Ergänzungen zu Name  | 35-stellig alphanumerisch     | kann  |   |
| NOMINALE  | Nominale   | 10,3-stellig numerisch        | muss <sup>b</sup>                                       | Dieses Feld enthält den zu buchenden gesamten Nominalbetrag des Auftrages   |
| NOM-URK   | Urkunden Nominale/ Nennwert  | 10,3-stellig numerisch        | muss <sup>b</sup>                                       | Dieses Feld enthält den gesamten Nominalbetrag der Einlieferung/ Auslieferung errechnet aus der Anzahl je Stückelung. Notwendige Angabe, wenn die Urkunden der WKN/ISIN noch nicht auf EURO umgestellt wurden. Siehe Abschnitt Hintergrund-Informationen Kapitel „EURO“ |
| ORD-NR  | Ordnungs-nummer  | 6-stellig numerisch           | muss bei Neu-zulassung ohne Valutierung und Valutierung | Dient zur eindeutigen Identifikation von Sammelurkunden bei CEU.  |
| OPPO  | Oppositionsgrund   | 3-stellig                     | keine   | Dreistelliger Code für den jeweiligen Oppositionsgrund (siehe <a href="#">Kontrolle (EC) auf Seite 19-1</a> ).  |
| POSTFACH<br>STRASSE<br>LAND/PLZ/ORT<br>(Auslieferung) | Postfach<br>Strasse<br>Länderkenn-<br>zeichen<br>Postleitzahl<br>Ort | Alphanumerisch                | kann  | Angaben zur drittbegünstigten Bank für den Empfänger der Stücke   |

## Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

| Feld auf der Maske             | Bedeutung                       | Formal korrekt   | Eingabe        | Erklärung  |
|--------------------------------|---------------------------------|--|----------------|--|
| PRIMANOTE<br>PRIM              | Primanote                       | 4-stellig numerisch  | keine          | Der CEU-Kunde kann hier mehrere Aufträge unter einer von ihm selbst vergebenen Ordnungsnummer verwalten (Stapelerfassung). Für die Korrektheit dieser Nummer ist der Kunde selbst verantwortlich, da systemseitig keine Überprüfung erfolgt.   |
| RAHMEN-NOM                     | Rahmen-Nominale                 | 12-stellig numerisch   | kann/<br>muss  | Der Nominalbetrag einer Rahmenurkunde. Notwendige Angabe, bei Neuzulassung einer Rahmenurkunde. Siehe <a href="#">Euro-Umstellung auf Seite 26-1</a> .   |
| SAMMELURKUNDE                  | Sammelurkunde                   | 1-stellig alphanumerisch   | J/N            | Kennzeichen zur Unterscheidung zw. Einzel- und Sammelurkunden (bei lfd. Einlieferung)  |
| SAMMEL-NR.                     | Nummer der Sammelurkunde        | 6-stellig numerisch  | kann           | Durch CEU-vergebene eindeutige Identifikation je Sammelurkunde in einer WKN/ISIN.  |
| SB                             | Suchbegriff                     | 55-stellig alphanumerisch  | kann           | Angaben von Parametern (z. B. WKN/ISIN) zur Vereinfachung der Eingabe  |
| SCHRITTWEITE                   | Schrittweite                    | 11-stellig numerisch   | keine/<br>muss | In diesem Feld muss die Anzahl der Stücke angegeben werden, die in der zu erfassenden Verbundnummer (Globalnummer) enthalten sind (von-Nr./bis-Nr.). Bei der Erfassung von Stückenummern mit gleicher Stückelung aber unterschiedlicher Schrittweite, muss dieses Feld geändert werden. Die Eingabe der Schrittweite ist nur für die Funktionen Erfassung und Änderung notwendig. Bei den Informationsanzeigen wird diese Eingabe nicht angezeigt, da sie aus der Stückenummernanzeige hervorgeht. |
| SERIEN-BEZEICHNUNG             | Serienbezeichnung am Wertpapier | 2-stellig alphanumerisch   | muss           | Zusätzliche Angabe zur Stückenummer.<br><br>Emissionsspezifische Darstellung der Stückenummern.  |
| SET-DAY                        | Settlement-Day                  | 8-stellig TT.MM.JHJJ   | muss           | Gewünschter Buchungstag Vorbelegung mit Tagesdatum   |
| SET-STATUS/<br>S (Kurzanzeige) | Settlement-Status               | 1-stellig numerisch  | keine          | Informations-Kennzeichen für den Settlement-Status eines Auftrages (siehe entsprechende Tabelle im Anhang).  |
| ST-ART                         | Stückart                        | 20-stellig alphanumerisch  | keine          | Kennzeichnet die Art des Ausdrucks der Urkunde.  |
| STKL                           | Stückelung                      | 15-stellig (2-stellig für Litera, 13-stellig für Stck.) alphanumerisch | muss           | Aufteilung einer Emission in mehrere Nennbeträge. Innerhalb einer Einheit (Stückelung/ Schrittweite) muss eine Stückenummer eindeutig sein.  |

| Feld auf der Maske                                    | Bedeutung  | Formal korrekt                  | Eingabe | Erklärung  |
|---|--|---------------------------------|---------|--|
| STRASSE   | Straße   | 30-stellig<br>alphanum.         | kann    | Adresse des Empfängers<br>(manuelle Eingabe)   |
| STRASSE<br>POSTFACH<br>LAND/PLZ/ORT<br>(Auslieferung) | Strasse<br>Postfach<br>Länderkennzeichen<br>Postleitzahl<br>Ort                          | Alphanumerisch                  | kann    | Angaben zur drittbegünstigten<br>Bank für den Empfänger der<br>Stücke  |
| STUECKELUNGS-<br>WUNSCH                               | Stückelungs-<br>wunsch für<br>Auslieferung   | 1-stellig<br>J = JA<br>N = NEIN | kann    | Soll die Auslieferung in<br>bestimmten Stückelungen<br>erfolgen, kann hier der Hinweis<br>eingegeben werden. Dazu muss<br>dann in der Folgemaske die<br>entsprechende (n) Anzahl<br>Urkunden zur jeweiligen<br>Stückelung(en) eingegeben<br>werden. Vorbelegung: „N”   |
| STUECKENUMMERN  | siehe Abschnitt<br>Stückenummern in<br>diesem Kapitel<br>sowie einzelne<br>Auftragsarten |                                 |         | Stückenummern auf den<br>Urkunden.   |
| SUMME-NOM   | Summe-Nominale   | 10,3-stellig<br>numerisch       | keine   | Der Nennwert der einzelnen<br>erfassten Stücke wird addiert. Die<br>Summe-Nom muss mit der<br>einzuliefernden Nominale bei der<br>Kontrolle durch den Kunden und/<br>oder Freigabe des Auftrages<br>durch die CEU übereinstimmen.<br>Ist dies nicht der Fall, wird die<br>Summe-Nom farblich abgehoben<br>angezeigt. |
| TEXT  | Text   | 70-stellig<br>alphanum.         | kann    | Hier können zusätzlich<br>Informationen durch den Kunden<br>eingetragen werden.  |
| TRAN  | Transaktions-Code  | 4-stellig alphanum.             | muss    | Auswahl der gewünschten<br>Transaktion (z. B. KVEW -<br>Effekten-Auslieferung)   |
| UEBERFAELLIGER<br>KUPON VON ... BIS                   | überfälliger Kupon<br>von ... bis ...  | 10- oder 3-stellig<br>numerisch | kann    | Hier werden die noch nicht<br>eingelösten Kupons (Nummer<br>oder Datum) eingegeben (nur<br>CEU).   |
| UEBERFAELIGER<br>LEG.SCHEIN<br>VON ... BIS ...        | überfälliger<br>Legitimationsschei<br>n von ... bis ...                                  | 10- oder 3-stellig<br>numerisch | kann    | Hier werden die noch nicht<br>eingelösten Kupons (Nummer<br>oder Datum) eingegeben (nur<br>CEU).   |

## Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

| Feld auf der Maske    | Bedeutung                          | Formal korrekt  | Eingabe      | Erklärung  |
|-----------------------|------------------------------------|---|--------------|--|
| UMLEGUNG              | Umlegung                           | 1-stellig numerisch,<br>Textanzeige<br>10-stellig<br>alphanumerisch | kann         | Durch Umlegung können Urkunden von einem Tresorart in eine andere umgelegt werden.<br><br>Folgende Umlegungsvorgänge sind möglich: <ul style="list-style-type: none"> <li>• 1 = Vorratslager in GS</li> <li>• 2 = GS in Vorratslager</li> <li>• 3 = GS in FTB</li> <li>• 4 = FTB in GS</li> <li>• 5 = FTB in FTB</li> <li>• 6 = Umlegung RU</li> </ul> Die Umlegungsarten 3-5 sind nur für Outsourcer möglich. |
| UMSATZART             | Umsatzart                          | 1-stellig<br>alphanumerisch   | <sup>a</sup> | Mögliche Ausprägungen bei der Depotumsatzabfrage: <ul style="list-style-type: none"> <li>• L = Lastschrift</li> <li>• G = Gutschrift</li> </ul>  |
| USER-ID               | User-Identifizier                  | 10-stellig<br>numerisch   | keine        | Beinhaltet die User-ID des Anwenders.  |
| USER-ID ERFASSER      | User-Identifizier des Erfassers    | 10-stellig<br>numerisch   | keine        | User-Identifizierung wird bei allen Bearbeitungsschritten zusammen mit Datum und Uhrzeit beim Auftrag gespeichert.   |
| USER-ID KONTROLLEUR   | User-Identifizier des Kontrolleurs | 10-stellig<br>numerisch   | keine        | User-Identifizierung wird bei allen Bearbeitungsschritten zusammen mit Datum und Uhrzeit beim Auftrag gespeichert.   |
| VALUTA LTE.BEW.       | Valuta letzte Bewegung             | TT.MM.JJJJ  | keine        | In diesem Feld wird in der Depotbestandsanzeige die letzte Bewegung auf diesem Konto angezeigt.  |
| VERWAHR-MOEGELICHKEIT | Verwahr-Möglichkeit                | 3-stellig numerisch   |              | Beschreibt die Hinterlegung der jeweiligen WKN/ISIN bei der CEU gemäß WM. Die korrespondiert mit der Tabelle Stückart.   |
| WKN                   | Wertpapier-Kennnummer              | siehe Erklärung   | muss         | Abhängig von der Eingabe bei der WP-Kennung gelten für die WKN/ISIN folgende Bedingungen (siehe auch WP-Kennung): <ul style="list-style-type: none"> <li>• W = 6-stellig numerisch</li> <li>• I = 12-stellig alphanumerisch</li> <li>• B = 3 bzw.4-stellig alphanumerisch</li> </ul>   |
| WKN DES RECHTS        | Wertpapier-Kennnummer des Rechts   | siehe WKN   | muss bei RS  | Eingabe bei Neuzulassung, Valutierung in Namensaktien zur eindeutigen Zuordnung der Kapitalmaßnahmen.  |
| WKN-KENNUNG-D-RECHTS  | Wertpapierkennung des Rechts       | 1-stellig<br>alphanumerisch   | muss         | Siehe WP-Kennung.  |

| Feld auf der Maske        | Bedeutung  | Formal korrekt            | Eingabe | Erklärung   |
|---------------------------|--|---------------------------|---------|---|
| WKN-Info                  | Wertpapier-Kennnummer  | Textfeld                  | keine   | Erste Zeile: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Zinssatz</li> <li>• Kurzbezeichnung</li> <li>• Zinstermin der Gattung</li> </ul> Zweite Zeile: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Gattungssperre mit Gültigkeitszeitraum</li> <li>• Verlosungs-, Rückzahlungs- bzw. Kündigungsinformationen</li> <li>• bei Einlieferung von RS: GS-Stichtag für RS</li> </ul> |
| WKN-Stammrecht            | Wertpapier-Kennnummer des Stammrechts bei Einlieferung von Bezugsrechten | siehe WKN                 | muss    | In diesem Feld wird die Wertpapierkennnummer eingegeben, welche dem eingelieferten Bezugsrecht als Stamm-WKN/ISIN zugeordnet ist.   |
| WKN-KENNUNG-D-Stammrechts | Wertpapierkennung des Stammrechts  | 1-stellig alphanumerisch  | muss    | Siehe WP-Kennung.   |
| WOHNORT                   | Wohnort  | 35-stellig alphanumerisch | keine   | Hier wird der Wohnort des Aktionärs gemäß Aktienbuch des Emittenten angezeigt.  |
| WP-KENNUNG                | Wertpapier-Kennung   | 1-stellig alphanumerisch  | muss    | Eingabemöglichkeiten: <ul style="list-style-type: none"> <li>• W = Deutsche WKN</li> <li>• I = ISIN</li> <li>• B = Börsenkürzel</li> </ul> Vorbelegung: „I“   |

- a. Muss- oder Kannfeld hängt vom jeweiligen Vorgang ab.
- b. Eines der beiden Felder muss gefüllt sein.

Die Felder für den Börsenplatz (BOERSENPL) und den Abwicklungsplatz (CLRNG PL) werden im Bereich der effektiven Wertpapierabwicklung nicht benötigt. In der Kommunikation mit T2S wird an diesen Stellen ein Leerzeichen („blank“) gemeldet.

# 11 Spezifische Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

## 11.1 Stückenummern

---

Die Stückenummern auf den Urkunden, die beim bzw. über die CEU effektiv bewegt werden sollen, sind Bestandteil der jeweiligen zugrundeliegenden Aufträge. Die Erfassung der Stückenummern richtet sich in Format und Inhalt weitestgehend nach der ISO-Norm. Bei der Eingabe jeder einzelnen Stückenummer findet ein Abgleich gegen alle bereits in den CEU-Anwendungen (CARAD oder Aufträge im Auftragsstatus) vorhandenen Stückenummern statt. Dadurch wird eine doppelte Nummern Erfassung bzw. Hinterlegung bei CEU unmöglich.

Darüber hinaus prüft CASCADE mit der Verarbeitung der Stückenummern sofort gegen vorhandene Oppositionsangaben aus den aktuellen Daten der WM für die Wertpapiere.

Bei Einlieferungen von effektiven (vinkulierten) Namensaktien werden die Stückenummern zusätzlich gegen die Stückenummern des Aktionärs (Zession) aus dem Aktienbuch des Emittenten geprüft. Sind die Stückenummern nicht der eingegebenen Aktionärsnummer zuordenbar, wird die Eingabe abgelehnt.

### 11.1.1 Erfassung der Stückenummern – Begriffe und Zeichensatz

#### **Einzelne Stückenummern (Einzelurkunde)**

Eine einzelne (Stücke-) Nummer mit den Ziffern 0 bis 9 gemäß den Angaben auf der Urkunde identifiziert ausdrücklich einen einzelnen Titel. Einzelne Stückenummern bzw. einzelne, lückenlos aufeinanderfolgende Stückenummern werden durch Komma oder Blank getrennt.

Beispiel:

Eingabe *einzelner* und *einzelner fortlaufender* Stückenummern je Stückelung in CASCADE:

WKN/ISIN DE0007614401

Stückelung 100

Stückenummern auf den einzuliefernden Urkunden:

565001

565002

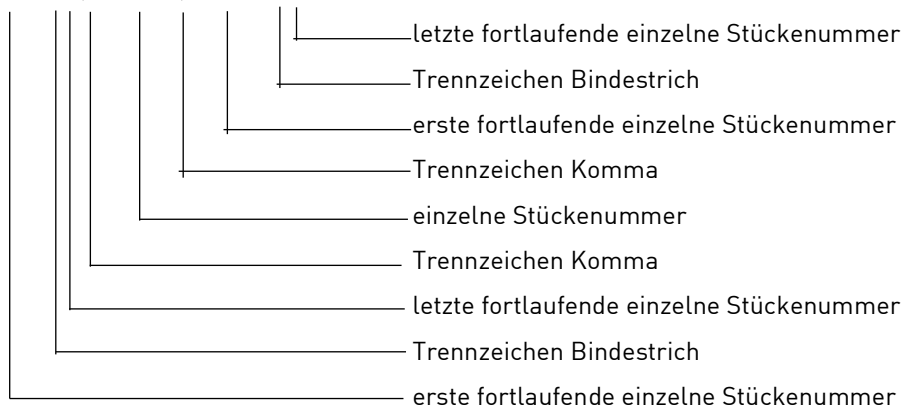
565003

565005

565007

565008

565001 - 3 , 565005 , 565007 - 8



**Hinweis:** Die Schrittweite zur Eingabe einzelner Stückenummern beträgt immer 1, da die Urkunde eine Nummer beinhaltet. Bei der Eingabe von Stückenummern mit Schrittweite größer 1 (Verbundnummern) kann der Fließtext über zwei Zeilen gehen; dann muss das Zeichen „-“ am Ende der Zeile erfasst werden.

### Verbund(global)nummern

Verbundnummern charakterisieren lückenlos vergebene Wertpapiernummern, die einen Titel identifizieren, der keine eigene Nummer aufweist. Die kleinste Nummer (Von-Nr.) und die größte Nummer (Bis-Nr.) werden durch Schrägstrich verbunden.

### Beispiel:

Eingabe von *Verbundnummern* je Stückelung in CASCADE:

WKN/ISIN DE0007614401

Stückelung 200

Schrittweite 20

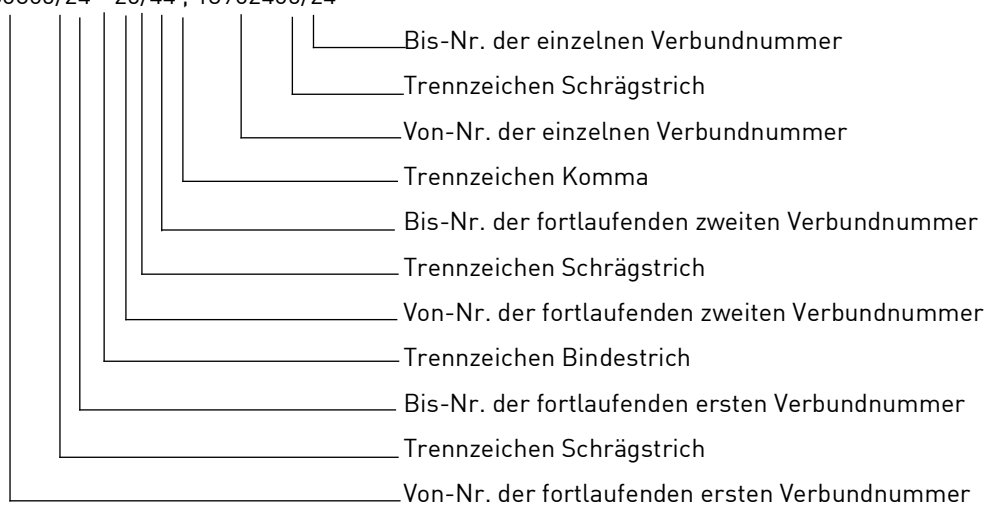
Verbundnummern auf den einzuliefernden Urkunden:

13760805/24

13760825/44

13902405/24

13760805/24 - 25/44 , 13902405/24



**Hinweis:** Die Anzahl der Verbundnummern auf der Urkunde wird im Feld Schrittweite angegeben. Im oben aufgeführten Beispiel beträgt die Schrittweite 20, da die drei Urkunden jeweils 20 Stücke umfassen.

## 11.1.2 Erfassung von Ziffern, Buchstaben und Zeichen für Stücknummerneingabe

Es stehen folgende Ziffern, Buchstaben und Zeichen für die Stücknummerneingabe zur Verfügung:

| Bestandteil<br>Stücknummerneingabe<br>auf der Bildschirmmaske | Bedeutung<br>korrekt | Formal korrekt  | Eingabe      | Erklärung   |
|---|----------------------|---|--------------|---|
| 0-9   | Stücknummer          | 12-stellig (max.)<br>17-stellig mit<br>Litera numerisch | muss         | Zahlen gemäß den Ziffern<br>auf der Urkunde   |
| 1-10<br>A-K<br>römische Ziffern<br>zweistellig                | Litera/<br>STCKL     | 2-stellig<br>alphanumerisch                             | <sup>a</sup> | Litera der Stückelung<br>(Angabe nur; wenn<br>innerhalb einer Stückelung<br>verschiedene Litera für die<br>Stücknummern existieren).                            |
| ,   | Komma                | 1-stellig<br>alphanumerisch                             | <sup>a</sup> | Komma und/oder Blank<br>werden als Trennzeichen<br>hinter jeder Nummer und/<br>oder Nummernfolge<br>verwendet.  |
| -   | Bindestrich          | 1-stellig<br>alphanumerisch                             | <sup>a</sup> | Bindestrich verbindet die<br>erste mit der letzten<br>Stücknummer bei<br>Nummernkreisen;<br>mindestens zwei physische<br>Wertpapiere                            |
| /   | Schrägstrich         | 1-stellig<br>alphanumerisch                             | <sup>a</sup> | Schrägstrich verbindet Von-<br>und Bis- (Globalnummern);<br>ein einziges physisches<br>Wertpapier bzw. innerhalb<br>einer Sammelurkunde<br>verbriefter Nummern. |

a. Muss- oder Kanneingabe kann nicht eindeutig festgelegt werden, sondern hängt vom jeweiligen Vorgang ab.

## 11.1.3 Anzeige der Stücknummern in der Anwendung

Die CASCADE-Anwendung setzt die unten aufgeführten Zeichen automatisch bei der Anzeige der Stücknummern.

| Bestandteil<br>Stücknummernein-<br>gabe auf der<br>Bildschirmmaske | Bedeutung korrekt | Formal korrekt              | Eingabe | Erklärung  |
|--|-------------------|-----------------------------|---------|--|
| *  | Stern             | 1-stellig<br>alphanumerisch | keine   | Dient in der Kombination '**' zur<br>Kennzeichnung von genau 100<br>Stücknummern in der Zeile. |
| <  | Kleiner Zeichen   | 1-stellig<br>alphanumerisch | keine   | Dient zur Kennzeichnung von 99<br>oder weniger Stücknummern in<br>einer Zeile.                 |

## 11.1.4 Bearbeitung der erfassten Stücknummern

Erfasste oder weitererfasste Stücknummern bzw. Nummernfolgen können in der CASCADE-Erfassung und/oder Änderung/Löschung auch in den Eingabezeilen bearbeitet werden. Die Anzeige der letzten erfassten Stücknummer erfolgt in einer separaten Zeile. Für die Bearbeitung der Stücknummern sowohl in der CASCADE-Erfassung als auch im Änderungsdienst stehen verschiedene Kennzeichen zur Verfügung, die gemischt oder aufeinander aufbauend verwendet werden. Eine in der 1. Zeile erfasste und abgespeicherte Stücknummer könnte somit in der zweiten Zeile zur Löschung markiert werden.

| Kennzeichnung zur Bearbeitung von Stücknummern | Bedeutung   | Formal korrekt           | Eingabe | Erklärung   |
|--|---|--------------------------|---------|---|
| A und N  | Änderung bereits <b>gespeicherter</b> Stücknummern        | 1-stellig alphanumerisch | A       | Die Kennzeichen A und N sind nur kombiniert nutzbar. Mit A wird in der 1. Zeile die Stücknummer eingegeben, die geändert werden soll. Mit N wird in der nächsten Zeile die neue Stücknummer <b>eingegeben</b> . Damit wird eine bereits gespeicherte Stücknummer geändert und die neue Stücknummer behält die Position der alten Stücknummer im Auftrag bei. Die Anzahl der neuen Stücknummern kann gleich oder kleiner sein als die Anzahl der alten Stücknummern. Bei der Änderung von Stücknummern für Sammelurkunden muss die Stückelung in einer Zeile beibehalten werden. Nur bei Einzelurkunden: Die Eingabe von Mängelkennzeichen bzw. die Kennzeichnung als Ersatzstücke für die 'alten' Stücknummern werden nicht übernommen. Diese Informationen können mit den neuen Stücknummern erfasst werden. |
| E  | Änderung von Stücknummern/ Nummernfolgen                  | 1-stellig alphanumerisch | E       | Mit der Eingabe der Kennzeichnung „E“ Ersatzurkunde werden andere Kennzeichnungen komplett überschrieben. Die Verarbeitungstasten PF3 und PF6 speichern die Neueingabe.   |
| M  | Änderung der Mängelgründe von Stücknummern/ Nummernfolgen | 1-stellig alphanumerisch | M       | Änderung eines bereits eingegebenen Mangels für genau eine Stücknummer/ Nummernfolge. Mit der Eingabe von neuen Mängel werden alle bereits eingegebenen Mängel (ausgenommen Oppositionsmängel) komplett überschrieben. Die Verarbeitungstasten PF3 und PF6 speichern die Neueingabe. Die Datenfreigabe ignoriert die Neueingabe und blendet die 'alten' Mängel ein.   |

| Kennzeichnung zur Bearbeitung von Stücknummern | Bedeutung                                | Formal korrekt              | Eingabe | Erklärung  |
|--|--|-----------------------------|---------|--|
| L  | Löschung einer Stücknummer/ Nummernfolge | 1-stellig<br>alphanumerisch | L       | Löschung von Stücknummern/ Nummernfolgen im Auftrag, wobei nicht alle zu löschenden Stücknummern im Auftrag vorhanden sein müssen. Die Löschung wird jedoch abgewiesen, wenn keine einzige Stücknummer im Auftrag gespeichert ist. Die Eingabe von Mängeln für die Stücknummern bzw. die Kennzeichnung als Ersatzstücke ist nicht möglich. |

**Hinweis:** Bei der Bearbeitung von bereits erfassten Stücknummern und/oder Mängelgründen mit den Kennzeichen „A“, „M“ oder „N“ müssen die Stücknummern so eingegeben werden, wie sie im Auftrag bei der Erfassung gespeichert wurden. Bei der Bearbeitung der Stücknummern/ Nummernfolgen anhand der beschriebenen Kennzeichen ist zu beachten, dass die Tasten PF3 und PF6 die Daten zur Verarbeitung freigeben. Die Bearbeitung mit der ENTER-Taste führt nicht zur Verarbeitung der Daten. Eine aufeinander aufbauende Bearbeitung der Stücknummern nach der „ENTER-Eingabe“ führt deshalb in der zweiten Zeile zur Fehlermeldung.

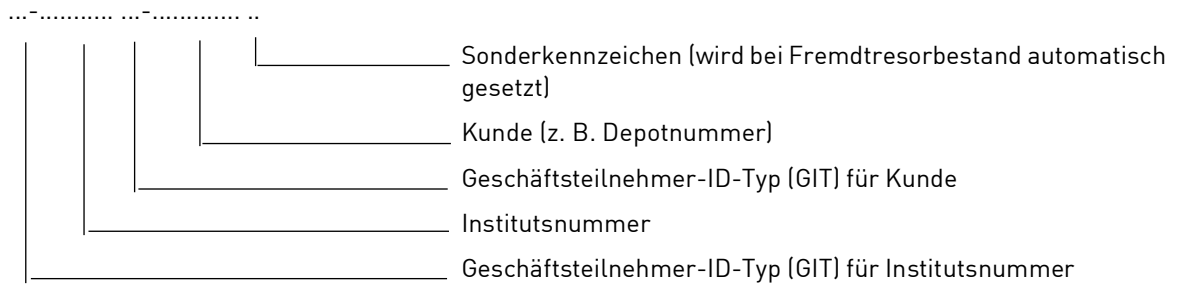
## 11.2 Die Kundenreferenz

Die Kundenreferenz ermöglicht dem Eingaber je gewählter Auftragsart, Auftragsinformationen zum Auftraggeber bzw. Endbegünstigten zu spezifizieren. Sofern kein zweiter Kunde der CEU am Auftrag beteiligt ist, enthält die Kundenreferenz stets die Geschäftsteilnehmerdaten der eingebenden Seite. Bei (vinkulierten) Namensaktien (Registered Shares - RS) und Fremdtresorführung (FTB) dient die Kundenreferenz auch als Merkmal für die erweiterte Bestandsführung in diesen Gattungen.

Format und Inhalt der Kundenreferenz sind entsprechend standardisiert und werden, sofern allgemein gültig, in den nachfolgenden Abschnitten beschrieben. Auftragspezifische Gegebenheiten sind in den entsprechenden Kapiteln dokumentiert.

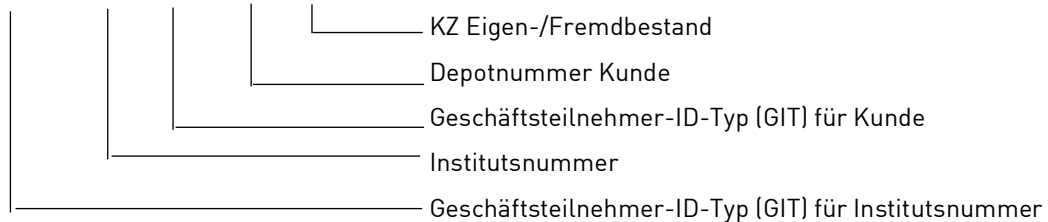
### 11.2.1 Format der Kundenreferenz

Format und Inhalt des Feldes Kundenreferenz gliedern sich wie folgt:



**Beispiel:**

BIC - DE00123 KTO - 123456 E



| Bestandteil Kundenreferenz                    | Bedeutung korrekt                             | Formal                         | Eingabe      | Erklärung   |
|---|---|--------------------------------|--------------|---|
| Geschäftsteilnehmer-Identifikations-Typ (GIT) | Geschäftsteilnehmer-Identifikations-Typ (GIT) | 3-stellig alphanumerisch       | <sup>a</sup> | <p>Dieses Feld kann mit einem dreistelligen Kürzel belegt werden, welches die Angabe der Kundenreferenz Drittbank bzw. des Kunden im Hinblick auf eine maschinelle Weiterverarbeitung unterstützt. Folgende Inhalte werden derzeit als Eingabe empfohlen (abhängig von der Auftragsart:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• BIC für Bank-Identifikations-Code</li> <li>• BLZ für Bankleitzahl</li> <li>• KTO für Konto</li> </ul> <p>Wird die Kundenreferenz GIT Drittbank mit einem der aufgelisteten Kürzel belegt, muss eine Eingabe für die Kundenreferenz Drittbank erfolgen.</p> |
| Drittbank                                     | Drittbank                                     | max. 11-stellig alphanumerisch | <sup>a</sup> | <p>Konto-/-Filial-/Institutsnummer einer Bank, für die ein Kunde der CEU den CASCADE-Auftrag eingibt.</p> <p>Die formale Eingabe der Drittbank richtet sich nach der gewählten GIT Drittbank:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• GIT Drittbank</li> <li>• BIC durchgängig: 8- oder 11-stellig</li> <li>• BLZ 8-stellig</li> <li>• KTO → 0</li> </ul> <p>Die Kundenreferenz Drittbank kann auch ohne Angabe einer Drittbank angegeben werden.</p>  |

## Spezifische Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

| Bestandteil<br>Kundenreferenz | Bedeutung<br>korrekt | Formal                            | Eingabe      | Erklärung   |
|-------------------------------|----------------------|-----------------------------------|--------------|---|
| Kunde                         | Kunde                | max. 13-stellig<br>alphanumerisch | <sup>a</sup> | <p>Konto-/Filialnummern der Niederlassung eines Kunden bzw. Kontonummer des Kunden, der hinter dem Kunden der CEU bzw. der Drittbank steht (Auftraggeber, Begünstigter).</p> <p>Die formale Eingabe des Kunden richtet sich nach der gewählten GIT Kunde:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• GIT Drittbank</li> <li>• BIC durchgängig: 8- oder 11-stellig</li> <li>• BLZ 8-stellig</li> <li>• KTO &gt; 0</li> </ul> <p>Die Kundenreferenz Kunde kann auch ohne Angabe einer GIT für den Kunden eingegeben werden.</p> |
| Sonderkennzeichen             | Sonderkennzeichen    | 2-stellig numerisch               |              | <p>Kennzeichen Eigen-/ Fremdbestand wird bei Fremdtresor-Verwahrung automatisch in Abhängigkeit zur Kontierung automatisch gesetzt:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• E – Eigenbestand</li> <li>• F – Fremdbestand</li> </ul> <p>KZ ist Bestandteil des SIM (Streifband identifizierendes Merkmal)</p>   |

a. Muss- oder Kannfeld hängt vom jeweiligen Vorgang ab.

Leerseite

## 12 Spezifische Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

### 12.1 Stückenummern

Die Stückenummern auf den Urkunden, die beim bzw. über die CEU effektiv bewegt werden sollen, sind Bestandteil der jeweiligen zugrundeliegenden Aufträge. Die Erfassung der Stückenummern richtet sich in Format und Inhalt weitestgehend nach der ISO-Norm. Bei der Eingabe jeder einzelnen Stückenummer findet ein Abgleich gegen alle bereits in den CEU-Anwendungen (CARAD oder Aufträge im Auftragsstatus) vorhandenen Stückenummern statt. Dadurch wird eine doppelte Nummerenerfassung bzw. Hinterlegung bei CEU unmöglich.

Darüber hinaus prüft CASCADE mit der Verarbeitung der Stückenummern sofort gegen vorhandene Oppositionsangaben aus den aktuellen Daten der WM für die Wertpapiere.

Bei Einlieferungen von effektiven (vinkulierten) Namensaktien werden die Stückenummern zusätzlich gegen die Stückenummern des Aktionärs (Zession) aus dem Aktienbuch des Emittenten geprüft. Sind die Stückenummern nicht der eingegebenen Aktionärsnummer zuordenbar, wird die Eingabe abgelehnt.

#### 12.1.1 Erfassung der Stückenummern – Begriffe und Zeichensatz

##### Einzelne Stückenummern (Einzelurkunde)

Eine einzelne (Stücke-) Nummer mit den Ziffern 0 bis 9 gemäß den Angaben auf der Urkunde identifiziert ausdrücklich einen einzelnen Titel. Einzelne Stückenummern bzw. einzelne, lückenlos aufeinanderfolgende Stückenummern werden durch Komma oder Blank getrennt.

##### Beispiel:

Eingabe *einzelner* und *einzelner fortlaufender* Stückenummern je Stückelung in CASCADE:

WKN/ISIN DE0007614401

Stückelung 100

Stückenummern auf den einzuliefernden Urkunden:

565001

565002

565003

565005

565007

565008

565001 - 3 , 565005 , 565007 - 8

letzte fortlaufende einzelne Stückenummer

Trennzeichen Bindestrich

erste fortlaufende einzelne Stückenummer

Trennzeichen Komma

einzelne Stückenummer

Trennzeichen Komma

letzte fortlaufende einzelne Stückenummer

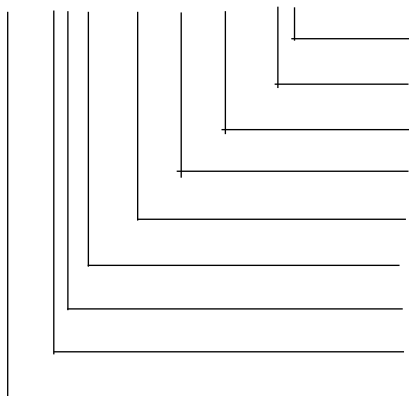
Trennzeichen Bindestrich

erste fortlaufende einzelne Stückenummer

**Hinweis:** Die Schrittweite zur Eingabe einzelner Stückenummern beträgt immer 1, da die Urkunde eine Nummer beinhaltet. Bei der Eingabe von Stückenummern mit Schrittweite größer 1 (Verbundnummern) kann der Fließtext über zwei Zeilen gehen; dann muss das Zeichen „-“ am Ende der Zeile erfasst werden.

**Verbund(global)nummern**

Verbundnummern charakterisieren lückenlos vergebene Wertpapiernummern, die einen Titel identifizieren, der keine eigene Nummer aufweist. Die kleinste Nummer (Von-Nr.) und die größte Nummer (Bis-Nr.) werden durch Schrägstrich verbunden.



### Beispiel:

Eingabe von *Verbundnummern* je Stückelung in CASCADE:

WKN/ISIN DE0007614401

Stückelung 200

Schrittweite 20

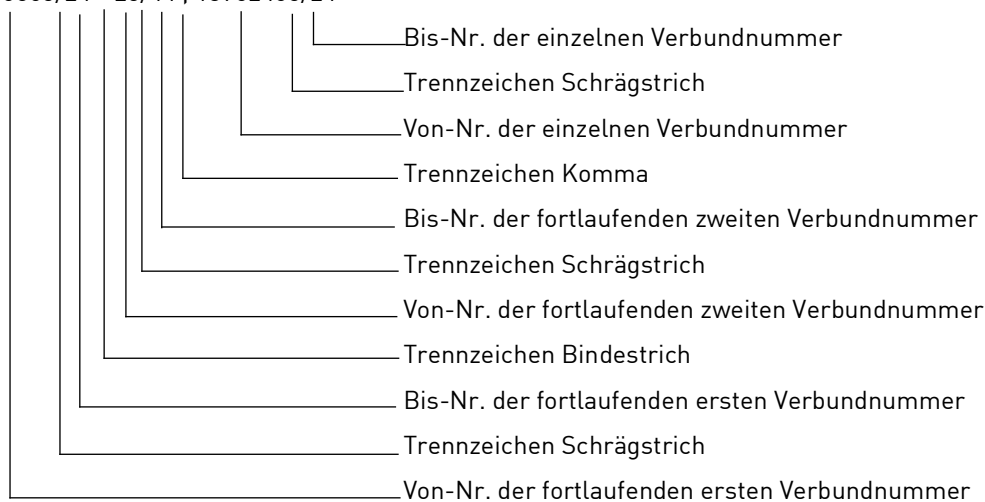
Verbundnummern auf den einzuliefernden Urkunden:

13760805/24

13760825/44

13902405/24

13760805/24 - 25/44 , 13902405/24



**Hinweis:** Die Anzahl der Verbundnummern auf der Urkunde wird im Feld Schrittweite angegeben. Im oben aufgeführten Beispiel beträgt die Schrittweite 20, da die drei Urkunden jeweils 20 Stücke umfassen.

## 12.1.2 Erfassung von Ziffern, Buchstaben und Zeichen für Stücknummerneingabe

Es stehen folgende Ziffern, Buchstaben und Zeichen für die Stücknummerneingabe zur Verfügung:

| Bestandteil<br>Stücknummerneingabe<br>auf der Bildschirmmaske | Bedeutung<br>korrekt | Formal korrekt                                    | Eingabe      | Erklärung  |
|---|----------------------|---|--------------|--|
| 0-9   | Stücknummer          | 12-stellig (max.) 17-stellig mit Litera numerisch | muss         | Zahlen gemäß den Ziffern auf der Urkunde   |
| 1-10<br>A-K<br>römische Ziffern zweistellig                   | Litera/<br>STCKL     | 2-stellig<br>alphanumerisch                       | <sup>a</sup> | Litera der Stückelung (Angabe nur; wenn innerhalb einer Stückelung verschiedene Litera für die Stücknummern existieren).                       |
| ,   | Komma                | 1-stellig<br>alphanumerisch                       | <sup>a</sup> | Komma und/oder Blank werden als Trennzeichen hinter jeder Nummer und/oder Nummernfolge verwendet.  |
| -   | Bindestrich          | 1-stellig<br>alphanumerisch                       | <sup>a</sup> | Bindestrich verbindet die erste mit der letzten Stücknummer bei Nummernkreisen; mindestens zwei physische Wertpapiere                          |
| /   | Schrägstrich         | 1-stellig<br>alphanumerisch                       | <sup>a</sup> | Schrägstrich verbindet Von- und Bis- (Globalnummern); ein einziges physisches Wertpapier bzw. innerhalb einer Sammelurkunde verbrieft Nummern. |

a. Muss- oder Kanneingabe kann nicht eindeutig festgelegt werden, sondern hängt vom jeweiligen Vorgang ab.

## 12.1.3 Anzeige der Stücknummern in der Anwendung

Die CASCADE-Anwendung setzt die unten aufgeführten Zeichen automatisch bei der Anzeige der Stücknummern.

| Bestandteil<br>Stücknummerneingabe<br>auf der Bildschirmmaske | Bedeutung korrekt | Formal korrekt              | Eingabe | Erklärung  |
|---|-------------------|-----------------------------|---------|--|
| *   | Stern             | 1-stellig<br>alphanumerisch | keine   | Dient in der Kombination '**' zur Kennzeichnung von genau 100 Stücknummern in der Zeile. |
| <   | Kleiner Zeichen   | 1-stellig<br>alphanumerisch | keine   | Dient zur Kennzeichnung von 99 oder weniger Stücknummern in einer Zeile.                 |

## 12.1.4 Bearbeitung der erfassten Stücknummern

Erfasste oder weitererfasste Stücknummern bzw. Nummernfolgen können in der CASCADE-Erfassung und/oder Änderung/Löschung auch in den Eingabezeilen bearbeitet werden. Die Anzeige der letzten erfassten Stücknummer erfolgt in einer separaten Zeile. Für die Bearbeitung der Stücknummern sowohl in der CASCADE-Erfassung als auch im Änderungsdienst stehen verschiedene Kennzeichen zur Verfügung, die gemischt oder aufeinander aufbauend verwendet werden. Eine in der 1. Zeile erfasste und abgespeicherte Stücknummer könnte somit in der zweiten Zeile zur Löschung markiert werden.

| Kennzeichnung zur Bearbeitung von Stücknummern | Bedeutung  | Formal korrekt              | Eingabe | Erklärung   |
|--|--|-----------------------------|---------|---|
| A und N  | Änderung bereits <b>gespeicherter</b> Stücknummern           | 1-stellig<br>alphanumerisch | A       | Die Kennzeichen A und N sind nur kombiniert nutzbar. Mit A wird in der 1. Zeile die Stücknummer eingegeben, die geändert werden soll. Mit N wird in der nächsten Zeile die neue Stücknummer <b>eingegeben</b> . Damit wird eine bereits gespeicherte Stücknummer geändert und die neue Stücknummer behält die Position der alten Stücknummer im Auftrag bei. Die Anzahl der neuen Stücknummern kann gleich oder kleiner sein als die Anzahl der alten Stücknummern. Bei der Änderung von Stücknummern für Sammelurkunden muss die Stückelung in einer Zeile beibehalten werden. Nur bei Einzelurkunden: Die Eingabe von Mängelkennzeichen bzw. die Kennzeichnung als Ersatzstücke für die 'alten' Stücknummern werden nicht übernommen. Diese Informationen können mit den neuen Stücknummern erfasst werden. |
| E  | Änderung von Stücknummern/<br>Nummernfolgen                  | 1-stellig<br>alphanumerisch | E       | Mit der Eingabe der Kennzeichnung „E“ Ersatzurkunde werden andere Kennzeichnungen komplett überschrieben. Die Verarbeitungstasten PF3 und PF6 speichern die Neueingabe.   |
| M  | Änderung der Mängelgründe von Stücknummern/<br>Nummernfolgen | 1-stellig<br>alphanumerisch | M       | Änderung eines bereits eingegebenen Mangels für genau eine Stücknummer/<br>Nummernfolge. Mit der Eingabe von neuen Mängel werden alle bereits eingegebenen Mängel (ausgenommen Oppositionsmängel) komplett überschrieben. Die Verarbeitungstasten PF3 und PF6 speichern die Neueingabe. Die Datenfreigabe ignoriert die Neueingabe und blendet die 'alten' Mängel ein.  |

| Kennzeichnung zur Bearbeitung von Stücknummern | Bedeutung                                | Formal korrekt              | Eingabe | Erklärung   |
|--|--|-----------------------------|---------|---|
| L  | Löschung einer Stücknummer/ Nummernfolge | 1-stellig<br>alphanumerisch | L       | Löschung von Stücknummern/ Nummernfolgen im Auftrag, wobei nicht alle zu löschenden Stücknummern im Auftrag vorhanden sein müssen. Die Löschung wird jedoch abgewiesen, wenn keine einzige Stücknummer im Auftrag gespeichert ist. Die Eingabe von Mängel für die Stücknummern bzw. die Kennzeichnung als Ersatzstücke ist nicht möglich. |

**Hinweis:** Bei der Bearbeitung von bereits erfassten Stücknummern und/oder Mängelgründen mit den Kennzeichen „A“, „M“ oder „N“ müssen die Stücknummern so eingegeben werden, wie sie im Auftrag bei der Erfassung gespeichert wurden. Bei der Bearbeitung der Stücknummern/ Nummernfolgen anhand der beschriebenen Kennzeichen ist zu beachten, dass die Tasten PF3 und PF6 die Daten zur Verarbeitung freigeben. Die Bearbeitung mit der ENTER-Taste führt nicht zur Verarbeitung der Daten. Eine aufeinander aufbauende Bearbeitung der Stücknummern nach der „ENTER-Eingabe“ führt deshalb in der zweiten Zeile zur Fehlermeldung.

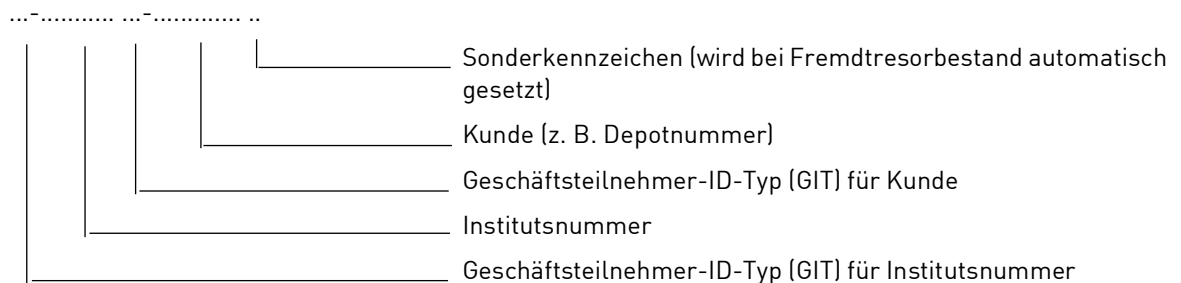
## 12.2 Die Kundenreferenz

Die Kundenreferenz ermöglicht dem Eingaber je gewählter Auftragsart, Auftragsinformationen zum Auftraggeber bzw. Endbegünstigten zu spezifizieren. Sofern kein zweiter Kunde der CEU am Auftrag beteiligt ist, enthält die Kundenreferenz stets die Geschäftsteilnehmerdaten der eingebenden Seite. Bei (vinkulierten) Namensaktien (Registered Shares - RS) und Fremdtresorführung (FTB) dient die Kundenreferenz auch als Merkmal für die erweiterte Bestandsführung in diesen Gattungen.

Format und Inhalt der Kundenreferenz sind entsprechend standardisiert und werden, sofern allgemein gültig, in den nachfolgenden Abschnitten beschrieben. Auftragspezifische Gegebenheiten sind in den entsprechenden Kapiteln dokumentiert.

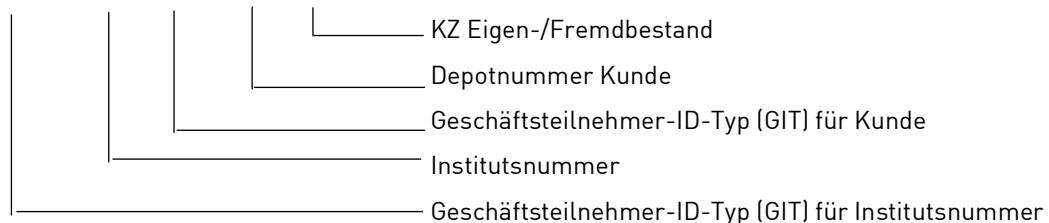
### 12.2.1 Format der Kundenreferenz

Format und Inhalt des Feldes Kundenreferenz gliedern sich wie folgt:



**Beispiel:**

BIC - DE00123 KTO - 123456 E



| Bestandteil Kundenreferenz                    | Bedeutung korrekt                             | Formal                    | Eingabe      | Erklärung   |
|---|---|---------------------------|--------------|---|
| Geschäftsteilnehmer-Identifikations-Typ (GIT) | Geschäftsteilnehmer-Identifikations-Typ (GIT) | 3-stellig alphanum.       | <sup>a</sup> | <p>Dieses Feld kann mit einem dreistelligen Kürzel belegt werden, welches die Angabe der Kundenreferenz Drittbank bzw. des Kunden im Hinblick auf eine maschinelle Weiterverarbeitung unterstützt. Folgende Inhalte werden derzeit als Eingabe empfohlen (abhängig von der Auftragsart:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• BIC für Bank-Identifikations-Code</li> <li>• BLZ für Bankleitzahl</li> <li>• KTO für Konto</li> </ul> <p>Wird die Kundenreferenz GIT Drittbank mit einem der aufgelisteten Kürzel belegt, muss eine Eingabe für die Kundenreferenz Drittbank erfolgen.</p> |
| Drittbank                                     | Drittbank                                     | max. 11-stellig alphanum. | <sup>a</sup> | <p>Konto-/-Filial-/Institutsnummer einer Bank, für die ein Kunde der CEU den CASCADE-Auftrag eingibt.</p> <p>Die formale Eingabe der Drittbank richtet sich nach der gewählten GIT Drittbank:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• GIT Drittbank</li> <li>• BIC durchgängig: 8- oder 11-stellig</li> <li>• BLZ 8-stellig</li> <li>• KTO &gt; 0</li> </ul> <p>Die Kundenreferenz Drittbank kann auch ohne Angabe einer Drittbank angegeben werden.</p>   |

## Spezifische Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

| Bestandteil<br>Kundenreferenz | Bedeutung<br>korrekt | Formal                       | Eingabe      | Erklärung   |
|-------------------------------|----------------------|------------------------------|--------------|---|
| Kunde                         | Kunde                | max. 13-stellig<br>alphanum. | <sup>a</sup> | <p>Konto-/Filialnummern der Niederlassung eines Kunden bzw. Kontonummer des Kunden, der hinter dem Kunden der CEU bzw. der Drittbank steht (Auftraggeber, Begünstigter).</p> <p>Die formale Eingabe des Kunden richtet sich nach der gewählten GIT Kunde:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• GIT Drittbank</li> <li>• BIC durchgängig: 8- oder 11-stellig</li> <li>• BLZ 8-stellig</li> <li>• KTO &gt; 0</li> </ul> <p>Die Kundenreferenz Kunde kann auch ohne Angabe einer GIT für den Kunden eingegeben werden.</p> |
| Sonderkennzeichen             | Sonderkennzeichen    | 2-stellig numerisch          |              | <p>Kennzeichen Eigen-/Fremdbestand wird bei Fremdtresor-Verwahrung automatisch in Abhängigkeit zur Kontierung automatisch gesetzt:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• E – Eigenbestand</li> <li>• F – Fremdbestand</li> </ul> <p>KZ ist Bestandteil des SIM (Streifband identifizierendes Merkmal)</p>  |

a. Muss- oder Kannfeld hängt vom jeweiligen Vorgang ab.

Leerseite

## 13 T2S-bedingte Validierungen in AA16 / AA18 Instruktionen

CEU stellt bereits seit der TARGET2-Securities (T2S) Welle 1 (22. Juli 2015) täglich die Daten zu vielen ISINs auf T2S bereit.

Die folgenden Validierungen müssen für die Auftragsvarianten laufende Einlieferung und Neuzulassung (inkl. Neuzulassung mit Nominale = 0) bei T2S-relevanten Aufträgen gelten:

- Die Gattung muss in T2S aktiv sein (Ausnahme sind maltesische Gattungen).
- Für die folgenden Felder muss in WSS-WM und WSS-CEU zur Sicherung der Datenqualität, falls das Feld von einer Seite gefüllt ist, das Feld in beiden Systemen identisch gefüllt sein:
  - „kleinste Stückelung“
  - „Mindestbetrag“
  - „Inkrement“
  - „Verwahrart“
- Sofern aus T2S bestätigte Werte vorliegen, wird die Nominale der Instruktion gegen diese Werte validiert. Falls nicht und die ISIN in WSS-CEU verfügbar ist, wird gegen „kleinste Stückelung“ und „kleinste übertragbare Einheit“ in WSS-CEU geprüft, oder sonst gegen „kleinste Stückelung“ und „kleinste übertragbare Einheit“ in WSS-WM.
- Nominale  $\geq$  der aus T2S bestätigte Mindestbetrag („T2S confirmed Minimum Denomination“)
- Nominale muss ohne Rest durch das aus T2S bestätigte, kleinste Vielfache („T2S confirmed Multiple Quantity“) teilbar sein.
- Der Wert des Feldes „Einheit Effektennotiz“ muss identisch sein zum entsprechenden Wert in WSS-CEU („T2S confirmed Quantity Type“).
- Instruktionen, die an T2S übertragen werden, werden abgelehnt, so lange in T2S kein aktiver Security CSD Issuer Link existiert, mit CEU als Issuer CSD.
- Falls das Settlement Date der Instruktion vor dem Datum liegt, zu dem die ISIN in T2S angelegt wird oder später als das Fälligkeitsdatum („Maturity Datum“) der ISIN ist, wird die Instruktion von T2S abgelehnt.
- Falls das Settlement Date der Instruktion vor dem Gültig-Von („ValidFrom“) oder nach dem Gültig-Bis („ValidTo“) Datum des Security CSD Link liegt, wird die Instruktion von T2S abgelehnt.
- Das Settlement Date muss ein Bankarbeitstag sein.

Die folgenden Validierungen gelten mit diesem Release für die Auftragsvariante Valutierung, für alle Auslieferungsvarianten sowie für nicht T2S-relevante Aufträge:

- Sofern aus T2S bestätigte Werte vorliegen, wird die Nominale der Instruktion gegen diese Werte validiert. Falls nicht und die ISIN in WSS-CEU verfügbar ist, wird gegen „kleinste Stückelung“ und „kleinste übertragbare Einheit“ in WSS-CEU geprüft, oder sonst gegen „kleinste Stückelung“ und „kleinste übertragbare Einheit“ in WSS-WM.
- Das Settlement Date muss ein Bankarbeitstag sein.

Negative Validierungen haben die folgenden Fehlermeldungen zur Folge:

| Validierung   | Fehlermeldung   |
|---|---|
| Abweichung „Kleinste Stückelung“                                  | Stammdatendiskrepanz WM-CEU: -Kleinste Stückelung   |
| Abweichung „Mindestbetrag“  | Stammdatendiskrepanz WM-CEU: -Mindestbetrag   |
| Abweichung „Inkrement“  | Stammdatendiskrepanz WM-CEU: -Inkrement   |
| Abweichung „Verwahrart“   | Stammdatendiskrepanz WM-CEU: -Verwahrart  |
| Validierung „T2S confirmed Minimum Denomination“                  | NOM-URK darf nicht kleiner als der Mindestbetrag aus CEU-WSS sein   |
| Validierung „T2S confirmed Multiple Quantity“                     | NOM-URK nicht durch kleinstes Vielfaches aus CEU-WSS darstellbar  |
| Validierung „T2S confirmed Quantity Type“                         | Stammdaten-Diskrepanz WM-CEU: - Einheit Effektennotiz   |
| Validierung „Rahmennominale“                                      | RAHMENNOMINALE darf nicht kleiner dem Mindestbetrag in CEU-WSS sein<br>RAHMENNOMINALE nicht durch kl. Vielfache aus CEU-WSS darstellbar |
| Validierung „Security CSD Link“                                   | Kein aktiver Security CSD Issuer Link verfügbar   |
| Validierung „Settlement Date vs ValidFrom Date ISIN“              | Settlement-Day muss innerhalb Gültigkeitsfrist ISIN aus CEU-WSS liegen  |
| Validierung „Settlement Date vs ValidFrom Date Security CSD Link“ | Settlement-Day muss innerhalb Gültigkeitsfrist CSD Link liegen  |
| Validierung Settlement Date vs T2S Business Day                   | Settlement-Day ist kein T2S- / T2S-Business-Day   |
| Validierung „Kleinste Stückelung“ (old WM validation)             | NOM-URK muss ein Vielfaches der kleinsten Stückelung sein   |
| Validierung „kleinste übertragbare Einheit“ (old WM validation)   | NOM-URK muss ein Vielfaches d. kl. übertragbaren Einh. sein   |
| ISIN in CEU available and exists on T2S                           | Gattung (noch) nicht in CEU-WSS hinterlegt<br>Gattung ist (noch) nicht auf T2S vorhanden<br>Gattung in CEU-WSS gelöscht                 |

## 14 Hauptauswahlmenü CASCADE-Auftragsabwicklung

Durch Eingabe des Funktionscodes „CA“ im Einstiegsmenü „Funktionsangebot für den Bereich CEU – Inland“ wird das Hauptauswahlmenü „CASCADE“ Auftragsabwicklung aufgerufen:

```
TRAN: MENU FC:   SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG      H A U P T A U S W A H L
      ERFASSUNGSSTATUS      AUFTRAGSSTATUS
      EE  ERFASSUNG GIROBEREICH BANK      AM  MATCH-DIENST
      EW  ERFASSUNG WERTEBEREICH BANK      AS  SETTLEMENT-DIENST
      ED  ERFASSUNG CBF                    AI  INFORMATION/ONLINE-DRUCK
      EA  AENDERUNG/LOESCHUNG GIROBER.     AA  AENDERUNG/LOESCHUNG
      EB  AENDERUNG/LOESCHUNG WERTEBER.
      EI  INFORMATION/ONLINE-DRUCK         AN  NOTFALL-DIENST
                                          AB  BULK-PROCESSING
      EK  KONTROLLE GIROBEREICH
      EC  KONTROLLE WERTEBEREICH
KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus
```

Abbildung 14.1 Hauptmenü CASCADE Auftragsabwicklung

Leertaste

## 15 Erfassung von Aufträgen (EW)

Unter der Erfassung ist die Ersteingabe von Aufträgen in den Erfassungsstatus zu verstehen.

Kunden können zur Erfassung von Aufträgen für den Effektivbereich derzeit folgende Funktionscodes nutzen:

|    |  |
|----|--|
| EL | Laufende Einlieferung von Einzel- und techn. Sammelurkunden  |
| NV | Neuzulassung/Valutierung von Globalurkunden/Rahmenurkunden   |
| AL | Auslieferung von Einzel- und techn. Globalurkunden/Revalutierungen/Umliegungen/Globalurkunden und Jungscheinen |
| ES | Einlieferung Sonderverwahrung (nur für Sonderverwahr-Kunden)   |
| AS | Auslieferung Sonderverwahrung (nur für Sonderverwahr-Kunden)   |
| EF | Einlieferung Kundentresor (nur für Outsourcer-Kunden)  |
| AF | Auslieferung Kundentresor (nur für Outsourcer-Kunden)  |
| ET | Einlieferung Edelmetall (nur für Kunden die Edelmetall bei CEU hinterlegen)                                    |
| AT | Auslieferung Edelmetall (nur für Kunden die Edelmetall bei CEU hinterlegen)                                    |

Um die Erfassung bei einer Einlieferung zu vereinfachen, wurden mit Release 8 im Juni 2003 die Funktionalitäten für Neuzulassung/Aufstockung Globalurkunden (früher EN) und Valutierung Rahmenurkunde (früher EV) in einer neuen Funktion NV zusammengelegt. Damit kann jede dauerverbriefte Urkunde bzw. Rahmenurkunde eingeliefert werden. Außerdem ist es möglich, die Neuzulassung einer Rahmenurkunde mit einer gleichzeitigen Valutierung dieser Urkunde zu verknüpfen.

Die Funktionen „EF, AF, ES, AS, ET und AT“ stehen nur solchen Kunden zur Verfügung, die im Rahmen eines Outsourcings ihre Tresore an CEU übergeben haben. Die entsprechenden Funktionalitäten sind in einem separierten Benutzerhandbuch beschrieben, das aber nur für die entsprechenden Outsourcer-Kunden zur Verfügung gestellt wird. Die Funktion SV ist den Mitarbeitern von CEU vorbehalten und kann von Kunden nicht beantragt werden.

### **Nähere Auskünfte zu den Möglichkeiten der Sonderverwahrung im CEU-Tresor erteilt der Clearstream CSD Client Services Core Products and Connectivity.**

Ausgehend von dem Hauptauswahlmenü der CASCADE-Auftragsabwicklung gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes „EW“ zum Auswahlmenü der Erfassung für den Wertebereich Bank:

| TRAN: KVEW FC: SB: |  | E R F A S S U N G |              | WERTEBEREICH | BANK | ERFASSUNGSSTATUS     |
|--------------------|--|-------------------|--------------|--------------|------|----------------------|
|                    | CEU-TRESOR   |                   |              |              |      | KUNDENTRESOR BEI CEU |
| EL                 | LAUFENDE EINLIEFERUNG VON<br>EINZEL- UND TECHN. SAMMELURKUNDEN | EF                | EINLIEFERUNG | FREMDTRESOR  |      |                      |
|                    |  | AF                | AUSLIEFERUNG | FREMDTRESOR  |      |                      |
| NV                 | NEUZULASSUNG / VALUTIERUNG<br>GLOBALURKUNDEN / RAHMENURKUNDEN  | ES                | EINLIEFERUNG | SONDERVERW.  |      |                      |
|                    |  | AS                | AUSLIEFERUNG | SONDERVERW.  |      |                      |
| AL                 | AUSLIEFERUNG<br>NEUZULASSUNG (OHNE URKUNDE)                    | ET                | EINLIEFERUNG | EDELMETALL   |      |                      |
|                    |  | AT                | AUSLIEFERUNG | EDELMETALL   |      |                      |
| SV                 | NEUZULASSUNG ÖFFENTLICHE ANLEIHE                               |                   |              |              |      |                      |

Abbildung 15.1 Erfassung von Aufträgen

## 15.1 Erfassung von Aufträgen zur laufenden Einlieferung von Wertpapieren (EL)

Folgende Aufträge werden hier erfasst:

- Laufende Einlieferungen von Einzelurkunden mit Einzel- und Verbundnummern
- Laufende Einlieferungen von technischen Sammelurkunden
- Laufende Einlieferung als Urkundenumtausch von Einzelurkunden
- Laufende Einlieferungen als Urkundenumtausch von technischen Sammelurkunden

Die Einlieferungen der Urkunden bei der CEU erfolgen in den Verfahren

- Einzel- bzw. Sammeleinlieferung per Bankboten
- Sammeleinlieferung im Container
- Einlieferung per Wertpost

Die Daten für einen zu erfassenden Einlieferungsauftrag in der CASCADE-Anwendung setzen sich wie folgt zusammen:

- Buchungsrelevante Auftragsdaten (Basismaske)
- Weitere wertpapierrelevante Folgedaten (Folgemaske 1)
- Stücknummern (Folgemaske 2)
  - für Einzelurkunden oder
  - für technische Sammelurkunden

Die Erfassung des Einlieferungsauftrages ist unabhängig vom gewählten Einlieferungsverfahren.

Nach Eingabe des Funktionscodes „EL“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird die Maske zur Erfassung der Auftragsdaten zur Verfügung gestellt.

### 15.1.1 Direktive 2014/91/EU

Seit 18. März 2016 sind in Deutschland rechtliche Aktualisierungen wirksam, um Anforderungen der Direktive 2014/91/EU zu erfüllen.

Durch diese Aktualisierungen werden Inhaberanteile von Investment Fonds für ungültig erklärt, wenn sie nicht zum 31. Dezember 2016 girosammelverwahrt sind. Weiterhin dürfen Inhaberanteile, die girosammelverwahrt sind, ab 1. Januar 2017 nicht aus der Girosammelverwahrung physisch ausgeliefert werden.

Somit, um menschliches Versagen und folgende, rechtliche Konsequenzen für CEU und Dritte zu vermeiden, muss CEU eine technische Lösung bereitstellen, die jegliche physische Auslieferung von Einzelurkunden aus der Girosammelverwahrung unterbindet. Gründe hierfür sind, dass physische Zertifikate, die ab 1. Januar 2017 aus der Girosammelverwahrung ausgeliefert werden, ungültig werden und auch nicht mehr im Treuhänder-Konto der Verwahrstelle verwahrt werden (als gesetzliche Anforderung).

Betroffene ISINs können über den Wert 5000 im WSS-Feld GD198B identifiziert werden.

Die physische Lieferung von Festbetrag-Globalurkunden und/oder Rahmenurkunden BisZu in oder aus der Girosammelverwahrung bleibt bestehen.

Tatsächlich sperrt die technische Lösung alle Bestände in Einzelurkunden von Fonds für die physische Lieferung, inklusive Umlegung zwischen Girosammelverwahrung und Vorratslager.

Die technische Lösung sperrt auch alle Bestände in Einzelkunden von Fonds für die Umlegung zwischen Girosammelverwahrung und Fremdtresor.

Die technische Lösung für Einlieferungs-Aufträge wird zum 1. Januar 2017 wirksam. Für Auslieferungs-Aufträge hingegen ist die technische Lösung bereits wirksam.

### 15.1.2 Buchungsrelevante Auftragsdaten

#### (A) Allgemeine Beschreibung

Die buchungsrelevanten Auftragsdaten enthalten alle Informationen, die notwendig sind, um den Einlieferungsauftrag bei der CEU buchen zu können.

#### (B) Eingabemaske buchungsrelevanter Auftragsdaten

```

TRAN: KVEW FC: EL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / EINZELERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                        LFD.EINLIEFERUNG
PRIMANOTE: ____        AUFTNR: _____        HLG: 01 GS

LAST-KTO : ____ ____
GUT-KTO  : ____ ____
WKN      : I _____

NOMINALE :                EINHEIT:          ST-ART:
NOM-URK  :                EINLIEF-ART : 1    LFD. EINLIEFERUNG
                        EINLIEF-GRUND: ____

KUNDENREFERENZ          : ____ - _____ - _____        KZ-BST: ____
EINLIEFERUNG-VON NAME: _____
ADRESSE: _____

BEARB-STATUS:

KV005I      Funktion beendet, bitte wählen Sie aus
    
```

Abbildung 15.2 Eingabemaske buchungsrelevanter Auftragsdaten

**(C) Felddesonderheiten**

Bei der Erfassung buchungsrelevanter Daten für eine Einlieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

| Feld           | vorbelegt mit:                      | Beschreibung   |
|----------------|-------------------------------------|--|
| AUFTNR         |                                     |  |
| HLG            | „01“ (GS)                           | Girosammelverwahrung   |
| EINLIEF-ART    | „1“                                 | laufende Einlieferung  |
| LAST-KTO       | interne Kontonummer der CEU         | Tresorkontonummer  |
| GUT-KTO        | Bank-Nr. des erfassenden Institutes |  |
| WKN-KENNUNG    | „I“                                 | ISIN   |
| WKN            |                                     |  |
| NOMINALE       |                                     | Buchungsnominale   |
| NOM-URK        |                                     | Summe aus Anzahl Urkunden je Stückelung bei nicht in EURO umgestellten WKN/ISIN. Weicht ab von Nominale. |
| KUNDENREFERENZ |                                     |  |
| GIT-DRITTBANK  |                                     |  |
| KZ-BEST        | „HB“                                | „Hauptbestand“, nur bei Namensaktie (RS)   |

Neben der allgemeingültigen Felddescription (siehe [Allgemeingültige Felddescriptions und Formalprüfungen](#) auf Seite 10-1) gelten bei der Erfassung der buchungsrelevanten Auftragsdaten für eine laufende Einlieferung folgende Felddesonderheiten:

| Feld          | Beschreibung  |
|---------------|---|
| PRIMANOTE     | Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.  |
| AUFTNR        | Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7.000.000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Kunden (Eingeber) darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus und in den CEU internen Prüfstellen kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.  |
| GUT-KONTO     | Niederlassungen können nur Einlieferungen zugunsten der Zentrale tätigen.(Reg-Über-Bedingungen).  |
| EINLIEF-GRUND | Das Feld kann bei Neuzulassung und Valutierung wie folgt belegt werden: <ul style="list-style-type: none"> <li>• „1“ aus Emission:<br/>Wird belegt, wenn die effektiven Urkunden neu emittiert eingeliefert werden.</li> <li>• „5“ Urkundenumtausch:<br/>Hier findet eine Prüfung auf doppelte Stückenummern zunächst nur im CASCADE-Erfassungs- und Auftragsstatus statt. Die endgültige Prüfung obliegt der CEU.</li> </ul> |

## (D) Abhängigkeitsprüfungen

### LAST-KTO/GUT-KTO

Last-Konto und Gut-Konto dürfen nicht gleich sein.

Entspricht das Gut-Konto einem Kundenkonto Spezialabwicklung, dann muss es sich beim Last-Konto ebenfalls um ein Tresorkonto Spezialabwicklung handeln.

### GUT-KTO/USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen. Filialen können nur zu Gunsten der Zentrale erfassen (ausgenommen, wenn es sich bei dem Gut-Konto um die Konto-Art zum 'Einrichten von Teilbeständen nur Kundenbestand' handelt).

### GUT-KTO/HLG

Entspricht das Gut-Konto einem internationalen Partner der CEU, ist nur die Hinterlegungsart 01 = Girosammelverwahrung erlaubt.

### GUT-KTO/LAST-KONTO/HLG

Handelt es sich beim Gut-Konto um ein Kundenkonto aus dem Bereich Treuhand/Vorratslager/Rückgabe für Fonds, so muss das Last-Konto diesem entsprechen und als Hinterlegungsart ist nur (GS-) Vorratslager Bank (03) möglich.

Ist die HLG 20, dann muss das Lastkonto die Kontoart 261 haben.

### GUT-KTO/EINLIEFERUNG-VON NAME

Entspricht das Gut-Konto einem internationalen Partner der CEU = OEKB, EUROCLEAR FRANCE, NECIGEF, CBL oder SIS, wird der Einlieferung-von-Name automatisch eingeblendet bzw. überschreibt den vorhandenen Text.

### NOMINALE/NOM-URK

Einlieferung: bei Angaben im Feld Nominale (= Buchungsnominale) wird die mögliche Nominale (NOM-URK) nach Stückelung und Urkundennominale systemseitig ermittelt. Wird das Feld Nominale-Urkunde gefüllt, wird systemseitig das Feld Nominale ermittelt und gefüllt. Werden beide Felder gefüllt, werden systemseitig die Inhalte geprüft.

### WKN/HLG

- In der HLG 01 sind nur GS-Gattungen erlaubt, die nicht WWM 96 oder 97 sind.
- In der HLG 03 sind nur GS-Gattungen erlaubt, die nicht WWM 96 oder 97 sind.
- In der HLG 20 gibt es keine Einschränkungen.
- In der HLG 21 sind nur Gattungen in der Verwahrart STR erlaubt.
- HLG 30 ist nicht für CEU-Tresor erlaubt (siehe Benutzerhandbuch Fremdtresor).

### WKN/KZ-BESTAND/KUNDENREFERENZ

Bei Einlieferung von Namensaktien (RS) ist dieses Feld mit dem entsprechenden Bestandskennzeichen „FM“ – Freier Meldebestand oder „HB“ – Hauptbestand zu pflegen. Bei HB ist das Feld Kundenreferenz ebenfalls zu bearbeiten.

### EINLIEF-GRUND/GUT-KONTO

Handelt es sich beim Gut-Konto um ein „frei verfügbares Konto“, dann muss der Einlieferungsgrund 5 (Urkundenumtausch) sein.

### ISIN/EINLIEF-GRUND

## NOM-URK /RAHMEN-NOM/EINLIEF-GRUND

- Für EINLIEF-GUND = 11 muss die NOM-URK gleich der RAHMEN-NOM und größer „0“ sein.
- Für EINLIEF-GRUND = 12 muss die RAHMEN-NOM größer „0“ sein und die NOM-URK muss gleich „0“ sein.

## EINLIEF-GRUND/ORD-NR

- Bei EINLIEF-GRUND = 11 muss die ORD-NR immer ungerade sein.
- Bei EINLIEF-GRUND = 12 muss die ORD-NR immer gerade sein.

### 15.1.3 Wertpapierrelevante Folgedaten

#### (A) Allgemeine Beschreibung

Für die korrekte Bearbeitung und Abwicklung eines Einlieferungsauftrages müssen neben den buchungsrelevanten Informationen noch weitere wertpapierspezifische Daten im Auftrag erfasst werden. Dazu wird nach der Verarbeitung der buchungsrelevanten Auftragsdaten auf eine Folgemaske verzweigt.

#### (B) Folgemaske wertpapierrelevanter Daten

|   |                               |                                   |
|---|-------------------------------|-----------------------------------|
| TRAN: KVEW FC: EL SB:   |                               |                                   |
| AUFTRAGSABWICKLUNG  | EINLIEFERUNG / FOLGEERFASSUNG | ERFASSUNGSSTATUS                  |
|   | LFD.EINLIEFERUNG              |                                   |
| AUFTNR: 653000  |                               | WKN: I DE0007224008<br>HLG: 01 GS |
| VERWAHR-MOEGlichkeit  | : 9 GIROSAMMELVERW.           |                                   |
| BESONDERHEIT  | : _____                       |                                   |
| ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG   | : 0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG    |                                   |
| NAECHSTER KUPON/LEG   | : 20                          | LETZT. KUP/LEG : 20               |
| UEBERF KUPON/LEG  | VON : _____                   | BIS : _____                       |
| NACHWEISART: 1 EINLIEF. EFF. URK.                                     |                               | SAMMELURKUNDE : N (J/N)           |
| TEXT: _____   |                               |                                   |
| -- ID-KZ: 7907123444 -- PW: ----- B79074P4 -- 01/07/19 -- 09:00:00 -- |                               |                                   |
| PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Vor PF7:Zurück                |                               |                                   |

Abbildung 15.3 Folgemaske wertpapierrelevanter Daten

**(C) Felddesonderheiten**

Bei der Erfassung der wertpapierrelevanten Folgedaten gelten folgende Besonderheiten:

| Feld                    | vorbelegt mit:  |
|-------------------------|---|
| PRIMANOTE               | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.   |
| AUFTRNR                 | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.   |
| WKN                     | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.   |
| HLG                     | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.   |
| LETZTER KUPON           | Vorbelegung durch Wertpapierstammdaten. Bei Optionsscheinen wird dieses Feld als letzter LEG-SCHEIN angesetzt                     |
| NACHWEISART             | „1“ (Einlieferung effektiver Urkunden)<br>„4“ (Einlieferung ohne Urkunden-Rahmenvertrag RS)<br>„5“ (Einlieferung mit Urkunden RS) |
| SAMMELURKUNDE           | „N“   |
| ABWEICHENDE BEZEICHNUNG | 0 (kein Eintrag)  |

Neben der allgemeingültigen Felddescription (siehe [Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen](#) auf Seite 10-1) gelten bei der Erfassung der wertpapierrelevanten Folgedaten für eine lfd. Einlieferung folgende Felddesonderheiten:

| Feld                        | Beschreibung  |
|-----------------------------|---|
| NÄCHSTER KUPON/<br>NÄCHSTER | Die Eingabe für dieses Feld wird gegen die zum Wertpapier gespeicherten.  |
| LEG-SCH                     | Informationen geprüft und entsprechend belegt. Bei Renten erfolgt eine Datumsprüfung, bei Aktien eine numerische und bei Optionsscheinen erfolgt eine alphanumerische Prüfung (LEGSCHEIN).  |
| SAMMELURKUNDE               | Es sind folgende Eingabekombinationen in Verbindung mit den folgenden Verwahrmöglichkeiten zugelassen: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Girosammelverwahrung (GS) effektiv</li> <li>• GS-Verwahrung, Stückelos (nur in Form von CF-Stücken lieferbar)</li> <li>• Eingeschränkte Girosammelverwahrung</li> </ul> Kombinationen: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Laufende Einlieferung effektiver GS-Gattungen mit Einzelurkunden: Mit Kennzeichen Sammelurkunde „N“ für „Nein“ und Einlif-Grund = keine Eingabe.</li> <li>• Laufende Einlieferung als Urkundenumtausch von Einzelurkunden</li> <li>• Mit Kennzeichen Sammelurkunde auf „N“ für „Nein“ und Einlif-Grund = 5 für Urkundenumtausch.</li> <li>• Laufende Einlieferung als technische Sammelurkunde</li> <li>• Mit Kennzeichen Sammelurkunde auf „J“ für „Ja“ und Einlif-Grund = keine Eingabe.</li> <li>• Laufende Einlieferung als Urkundenumtausch von Sammelurkunden</li> <li>• Mit Kennzeichen Sammelurkunde auf „J“ für „Ja“ und Einlif-Grund = 5 für Urkundenumtausch.</li> </ul> |

## (D) Abhängigkeitsprüfungen

### WKN/BESONDERHEIT

Für Einzelurkunden sind nachfolgende Besonderheiten erlaubt:

- 2 (bogenlos)
- 3 (nur Mantel, kein Bogenausdruck)
- 4 (Einzelkunde Mantel/Globalbogen)
- 5 (Mantel, Bogen, Zession (für RS))
- 6 (Mantel, Talon, Zession (für RS))
- 9 (Einzelkunde, Globalmantel/Einzelbogen)
- 11 (Alte Urkunden)
- 20 (Technische Globalurkunde mit Bogen; manuell erstellt)
- 21 (Technische Globalurkunde ohne Bogen; manuell erstellt)
- 22 (Technische Globalurkunde mit Bogen; lieferbar)
- 23 (Technische Globalurkunde ohne Bogen; lieferbar)
- 27 (Festschreibung)

Für Sammelurkunden sind nachfolgende Besonderheiten zulässig:

- 15 (Nur Mantel)
- 16 (Unikat)
- 17 (Unit)
- 20 (Technische Globalurkunde mit Bogen, manuell erstellt)
- 21 (Technische Globalurkunde ohne Bogen, manuell erstellt)
- 22 (Technische Globalurkunde mit Bogen, lieferbar)
- 23 (Technische Globalurkunde ohne Bogen, lieferbar)
- 24 (Mit Bogen)
- 25 (Ohne Bogen)
- 26 (JSG ohne Bogen)
- 28 (Nur Bogen)
- 40 (Kein Zinsschein/Talon)
- 41 (Nur Talon)
- 47 (IGL mit Bogen)
- 48 (IGL ohne Bogen)
- 49 (Jungschein mit Bogen)
- 52 (Dauerglobalurkunde mit Bogen)
- 53 (Dauerglobalurkunde ohne Bogen)
- 54 (Rahmenurkunde mit Bogen)
- 55 (Rahmenurkunde ohne Bogen)
- 56 (Globalbonds mit Bogen)
- 57 (Globalbonds ohne Bogen)

Bei der Auftragserteilung von Neuzulassungen über die CASCADE Transaktion KVEW NV wird das Feld „Besonderheit“ unter den unten aufgeführten Bedingungen vorbelegt.

- Bei Valutierungen (Einlieferungsart 5) ist das Feld nicht eingebbar und wird auch nicht vorbelegt.
- Globalbonds (KV-Lagerland = 998) werden mit der Besonderheit 57 „Globalbonds ohne Bogen“ vorbelegt.
- RS-Gattungen werden je Verwahrmöglichkeit wie folgt mit der Besonderheit vorbelegt:
  - VWM 14: Vorbelegung mit Besonderheit 55 „Rahmenurkunde ohne Bogen“
  - VWM 15: Vorbelegung mit Besonderheit 48 „IGL ohne Bogen“
  - VWM 16: Vorbelegung mit Besonderheit 23 „technische Globalurkunde ohne Bogen lieferbar“
- Für Lieferungen in der Einlieferungsart 2 gelten folgende Regeln:
  - VWM 1, 2: Vorbelegung mit Besonderheit 26 „Jungschein ohne Bogen“
  - VWM 5: Vorbelegung mit Besonderheit 48 „IGL ohne Bogen“
  - VWM 9, 16: Es erfolgt keine systemseitige Vorbelegung. Das Feld Besonderheiten wird durch die CEU-Prüfstelle ergänzt.
- Sonstige VWM: Vorbelegung mit Besonderheit 53 „Dauerglobalurkunde ohne Bogen“
- Lieferungen in der Einlieferungsart 3 und 4 unterliegen folgenden Regeln:
  - VWM 9, 16: Vorbelegung mit Besonderheit 23 „technische Globalurkunde ohne Bogen“
  - VWM 1,2: Vorbelegung mit Besonderheit 26 „Jungschein ohne Bogen“
  - VWM 5, 15: Vorbelegung mit Besonderheit 48 „IGL ohne Bogen“

Ausnahmen sind WKN/ISIN mit den Stückarten „Nur Mantel“ und „Unikat“. Bei WKN/ISIN mit der Stückart „Nur Mantel“ können die Besonderheiten 21 und 23, bei WKN/ISIN mit der Stückart „Unikat“ können die Besonderheiten 20 und 22 eingegeben werden. Für RS-Gattungen sind nur die Besonderheiten 5 und 6 erlaubt.

Für CEU-Kunden, die zur Auftragserteilung den eMission-Service nutzen und somit keine Möglichkeit der Spezifizierung von Besonderheiten haben, wird gemäß den o. a. Bedingungen vorbelegt.

GUT-KTO/ÜBERFÄLLIGER KUPON BIS

Die Eingabe für in dem Feld überfälligen Kupon ist nur durch CEU möglich.

NACHWEISART/WKN

Wenn es sich bei der einzuliefernden WKN um eine RS-Gattung handelt, dann ist nur die Nachweisart 4 und 5 erlaubt, ansonsten die Nachweisarten 1, 2, 3.

### 15.1.4 Folgedaten Stücknummern

#### (A) Allgemeine Beschreibung

Zur vollständigen Auftragserteilung ist es notwendig, die zugehörigen Stücknummern der einzuliefernden Urkunden im Auftrag anzugeben. Zur Erfassung und Bearbeitung dieser Daten steht eine zweite Folgemaske zur Verfügung.

**Hinweis:** Die Eingabe und Bearbeitung der Stücknummern ist in Kapitel [Stücknummern](#) auf Seite 11-1 detailliert beschrieben. Innerhalb der Erfassung der Stücknummern muss bei wechselnder

- Stückelung
- Schrittweite und/oder

die Bildschirmseite gewechselt werden.

Vor diesen Wechseln müssen die bereits erfassten Daten mit der Taste PF6 abgespeichert werden.

### (B) Folgemaske Stückenummern für Einzelurkunden

```

TRAN: KVEW FC: EL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / STUECKEERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                        LFD.EINLIEFERUNG
AUFTNR      :      653000      GES-NOM      :      1.000
WKN         : I DE0007224008      ANZ-URK:      SUMME-NOM:
STCKL       :      _____      SCHRIITWEITE: _____

KZ STUECKENUMMERN      MAN MAN E
                        GEL GEL
_ 4551-600 _____      _____
_ _____      _____
_ _____      _____
_ _____      _____
_ _____      _____
_ _____      _____
_ _____      _____
_ _____      _____
_ _____      _____
_ _____      _____
_ _____      _____

-- ID-KZ: 7907123444 -- PW:      ----- B79074P4 -- 01/07/19 -- 09:00:00 --
EA0005I Verarbeitung der vorherigen Seite durchgeführt
PF4:Abbruch

```

Abbildung 15.4 Folgemaske Stückenummern für Einzelurkunden

#### Eingebbare Kennzeichen (KZ):

- „L“ - Löschung einer Stückenummer/Nummernfolge
- „N“ - Änderung einer Stückenummer
- „M“ - Änderung der Mängelgründe von Stückenummern/Nummernfolgen
- „E“ - Ersatzurkunde

#### Stückenummern - Oppositionsprüfung

Aufträge, die im CASCADE-Erfassungs- bzw. Auftragsstatus stehen, unterliegen täglich zusätzlich einer abendlichen Oppositionsprüfung. Dabei kann es passieren, dass eine Stückenummer in einem Auftrag als oppositionsbelegt gefunden wird. Beim Aufruf der auftragsrelevanten Daten eines solchen Auftrages informiert CASCADE, um wie viele oppositionsbelegte Stücke es sich handelt. In diesem Stadium kann der Auftrag nicht kontrolliert werden. Über die Informationsdienste können die entsprechenden Stückenummern ermittelt und danach über die Änderungsfunktion bearbeitet werden.

Darüber hinaus werden alle mit Opposition belegten Stücke, die sich im CASCADE-Erfassungsstatus befinden bzw. aus dem Auftragsstatus dorthin generiert wurden, in einer Oppositionsliste ausgewiesen.

Die Kennzeichnung einer Stückenummer als Ersatzurkunde ist nur möglich, wenn zu diesem Stück keine Oppositionsmeldung oder eine Meldung mit Oppositionsgrund 3 (Kraftloserklärung Aufgebot) vorliegt. Anderenfalls (Meldung mit Oppositionsgrund ungleich 3) wird die Eingabe eines „E“ mit entsprechendem Fehlerhinweis abgelehnt. Über die tägliche abendliche Oppositionsverarbeitung können Stückenummern aus Einlieferungsaufträgen aufgrund neuer Meldungen nachträglich mit

Oppositionen gekennzeichnet werden. Handelt es sich bei dem eingelieferten Stück jedoch tatsächlich um die Ersatzurkunde, so kann dies über die Änderungsfunktionen korrigiert werden, sofern die Stückenummer mit Oppositionsgrund C belegt ist. Durch Eingabe eines „M“ im Feld KZ und „E“ wird diese Oppositionskennzeichnung der Stückenummer zurückgenommen und das Kennzeichen für Ersatzstück eingestellt.

War der Einlieferungsauftrag zum Zeitpunkt der Oppositionsverarbeitung bereits gebucht, dann besteht diese Möglichkeit jedoch nicht mehr. Der Auftrag kann nur noch gelöscht oder durch CEU vereinnahmt werden, wobei die Oppositionsstücke auch nach CARAD übergeleitet werden.

Stückenummern, bei denen CASCADE feststellt, dass sie bereits (doppelt) erfasst sind, werden mit dem Hinweis abgelehnt, dass systemseitig eine Suche veranlasst wird. In diesem Fall unterrichtet der Kunde die CEU per FAX über Gattung, Stückelung und Stückenummern. Bei einem Urkundenumtausch erfolgt die endgültige Prüfung auf doppelte Stückenummern bei der CEU.

### (C) Felddesonderheiten

Bei der Erfassung der Stückenummern zu einer Einlieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

| Feld         | vorbelegt mit:   |
|--------------|--|
| SCHRITTWEITE | Beim ersten Einstieg mit 1, ansonsten wird sie aus der vorherigen Stücke-Erfassung übernommen. |
| STÜCKELUNG   | Wird aus der vorherigen Stücke-Erfassung übernommen.   |

Neben der allgemeingültigen Felddescription (siehe [Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen](#) auf Seite 10-1) gelten bei der Erfassung von Stücke-Besonderheiten für eine Wertpapiereinlieferung folgende Felddesonderheiten:

| Feld         | Beschreibung   |
|--------------|--|
| PRIMANOTE    | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.  |
| AUFTRAGSNR   | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.  |
| WKN          | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.  |
| MANGEL 1     | Die Angabe von Oppositionsgründen ist nicht möglich.   |
| MANGEL 2     | Die Angabe von Oppositionsgründen ist nicht möglich.   |
| ERSATZSTÜCK  | Es kann „E“ für Ersatzstück eingegeben werden  |
| STÜCKELUNG   | Sind Stückenummern mit Litera-Kennung zu erfassen, so ist diese in dem dafür vorgesehenen Bereich im Feld „Stückelung“ einzugeben. Dabei sind maximal 10 Stückelungen pro Auftrag zulässig. In CASCADE werden die Stückelungen automatisch in absteigender Reihenfolge gespeichert. Die Einlieferung der zugehörigen Urkunden muss dieser Vorgabe entsprechen. Innerhalb einer Stückelung ist die Reihenfolge der Eingabe maßgebend. |
| SUMME-NOM    | Wird mit der Nominale der bereits insgesamt erfassten Stücke belegt.   |
| SCHRITTWEITE | Es können auf einer Maske nur Stückenummern mit derselben Schrittweite erfasst werden.   |

| Feld                       | Beschreibung  |
|----------------------------|---|
| FLIEßTEXT<br>STÜCKENUMMERN | Die Eingabe der Stückenummern muss in der Reihenfolge vorgenommen werden, in der die Urkunden bei der CEU effektiv eingeliefert werden außer bei Verbundnummern. Spitzen mit mehr als 99 Stückenummern werden vom System als „100er- Päckchen“ mit „Punkt/Stern“ angezeigt. Namen und Bezeichnungen, die die Stückenummern beschreiben (z. B. „Nr.“), gehören nicht zur Stückenummerneingabe. Die Angabe von führenden Nullen ist möglich, aber nicht zwingend. Trennungszeichen wie Blank („ “), Komma (,), Bindestrich (-), Hochkomma ('), Schrägstrich (/) innerhalb einer Stückenummer auf der Urkunde sind nicht anzugeben. Bei Nummernkreisen und Globalurkunden darf die Bis-Nr. nur aus dem Teil der Nummer bestehen, der sich von der Von-Nr. unterscheidet. |

### (D) Abhängigkeitsprüfungen

#### STÜCKELUNG/VERWAHR-MÖGLICHKEIT

Für alle Verwahrarten, ausgenommen

- Eingeschränkte Girosammelverwahrung, Interimistische Globalurkunde (IGL)
- Eingeschränkte Girosammelverwahrung Einzelurkunden
- Eingeschränkte Girosammelverwahrung Dauerglobalurkunde (SVG)

gilt, dass die eingegebene Stückelung zur Wertpapierkennnummer mit der eingegebenen Litera vorhanden sein muss. Handelt es sich bei der Einheit der Effektennotiz um % oder ‰, dann wird die Stückelung- Nominale geprüft.

#### MANGEL 1/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Ein Mangel 1 kann nur dann eingegeben werden, wenn in der entsprechenden Textzeile mindestens eine Stückenummer erfasst wurde.

#### MANGEL 2/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Ein Mangel 2 kann nur dann eingegeben werden, wenn in der entsprechenden Textzeile mindestens eine Stückenummer erfasst wurde.

#### MANGEL 1/MANGEL 2

Bei Eingabe von Mangel 1 und Mangel 2 in einer Textzeile müssen die Inhalte der beiden Mängel unterschiedlich sein.

#### ERSATZSTÜCK/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Ein Ersatzstück kann nur dann eingegeben werden, wenn in der entsprechenden Textzeile mindestens eine Stückenummer erfasst wurde.

#### ERSATZSTÜCK/WKN/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Handelt es sich bei der eingegebenen WKN/ISIN um ein Bezugsrecht, so ist die Kennzeichnung als Ersatzstück nicht erlaubt. Wird auf der Folgemaske wertpapierrelevanter Daten im Feld Sammelurkunde „J“ eingegeben, wird folgende Maske angezeigt:

**(E) Folgemaske Stückenummern für technische Sammelurkunden**

```

TRAN: KVEW FC: EL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / STUECKEERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                        LFD. EINLIEFERUNG - SAMMELURKUNDE
AUFTNR      :      653000                      GES-NOM      :      1.000
WKN          : I DE0007224008      ANZ-URK:      SUMME-NOM:
                        SCHRITTWEITE: _____
SERIEN-WKN: I                                ORD-NR       :
KZ ANZAHL   LIT      STUECKLUNG STUECKENUMMERN (VERBRIEFTE URKUNDEN)  E/O

-----

-- ID-KZ: 7907123444 -- PW:      ----- B79074P4 - 01/07/19 -- 09:00:00 --
EA0005I Verarbeitung der vorherigen Seite durchgeführt
PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 15.5 Folgemaske Stückenummern für technische Sammelurkunden

Das Feld E/O ist in den Erfassungs- und Änderungsfunktionen für die Eingabe der Ersatzstückkennzeichnung vorgesehen. Die Plausibilitäten für die Einlieferung von Ersatzstücken bei Sammelurkunden stimmen mit denjenigen für Einzelurkunden überein.

**Hinweis:** Die Eingabe und Bearbeitung der Stückenummern ist in Kapitel Die Stückenummern, detailliert beschrieben. Pro CASCADE-Auftrag kann nur eine Sammelurkunde eingegeben werden. Die Eingabe von Stückenummern bei der lfd. Einlieferung von technischen Sammelurkunden ist nicht zwingend, wenn es sich bei der WKN/ISIN um ein Wertpapier der Wertpapierklasse „I“ Fonds handelt. In allen anderen Fällen müssen Stückenummern eingegeben werden.

Die Ordnungsnummer dient zur eindeutigen Identifikation von Sammelurkunden und kann für Sammel-Urkunden eingegeben werden.

### 15.1.5 Änderung Kennzeichen SAMMELURKUNDE (J/N)

Wenn innerhalb eines Einlieferungs-Auftrages irrtümlich eine Sammelurkunde anstelle von Einzelurkunden (oder umgekehrt) erfasst wurde, dann ist es möglich, das Kennzeichen SAMMELURKUNDE J/N zu ändern, ohne den gesamten Auftrag löschen zu müssen. Um dieses Kennzeichen ändern zu können, ist es allerdings erforderlich, zuerst die erfassten Stückenummern bzw. die ggfs. erfasste Ordnungsnummer zu löschen. Nach erfolgter Änderung des Kennzeichens können die Stückenummern dann direkt wieder erfasst werden.

## 15.2 Erfassung Neuzulassung/Valutierung (NV)

Für Gattungen mit folgenden Verwahrmöglichkeiten ist eine Neuzulassung mit und ohne gleichzeitiger Valutierung möglich:

- Interimistische Globalurkunde als Rahmenurkunde (BIS-ZU)
- Dauer-Globalurkunde als Rahmenurkunde (BIS-ZU)
- Technische Globalurkunde als Rahmenurkunde (BIS-ZU)
- Jungschein (BIS-ZU)

Die Daten für eine zu erfassende Neuzulassung/Valutierung in der CASCADE-Anwendung setzen sich wie folgt zusammen:

- Buchungsrelevante Auftragsdaten (Basismaske)
- Weitere wertpapierrelevante Folgedaten (Folgemaske 1)
- Stücknummern (Folgemaske 2) für Sammelurkunden

Nach Eingabe des Funktionscodes „NV“ in das Erfassungs-Auswahlménü und anschließender Datenfreigabe wird die Maske zur Erfassung der Auftragsdaten zur Verfügung gestellt.

### 15.2.1 Berechtigungsprüfung bei Valutierung

Bei Valutierung wird systemseitig geprüft, dass auf der Kundenseite nur die Bank (Kontostamm) angegeben wird, die als emissionsbegleitendes Institut bzw. Zahlstelle der Gattung zugelassen ist. Gleichzeitig muss die auf der Kundenseite angegebene Bank Erfasser des Auftrags sein. Die Valutierungen, für die die Berechtigungsprüfung relevant ist, sind durch die Wertpapiergruppen festgelegt.

Diese Wertpapiergruppen sind der Tabelle „Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung“ aus dem Anhang zu entnehmen.

Auswirkungen:

- Bei Erfassung/Änderung/Kontrolle/LIMA-Einstellung/Überleitung einer Valutierung wird geprüft, ob die Bank auf der Kundenseite als „Emissionsbegleitendes Institut“ im WP-Stamm in WSS eingetragen ist. Ist das Feld leer, wird gegen die Zahlstelle geprüft. Falls die Bank weder als „Emissionsbegleitendes Institut“ noch als Zahlstelle hinterlegt ist, führt dies zur Ablehnung des Auftrags im entsprechenden Bearbeitungsvorgang.
- Dabei ist zu beachten, dass auch die Clearstream berechtigt ist, für das emissionsbegleitende Institut bzw. für die Zahlstelle entsprechende Aufträge zu erfassen.

Falls von WM neue WP-Gruppen veröffentlicht werden, die nicht in der Tabelle [Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung](#) auf Seite 29-1 enthalten sind, dann werden Aufträge für Gattungen mit diesen WP-Gruppen automatisch für die „manuelle Bearbeitung durch die Prüfstelle“ zugelassen.

In der Tabelle [Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung](#) auf Seite 29-1 sind diejenigen WP-Gruppen enthalten, die nicht für Valutierung/Revalutierung zugelassen sind.

## 15.2.2 Autom. Buchungsfreigabe Valutierung

Valutierungen werden für bestimmte Gattungen zur Buchung nicht mehr standardmäßig von den CEU-Prüfstellen bearbeitet, sondern direkt mit der Kontrolle (Vollanzeige/Kurzanzeige) gebucht. Dies ist möglich, da für diese ebenfalls eine automatische Prüfung auf Berechtigung durchgeführt wird. Die Definition ist analog der für die Berechtigungsprüfung (Definition siehe entsprechendes Kapitel im Anhang).

Mit der automatischen Freigabe obliegt die genauere fachliche Prüfung der bearbeitenden Bank. Sollte diese erst nach der Buchung einen Fehler feststellen, gibt es zwei Möglichkeiten, die Falschbuchung wieder rückgängig zu machen:

- Zum einen kann die Bank sich mit CEU in Verbindung setzen, damit durch CEU ein entsprechender Storno veranlasst wird. Verbunden mit einem Storno über die Auftragsart 99 ist die manuelle Korrektur des CARAD-Bestandes (Verminderung/Erhöhung der Nominale mit ggf. Neuerfassung der Stückenummern).
- Zum anderen kann die Bank selbst einen Gegenauftrag erteilen oder durch CEU erteilen lassen. Bei der Korrektur einer falsch gebuchten Valutierung mit Stücken mittels Revalutierung kann allerdings kein Anspruch darauf erhoben werden, dass die gleichen Stückenummern ausgeliefert werden, die fälschlicherweise eingeliefert wurden.

In der Disposition abgelehnte Valutierungen werden nach 90 BA, fällige Revalutierungen nach 40 BA aus dem Auftragsstatus gelöscht, sofern diese Aufträge noch keine Eingangsbuchnummer erhalten haben. Die Valutierungsaufträge werden für Gattungen, die für die automatische Buchungsfreigabe zugelassen sind, mit der Kontrolle direkt in die Buchung eingestellt.

## 15.2.3 Untertägige Tresorvereinnahmung und automatische Überleitung in den Kontrollierten CARAD Bestand

Es werden untertäglich alle zwei Stunden folgende Prozesse durchgeführt werden:

### 1. Automatische Vereinnahmung

- a. Aller eMission-Aufträge
- b. Aller bis zum Intervallzeitpunkt gebuchten und noch nicht vereinnahmten Aufträge „autom. Valutierungen“ von Sammelurkunden ohne Stückenummern.

Ausführung: Alle zwei Stunden, ca. 07:20-17:20 Uhr

### 2. Automatische Überleitung nach CARAD/Endbearbeitung

- a. Aller bis zum Intervallzeitpunkt automatisch oder manuell vereinnahmten Einlieferungsaufträge ohne Stückenummern.

Ausführung: Alle zwei Stunden, ca. 08:20 -16:20 Uhr

- b. Aller bis zum Intervallzeitpunkt automatisch oder manuell vereinnahmten „autom. Valutierungen“ von Sammelurkunden ohne Stückenummern.

Ausführung: Direkt nach Vereinnahmung (Punkt 1b)

## 15.2.4 Neuzulassung Rahmenurkunde mit gleichzeitiger Valutierung

Für die Neuzulassung einer Rahmenurkunde mit gleichzeitiger Valutierung (Einlieferungsart 4) erfolgt noch keine Berechtigungsprüfung auf Hauptzahlstelle/emissionsbegleitendes Institut, da zu diesem Zeitpunkt die Hauptzahlstelle oder das emissionsbegleitende Institut unter Umständen noch nicht feststeht. Wenn diese Urkunde allerdings erneut valutiert/revalutiert werden soll, greift die Berechtigungsprüfung sofort.

**Hinweis:** Wenn eine Rahmenurkunde mit der Einlieferungsart 4 „Neuzulassung Rahmenurkunde mit Valutierung“ bei CEU eingeliefert wird, ist eine erneute Valutierung/Revalutierung erst

möglich, wenn der Auftrag mit der Neuzulassung im CEU-Tresor vereinnahmt wurde, d. h. die Urkunde muss den Status „K – Kontrolliert“ erreicht haben. Mittels der Transaktion KCKI IH (CARAD-Kundeninformation) können die Kunden den Status der Urkunden überprüfen, wenn sie für diese Gattung als Hauptzahlstelle oder emissionsbegleitendes Institut bei CEU eingetragen sind.

### Tabellarische Anzeige in KCKI

```

TRAN: KCKI FC: IH SB: I#DE0009999999#01###J
CARAD          INFORMATION SAMMELURKUNDEN          HANDBESTAND
                TABELLARISCHE ANZEIGE
                SEITE : 1
WKN            : I DE0009999999 TESTGATTUNG ABC
HINTERLEG.ART : 01 G8
                BST-NOM-SAMMEL: 250.000
                GES-RAHMEN-NOM: 4.500.000
                GES-NOM-SAMMEL:
KZ ST ORD-NR SAMMEL-   NOM-SAMMEL   NOM-DISPOSITIV   RAHMEN-NOM BES M
                NR
    K   1   1       250.000
    T   3   2
                77.000   2.500.000  25
                2.000.000  25
-- ID-KZ: 7907000176 -- FW: ----- B7907494 -- 10/07/03 -- 08:28:38 --
KC0015I Bitte Kennzeichen eingeben
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

```

Abbildung 15.6 Tabellarische Anzeige Sammelurkunden

Urkunden im Status „T – Teilerfasst“ sind bei CEU gebucht, aber noch nicht vom Tresor vereinnahmt. Die Nominale der Valutierung wird daher auch noch als dispositive Nominale aufgeführt. Nach erfolgter Vereinnahmung durch den CEU-Tresor geht die Urkunde im nachfolgenden Batch über Nacht in den Status „K“ über und die NOM-DISPOSITIV wird nach NOM-SAMMEL überführt. Erst jetzt ist eine erneute Valutierung/Revalutierung möglich.

Die Beschreibung der Transaktion KCKI entnehmen Sie bitte dem Benutzerhandbuch [CARAD User Manual](#).

#### Tipp:

Wenn bereits absehbar ist, dass am selben Arbeitstag neben der Neuzulassung einer Rahmenurkunde diese mehrfach valutiert oder revalutiert werden soll, dann empfehlen wir Ihnen, die Neuzulassung in der Einlieferungs-Art „3 – Neuzulassung Rahmenurkunde“ mit der Rahmennominale „0“ vorzunehmen und die anschließenden Valutierungen in der Einlieferungs-Art „5 – Valutierung“. Auf diese Weise sind alle Aufträge am selben Arbeitstag zu erfassen und zu buchen.

## 15.2.5 Buchungsrelevante Auftragsdaten

### (A) Allgemeine Beschreibung

Die buchungsrelevanten Auftragsdaten enthalten alle Informationen, die notwendig sind, um den Auftrag in CASCADE buchen zu können.

### (B) Eingabemaske buchungsrelevanter Auftragsdaten

```

TRAN: KVEW FC: NV SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / EINZELERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                        NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG
PRIMANOTE: 653          AUFTNR: 653002          HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 200      CEU TR. B. GS -TGL BIS-ZU-
GUT-KTO  : 4424 000      CEU W/KUNDENSIMULATION CRC
WKN       : W 620200     SALZGITTER AG O.N.
                        I DE0006202005
NOMINALE : 10.000        EINHEIT: ST          ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  : 10.000        EINLIEF-ART : 4      NEUZULASSUNG VAL. RU
RAHMEN-NOM: 10.000      ORD-NR       : 6
SET-DAY  : 01.07.2019   EINLIEF-GRUND: 1 AUS EMISSION
KUNDENREFERENZ : _____ - _____ - _____      KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME: _____
ADRESSE: _____

BEARB-STATUS: 100 EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST

-- ID-KZ: 7907123444 -- PW:          ----- B79074P4 -- 01/07/19 -- 09:00:00 --
PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
    
```

Abbildung 15.7 Erfassungsmaske Einlieferung

### (C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung buchungsrelevanter Daten für eine Einlieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

| Feld        | Vorbelegt mit:          | Beschreibung   |
|-------------|-------------------------|--|
| AUFTRNR     |                         |  |
| HLG         | „01“ (GS)               | Girosammelverwahrung<br>HLG 99 ist nicht zugelassen. |
| EINLIEF-ART | „2“                     | Neuzulassung Globalurkunde                           |
| LAST-KTO    | CEU interne Kontonummer | Tresorkontonummer                                    |
| GUT-KTO     | Bank-Nr.                | Hauptkonto der erfassenden Bank                      |
| WKN-KENNUNG | „I“                     | ISIN   |
| WKN         |                         |  |
| NOMINALE    | Buchungsnominale        |  |

| Feld       | Vorbelegt mit:                              | Beschreibung  |
|------------|---|---|
| NOM-URK    | Summe aus Anzahl Urkunden je Stückelung     |   |
| RAHMEN-NOM |   | Bei der Neuzulassung von Rahmenurkunden muss eine Rahmen-Nominale eingegeben werden.  |
| ORD-NR     | Vorbelegung mit „1“ nur für eMission Kunden | Bei der Neuzulassung von Rahmenurkunden via eMISSION-Prozess wird die Ordnungsnummer mit „1“ vorbelegt.   |
| SET-DAY    | Aktuellen Datum                             | Es ist möglich, den Settlement-Day bei Neuzulassungen und Valutierungen in der CASCADE Transaktion KVEW - NV (NEUZULASSUNG/ VALUTIERUNG) bis zu 40 Bankarbeitstage im Voraus anzugeben. |

Neben der allgemeingültigen Felddescription (siehe [Allgemeingültige Felddescriptions und Formalprüfungen](#) auf Seite 10-1) gelten bei der Erfassung der buchungsrelevanten Auftragsdaten für die Neuzulassung/Valutierung folgende Felddescriptions:

| Feld                | Beschreibung   |
|---------------------|--|
| PRIMANOTE           | Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.   |
| AUFTNR              | Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7.000.000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Kunden (Eingabe) darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus und in den CEU internen Prüfstellen kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.  |
| GUT-KTO             | Niederlassungen können nur Einlieferungen zugunsten der Zentrale tätigen. Kunden ohne Bestandsführung können keine Ersteinlieferungen tätigen.   |
| NOMINALE<br>NOM-URK | Die Eingabe 0 ist in bestimmten Vorgängen erlaubt (z. B. Neuzulassung Rahmenurkunde)   |
| SET-DAY             | Das Feld „SET-DAY“ muss immer gefüllt sein (Eingabe Pflicht Feld) und wird standardmäßig mit dem aktuellen Tagesdatum vorbelegt. Der vorbelegte Settlement-Day kann mit einem Datum, das bis zu 40 Bankarbeitstage in der Zukunft liegt, von den CEU-Teilnehmern überschrieben werden. Prüfungen bei Auftragserteilung gegen CARAD (z. B.: bei Valutierungen auf vorhandene Ordnungsnummer) werden nur noch für Aufträge ausgeführt deren Settlement-Day dem aktuellen Arbeitstag entspricht. Das neue Eingabe-Feld „SET-Day“ wird in allen relevanten Informationsanzeigen (CASCADE Erfassungs-, Auftrags- und Dispositionsstatus) sowie in den Online-Druckreports übernommen. |
| WKN                 | In einem Auftrag bzw. einer Einlieferung können nur Urkunden einer Wertpapierkennnummer zusammengefasst werden. Optionsanleihen-cum können zurzeit nicht elektronisch in Auftrag gegeben werden.   |

#### Mögliche Eingaben:

EINLIEF-ART:

| Maske | Beschreibung               |
|-------|----------------------------|
| 2     | Neuzulassung Globalurkunde |
| 3     | Neuzulassung Rahmenurkunde |

| Maske | Beschreibung                          |
|-------|---------------------------------------|
| 4     | Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde |
| 5     | Valutierung                           |

EINLIEF-GRUND:

| Maske | Beschreibung                                     |
|-------|--|
| 001   | aus Emission                                     |
| 002   | KE gegen Einlage                                 |
| 003   | Kapitalerhöhung bedingt – Optionsscheinausübung- |
| 004   | Rahmenurkunde Ersteinlieferung RS                |
| 005   | Urkundenumtausch                                 |
| 007   | Gratisaktien                                     |

### (D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST-KTO/GUT-KTO

Last-Konto und Gut-Konto dürfen nicht gleich sein.

GUT-KTO/USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

Filialen können nur zu Gunsten der Zentrale erfassen. Es erfolgt u. U. eine Berechtigungsprüfung gegen WSS.

GUT-KTO/EINLIEF-GRUND

Handelt es sich beim Gut-Konto um ein Konto für die Einlieferung aus Aktien aus Kapitalerhöhung aus Gesellschaftsmitteln, dann sind nur die Einlieferungsgründe 1 (Neuemission), 2 (unbedingte KE) und 7 (bedingte KE) erlaubt.

Folgende kombinierte Eingaben von WKN/ISIN und Einlieferungsgrund sind möglich:

- bei Einlieferungsgrund = 1 sind WKN/ISIN mit allen erlaubten Verwahrmöglichkeiten zugelassen, außer RS
- bei Einlieferungsgrund = 2 oder 3 sind nur für RS-Aktien erlaubt.
- bei Einlieferungsgrund = 4 (Einlieferung von RS vor dem GS-Stichtag) sind nur RS erlaubt.
- bei Einlieferungsgrund = 5 (Urkundenumtausch) sind alle WKN/ISIN erlaubt.
- bei Einlieferungsgrund = 7 (Erstbelieferung) sind WKN/ISIN mit den Verwahrmöglichkeiten JGS bis Einlieferung; SVG Inhabersammelzertifikat CEU und Miteigentum Sh.Cert. erlaubt.

NOMINALE/EINLIEF-GRUND

Wird die Nominale mit 0 belegt (Neuzulassung einer Rahmenurkunde), dann sind nur die Einlieferungsgründe 1 (aus Emission), 3 (bedingte KE) und 4 (Einlieferung von RS) erlaubt.

NOMINALE/EINLIEF-ART/STUECKENUMMERN/ORD-NR

- Wenn Einlieferungs-Art = 2,
  - Nominale muss größer 0 sein.

- Rahmennominale muss gleich 0 sein.
- Stückenummern können eingegeben werden.
- Ordnungsnummer ist Muss-Feld und darf noch nicht in CARAD vorhanden sein.
- Wenn Einlieferungs-Art = 3,
  - Nominale muss gleich 0 sein.
  - Rahmennominale muss größer 0 sein.
  - es dürfen keine Stückenummern eingegeben werden.
  - Ordnungsnummer ist Muss-Feld und darf noch nicht in CARAD vorhanden sein.
- Wenn Einlieferungs-Art = 4
  - Nominale muss größer 0 sein, aber maximal gleich Rahmennominale
  - Rahmennominale muss größer 0 sein.
  - Ordnungsnummer ist Muss-Feld und darf noch nicht in CARAD vorhanden sein.
  - Stückenummern müssen eingegeben werden, wenn es sich um eine RS-Gattung handelt, sonst können diese eingegeben werden.
- Wenn Einlieferungs-Art = 5
  - Nominale muss größer 0 sein.
  - Rahmennominale muss gleich 0 sein.
  - Stückenummern müssen eingegeben werden, wenn es sich um eine RS-Gattung handelt, ansonsten können diese eingegeben werden.
  - Ordnungsnummer ist Muss-Feld und muss schon in CARAD vorhanden sein.

### LAST-KTO/HLG

Wenn das Lastkonto die Kontoart 261 hat, ist nur HLG 20 erlaubt und umgekehrt.

### NOMINALE/NOM-URK

Wird das Feld Nominale-Urkunde gefüllt, wird systemseitig das Feld Nominale ermittelt und gefüllt. Werden beide Felder gefüllt, werden systemseitig die Inhalte geprüft.

### WKN/EINLIEF-ART/EINLIEF-GRUND

- Wenn Einlieferungs-Art = 2 ist für RS-Gattungen nur Einlieferungs-Grund 2 und 7 zugelassen.
- Wenn Einlieferungs-Art = 3 ist für RS-Gattungen nur Einlieferungs-Grund 2, 3, 4, 5, 7 zugelassen.
- Wenn Einlieferungs-Art = 4 ist für RS-Gattungen nur Einlieferungs-Grund 2, 3, 5, 7 zugelassen.
- Wenn Einlieferungs-Art = 5 ist für RS-Gattungen nur Einlieferungs-Grund 2, 3, 7 zugelassen.

### WKN/NOMINALE

Für bestimmte WKN/ISIN GS-Verwahrmöglichkeiten kann eine Rahmenurkunde und somit als Nominale 0 eingegeben werden.

### WKN/HLG

Handelt es sich bei der WKN/ISIN um eine Namensaktie (RS), dann ist nur die Hinterlegungsart „Girosammelverwahrung“ (01) erlaubt. Handelt es sich nicht um eine RS-Gattung, dann gelten folgende Abhängigkeiten:

- Wenn HLG 1, dann sind VWM 96-98 nicht erlaubt.

WKN/RAHMEN-NOM

Wenn es sich bei der WKN/ISIN um eine eMission-Urkunde handelt, dann muss die Rahmen-Nominale gefüllt sein.

WKN/ORD-NR

Wenn es sich bei der WKN/ISIN um eine eMission-Urkunde handelt, dann wird die Ordnungsnummer mit „1“ vorbelegt. Sollte diese Ordnungsnummer für diese WKN/ISIN schon in CARAD vorhanden sein, dann muss

## 15.2.6 Wertpapierrelevante Folgedaten

### (A) Allgemeine Beschreibung

Für die korrekte Bearbeitung und Abwicklung einer Neuzulassung/Valutierung müssen neben den buchungsrelevanten Informationen noch weitere wertpapierspezifische Daten im Auftrag erfasst werden. Dazu wird nach der Verarbeitung der buchungsrelevanten Auftragsdaten auf eine Folgemaske verzweigt.

### (B) Folgemaske wertpapierrelevanter Daten

```

TRAN: KVEW FC: NV SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / FOLGEERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                        NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG
AUFTNR:      653002      WKN: I DE0006202005      HLG: 01 GS

VERWAHR-MOEGlichkeit    : 9 GIROSAMMELVERW.
BESONDERHEIT            : 23 TECHN.GLOBALURK. O.BOG. (LIEFERBAR)
ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG : 0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG

NAECHSTER KUPON/LEG      :      20      LETZT. KUP/LEG :      20

NACHWEISART:      1 EINLIEF. EFF. URK.

KE-TYP
WKN DES RECHTS: I _____
EX-TAG/BEGINN : _____      DATUM-KE      : _____

TEXT: _____

-- ID-KZ: 7907123444 -- PW:      ----- B79074P4 -- 01/07/19 -- 09:00:00 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Vor  PF7:Zurück
    
```

Abbildung 15.8 Folgemaske Eingabe wertpapierspezifischer Daten

**(C) Felddesonderheiten**

Bei der Erfassung der wertpapierrelevanten Folgedaten sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich.

| Feld        | Vorbelegt mit:  |
|-------------|---|
| PRIMANOTE   | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.   |
| AUFTRAGSNR  | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.   |
| WKN         | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.   |
| HLG         | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.   |
| NACHWEISART | 1 - Einlieferung effektiver Urkunden (Kennzeichen für „Nicht-eMission-Urkunden“)<br>8 - Einlieferung eMission (Kennzeichen für „eMission-Urkunden“) |

Neben der allgemeingültigen Felddescription (siehe [Allgemeingültige Felddescriptions und Formalprüfungen](#) auf Seite 10-1) gelten bei der Erfassung der wertpapierrelevanten Folgedaten für eine Einlieferung folgende Felddesonderheiten:

| Feld                                   | Beschreibung   |
|--|--|
| NÄCHSTER KUPON/<br>NÄCHSTER LEG-SCHEIN | Die Eingabe für dieses Feld wird gegen die zum Wertpapier gespeicherten Informationen geprüft und entsprechend belegt. Bei Renten erfolgt eine Datumsprüfung, bei Aktien erfolgt eine numerische Prüfung. Handelt es sich beim nächsten Kupon um ein Bezugsrecht, ist die Eingabe eines Datums oder einer max. dreistelligen Nummer möglich. Bei Optionsscheinen wird der nächste Legitimationsschein gefordert (alphanumerische Eingabe). |

**(D) Abhängigkeitsprüfungen**

DATUM-KE/EINLIEF-GRUND

Wenn DATUM-KE gefüllt ist, dann muss EINLIEF-GRUND 2, 3, 7 sein, unabhängig von der EINLIEF-ART.

VWM/EINLIEF-ART/BESONDERHEIT

Bei der Auftragserteilung von Neuzulassungen über die CASCADE-Transaktion KVEW NV wird das Feld „Besonderheit“ unter den unten aufgeführten Bedingungen vorbelegt.

- Bei Valutierungen (Einlieferungsart 5) ist das Feld nicht eingebbar und wird auch nicht vorbelegt.
- Globalbonds (KV-Lagerland = 998) werden mit der Besonderheit 57 „Globalbonds ohne Bogen“ vorbelegt.
- RS-Gattungen werden je Verwahrmöglichkeit wie folgt mit der Besonderheit vorbelegt:
  - VWM 14: Vorbelegung mit Besonderheit 55 „Rahmenurkunde ohne Bogen“
  - VWM 15: Vorbelegung mit Besonderheit 48 „IGL ohne Bogen“
  - VWM 16: Vorbelegung mit Besonderheit 23 „technische Globalurkunde ohne Bogen lieferbar“
- Für Lieferungen in der Einlieferungsart 2 gilt folgende Regeln:
  - VWM 1, 2: Vorbelegung mit Besonderheit 26 „Jungschein ohne Bogen“
  - VWM 5: Vorbelegung mit Besonderheit 48 „IGL ohne Bogen“
  - VWM 9, 16: Es erfolgt keine systemseitige Vorbelegung. Das Feld Besonderheiten wird durch die CEU-Prüfstelle ergänzt.
- Sonstige VWM: Vorbelegung mit Besonderheit 53 „Dauerglobalurkunde ohne Bogen“

- Lieferungen in der Einlieferungsart 3 und 4 unterliegen folgenden Regeln:
  - VWM 9, 16: Vorbelegung mit Besonderheit 23 „technische Globalurkunde ohne Bogen“
  - VWM 1,2: Vorbelegung mit Besonderheit 26 „Jungschein ohne Bogen“
  - VWM 5, 15: Vorbelegung mit Besonderheit 48 „IGL ohne Bogen“

Ausnahmen sind WKN/ISIN mit den Stückarten „Nur Mantel“ und „Unikat“. Bei WKN/ISIN mit der Stückart „Nur Mantel“ können die Besonderheiten 21 und 23, bei WKN/ISIN mit der Stückart „Unikat“ können die Besonderheiten 20 und 22 eingegeben werden. Für RS-Gattungen sind nur die Besonderheiten 5 und 6 erlaubt.

Für CEU-Kunden, die zur Auftragserteilung den eMission-Services nutzen und somit keine Möglichkeit der Spezifizierung von Besonderheiten haben, wird gemäß den o. a. Bedingungen vorbelegt.

## 15.2.7 Stückenummern Folgedaten

### (A) Allgemeine Beschreibung

Zur vollständigen Auftragserteilung ist es notwendig, die zugehörigen Stückenummern der einzuliefernden Urkunden im Auftrag anzugeben. Zur Erfassung und Bearbeitung dieser Daten steht eine zweite Folgemaske zur Verfügung.

### (B) Folgemaske Stückenummern

```

TRAN: KVEW FC: NV SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / STUECKEERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                        NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG - SAMMELURKUNDE
AUFTNR      :      653002      GES-NOM      :      10.000
WKN          : I DE0006202005      SUMME-NOM:
                        SCHRITTWEITE: _____

KZ  ANZAHL LIT      STUECKELUNG STUECKENUMMERN (VERBRIEFTE URKUNDEN)  E/O

-----

-- ID-KZ: 7907123444 -- PW:          ----- B79074P4 -- 01/07/19 -- 09:00:00 --
EA0005I Verarbeitung der vorherigen Seite durchgeführt
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Vor PF7:Verarb+Zurück
    
```

Abbildung 15.9 Folgemaske Stückenummern

**Eingebbare Kennzeichen (KZ):**

- „L“            Löschung einer Stückenummer/Nummernfolge
- „A“/„N“      Änderung einer Stückenummer
- „M“            Änderung der Mängelgründe von Stückenummern/Nummernfolgen
- „E“            Änderung Ersatzurkunde

**Hinweis:** Die Eingabe und Bearbeitung der Stückenummern ist in Kapitel [Spezifische Feldbeschreibungen und Formalprüfungen](#) auf Seite 11-1 detailliert beschrieben. Innerhalb der Erfassung der Stückenummern muss jeweils bei neuer

- Stückelung
- Schrittweite und/oder

die Bildschirmseite gewechselt werden.

Vor diesen Wechseln müssen die bereits erfassten Daten mit der Taste PF6 abgespeichert werden.

Die Kennzeichnung einer Stückenummer als Ersatzurkunde ist nur möglich, wenn zu diesem Stück keine Oppositionsmeldung oder eine Meldung mit Oppositionsgrund 3 (Kraftloserklärung Aufgebot) vorliegt. Anderenfalls (Meldung mit Oppositionsgrund ungleich 3) wird die Eingabe eines „E“ mit entsprechendem Fehlerhinweis abgelehnt.

Über die tägliche abendliche Oppositionsverarbeitung können Stückenummern aus Einlieferungsaufträgen aufgrund neuer Meldungen nachträglich mit Oppositionen gekennzeichnet werden. Handelt es sich bei dem eingelieferten Stück jedoch tatsächlich um die Ersatzurkunde, so kann dies über die Änderungsfunktionen korrigiert werden, sofern die Stückenummer mit Oppositionsgrund C belegt ist.

Durch Eingabe eines „M“ im Feld KZ und „E“ im Feld E/O wird diese Oppositionskennzeichnung der Stückenummer zurückgenommen und das Kennzeichen für Ersatzstück eingestellt.

War der Einlieferungsauftrag zum Zeitpunkt der Oppositionsverarbeitung bereits gebucht, dann besteht diese Möglichkeit jedoch nicht mehr. Der Auftrag kann nur noch gelöscht oder durch CEU vereinnahmt werden, wobei die Oppositionsstücke auch nach CARAD übergeleitet werden.

Darüber hinaus werden alle mit Opposition belegten Stücke, die sich im CASCADE-Erfassungsstatus befinden bzw. aus dem Auftragsstatus dorthin generiert wurden, in einer Oppositionsliste ausgewiesen (siehe Kapitel [Auswertungen](#) auf Seite 23-1).

Bei Neuzulassung Globalurkunde ist eine Eingabe von Stückenummern nicht zwingend erforderlich, während bei Neuzulassung Rahmenurkunde nie Stückenummern eingegeben werden dürfen. Bei Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde müssen für RS-Gattungen Stückenummern eingegeben werden, sonst können diese eingegeben werden. Bei Valutierung müssen für RS-Gattungen Stückenummern eingegeben werden, sonst können diese eingegeben werden. Stückenummern, bei denen CASCADE feststellt, dass sie bereits (doppelt) erfasst sind, werden mit dem Hinweis abgelehnt, dass systemseitig eine Suche veranlasst werden muss. In diesem Fall unterrichtet der Kunde die CEU per FAX über Gattung, Stückelung und Stückenummer (siehe [Kontakte](#) auf Seite 4-1).

**(C) Feldbesonderheiten**

Bei der Erfassung der Stückenummern zu einer Einlieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

| Feld         | Vorbelegt mit:   |
|--------------|--|
| SCHRITTWEITE | Beim ersten Einstieg mit 1, ansonsten wird sie aus der vorherigen Stücke-Erfassung übernommen. |
| STÜCKELUNG   | Wird aus der vorherigen Stücke-Erfassung übernommen.   |

Neben der allgemeingültigen Felddescription (siehe Kapitel [Allgemeingültige Felddescriptionen und Formalprüfungen](#) auf Seite 10-1) gelten bei der Erfassung von Stücke-Besonderheiten für eine Wertpapiereinlieferung folgende Felddescriptionen:

| Feld        | Beschreibung   |
|-------------|--|
| PRIMANOTE   | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.  |
| AUFTRAGSNR  | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.  |
| WKN         | Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.  |
| ERSATZSTÜCK | Es kann „E“ für Ersatzstück eingegeben werden  |
| STÜCKELUNG  | Sind Stückenummern mit Litera-Kennung zu erfassen, so ist diese in dem dafür vorgesehenen Bereich im Feld „Stückelung“ einzugeben. Dabei sind maximal 10 Stückelungen pro Auftrag zulässig. In CASCADE werden die Stückelungen automatisch in absteigender Reihenfolge gespeichert. Die Einlieferung der zugehörigen Urkunden muss dieser Vorgabe entsprechen. Innerhalb einer Stückelung ist die Reihenfolge der Eingabe maßgebend. |
| SUMME-NOM   | Wird mit der Nominale der bereits insgesamt erfassten Stücke belegt.   |

## (D) Abhängigkeitsprüfungen

### STÜCKELUNG/VERWAHR-MÖGLICHKEIT

Für alle Verwahrarten, ausgenommen - Eingeschränkte GS-Verwahrung-: gilt, dass die eingegebene Stückelung zur WKN/ISIN mit der eingegebenen Litera vorhanden sein muss. Handelt es sich bei der Einheit-der-Effektennotiz um % oder 0/00, dann wird die Stückelung-Nominale geprüft. Bei ST (Stücke) wird die Anzahl Stücke geprüft.

### ERSATZSTÜCK/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Ein Ersatzstück kann nur dann eingegeben werden, wenn in der entsprechenden Textzeile mindestens eine Stücknummer erfasst wurde.

### ERSATZSTÜCK/WKN/FLIEßTEXT STÜCKENUMMERN

Handelt es sich bei der eingegebenen WKN/ISIN um ein Bezugsrecht, so ist die Kennzeichnung als Ersatzstück nicht erlaubt.

## 15.3 Erfassung von Aufträgen zur effektiven Auslieferung oder Revalutierung/Teilreduzierung von Emissionen (AL)

Folgende Aufträge werden hier erfasst:

- laufende Auslieferungen von Einzelurkunden mit (Einzel- und Verbundnummern) Stufe II
- laufende Auslieferungen von technischen Sammelurkunden
- laufende Auslieferungen als Umlegung aus oder in Vorratslager für nicht begebene Fondsanteile
- eingeschränkte GS-Verwahrung
- Revalutierung von Rahmenurkunden (mit oder ohne Auslieferung der Rahmenurkunde)
- Teilreduzierung von Globalurkunden
- Auslieferung von Rahmenurkunden ohne Revalutierung
- Revalutierung Rahmennominale

Die Daten für einen zu erfassenden Auslieferungsauftrag in der CASCADE-Anwendung setzen sich wie folgt zusammen:

- buchungsrelevante Auftragsdaten (Basismaske)
- Adressdaten, Versand- und Versicherungsdaten
- Stückelungswünsche und Textzusätze für die Auslieferungsvorgänge 2 und 3 sowie Auslieferungsvorgang 1 und Sammelurkunde = N
- Urkundenwünsche und Textzusätze für den Auslieferungsvorgang 1 1 mit KZ-Sammelurkunde = J

### 15.3.1 Direktive 2014/91/EU

Seit 18. März 2016 sind in Deutschland rechtliche Aktualisierungen wirksam, um Anforderungen der Direktive 2014/91/EU zu erfüllen.

Durch diese Aktualisierungen werden Inhaberanteile von Investment Fonds für ungültig erklärt, wenn sie nicht zum 31. Dezember 2016 girosammelverwahrt sind. Weiterhin dürfen Inhaberanteile, die girosammelverwahrt sind, ab 1. Januar 2017 nicht aus der Girosammelverwahrung physisch ausgeliefert werden.

Somit, um menschliches Versagen und folgende, rechtliche Konsequenzen für CEU und Dritte zu vermeiden, muss CEU eine technische Lösung bereitstellen, die jegliche physische Auslieferung von Einzelurkunden aus der Girosammelverwahrung unterbindet. Gründe hierfür sind, dass physische Zertifikate, die ab 1. Januar 2017 aus der Girosammelverwahrung ausgeliefert werden, ungültig werden und auch nicht mehr im Treuhänder-Konto der Verwahrstelle verwahrt werden (als gesetzliche Anforderung).

Betroffene ISINs können über den Wert 5000 im WSS-Feld GD198B identifiziert werden.

Die physische Lieferung von Festbetrag-Globalurkunden und/oder Rahmenurkunden BisZu in oder aus der Girosammelverwahrung bleibt bestehen.

Tatsächlich sperrt die technische Lösung alle Bestände in Einzelurkunden von Fonds für die physische Lieferung, inklusive Umlegung zwischen Girosammelverwahrung und Vorratslager.

Die technische Lösung sperrt auch alle Bestände in Einzelurkunden von Fonds für die Umlegung zwischen Girosammelverwahrung und Fremdtresor.

Die technische Lösung für Einlieferungs-Aufträge wird zum 1. Januar 2017 wirksam. Für Auslieferungs-Aufträge hingegen ist die technische Lösung bereits wirksam.

### 15.3.2 Berechtigungsprüfung bei Revalutierung ohne Auslieferung Rahmenurkunde

Bei Revalutierung ohne Auslieferung Rahmenurkunde wird systemseitig geprüft, dass auf der Kundenseite nur die Bank (Kontostamm) angegeben wird, die als emissionsbegleitendes Institut bzw. Zahlstelle der Gattung zugelassen ist. Gleichzeitig muss die auf der Kundenseite angegebene Bank Erfasser des Auftrags sein.

Die Revalutierungen ohne Auslieferung Rahmenurkunde, für die die Berechtigungsprüfung relevant ist, sind durch die Wertpapier-Instrumentenarten festgelegt.

Diese Instrumentenarten sind der Tabelle „Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung“ aus dem Anhang zu entnehmen

Auswirkungen:

- Bei Erfassung/Änderung/Kontrolle/LIMA-Einstellung/Überleitung einer Revalutierung ohne Auslieferung Rahmenurkunde wird geprüft, ob die Bank auf der Kundenseite als „Emissionsbegleitendes Institut“ im WP-Stamm in WSS eingetragen ist (siehe Schnittstellen). Ist das Feld leer, wird gegen die Zahlstelle geprüft. Falls die Bank weder als „Emissionsbegleitendes Institut“ noch als Zahlstelle hinterlegt ist, führt dies zur Ablehnung des Auftrags im entsprechenden Bearbeitungsvorgang.
- Dabei ist zu beachten, dass auch die Clearstream berechtigt ist, für das emissionsbegleitende Institut bzw. für die Zahlstelle entsprechende Aufträge zu erfassen.

Falls von WM neue Instrumentenarten veröffentlicht werden, die nicht in der Tabelle [Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung](#) auf Seite 29-1 enthalten sind, dann werden Aufträge für Gattungen mit diesen WP-Gruppen automatisch für die „manuelle Bearbeitung durch die Prüfstelle“ zugelassen.

In der Tabelle [Definition der nicht zugelassenen Gattungen](#) auf Seite 29-3 sind diejenigen WP-Gruppen enthalten, die nicht für Valutierung/Revalutierung zugelassen sind.

### 15.3.3 Autom. Buchungsfreigabe Revalutierung ohne Auslieferung

Revalutierungen ohne Auslieferung Rahmenurkunde werden für bestimmte Gattungen nicht standardmäßig von den CEU-Prüfstellen zur Buchung freigegeben, sondern direkt mit der Kontrolle (Vollanzeige/Kurzanzeige) gebucht. Dies ist möglich, da für diese ebenfalls eine automatische Prüfung auf Berechtigung durchgeführt wird. Die Definition ist analog der für die Berechtigungsprüfung (Definition siehe entsprechendes Kapitel im Anhang).

Mit der automatischen Freigabe obliegt die genauere fachliche Prüfung der bearbeitenden Bank. Sollte diese erst nach der Buchung einen Fehler feststellen, gibt es zwei Möglichkeiten die Falschbuchung wieder rückgängig zu machen. Zum einen kann die Bank sich mit CEU in Verbindung setzen, damit durch CEU ein entsprechender Storno veranlasst wird. Verbunden mit einem Storno über die Auftragsart 99 ist die manuelle Korrektur des CARAD-Bestandes (Verminderung/Erhöhung der Nominale mit ggf. Neuerfassung der Stückenummern).

Zum anderen kann die Bank selbst einen Gegenauftrag erteilen oder durch CEU erteilen lassen. Bei der Korrektur einer falsch gebuchten Revalutierung mit Stücken mittels Valutierung kann allerdings kein Anspruch darauf erhoben werden, dass die gleichen Stückenummern ausgeliefert werden, die fälschlicherweise disponiert wurden.

In der Disposition abgelehnte Valutierungen werden nach 90 BA, fällige Revalutierungen nach 40 BA aus dem Auftragsstatus gelöscht.

### 15.3.4 Buchungsrelevante Auftragsdaten

Nach Eingabe des Funktionscodes „AL“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird die Maske zur Erfassung der Auftragsdaten zur Verfügung gestellt.

|  |                                |                   |
|--|--------------------------------|-------------------|
| TRAN: KVEW FC: EL SB:                          |                                |                   |
| AUFTRAGSABWICKLUNG                             | EINLIEFERUNG / EINZELERFASSUNG | ERFASSUNGSSTATUS  |
|  | LFD.EINLIEFERUNG               |                   |
| PRIMANOTE: ____                                | AUFTNR: _____                  | HLG: 01 GS        |
| LAST-KTO : ____ ____                           |                                |                   |
| GUT-KTO : ____ ____                            |                                |                   |
| WKN : I _____                                  |                                |                   |
| NOMINALE :                                     | EINHEIT:                       | ST-ART:           |
| NOM-URK :                                      | EINLIEF-ART : 1                | LFD. EINLIEFERUNG |
|  | EINLIEF-GRUND: ____            |                   |
| KUNDENREFERENZ : ____ - _____                  |                                | KZ-BST: ____      |
| EINLIEFERUNG-VON NAME: _____                   |                                |                   |
| ADRESSE: _____                                 |                                |                   |
| BEARB-STATUS:                                  |                                |                   |
| KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus |                                |                   |

#### (A) Allgemeine Beschreibung

Die buchungsrelevanten Auftragsdaten enthalten alle Informationen, die notwendig sind, um den Auslieferungsauftrag bei der CEU buchen zu können.

**(B) Eingabemaske buchungsrelevanter Auftragsdaten**

```

TRAN: KVEW FC: AL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      AUSLIEFERUNG / EINZELERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: 653          AUFTNR: 653003          HLG: 01 GS

LAST-KTO : 4424 000      CEU W/KUNDENSIMULATION CRC
GUT-KTO  : 7960 000      CEU TRESORBESTAND GS
WKN       : W 620200      SALZGITTER AG O.N.
                I DE0006202005
NOMINALE  :                10          EINHEIT : ST          ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK   :                10          UMLEGUNG: ___
SET-DAY   : 01.07.2019    AUSLIEF-VERF: ___
KUNDENREFERENZ: ___ - ___ - ___ - ___ - ___

NAECHSTER KUPON/LEG:                20
SAMMELURKUNDE (J/N): N  AUSLIEF-VORG: 1  AUSLIEFERUNG  AUSLIEFERUNG RU (J/N): N
ABW-VERSANDADR (J/N): N

BEARB-STATUS: 100  AUSLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST

-- ID-KZ: 7907123444 -- PW:                ----- B79074P4 -- 01/07/19 -- 09:00:00 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
    
```

**(C) Felddesonderheiten**

Bei der Erfassung buchungsrelevanter Daten für eine Auslieferung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

| Feld                           | Vorbelegt mit:                      | Beschreibung                               |
|--------------------------------|-------------------------------------|--|
| AUFTNR                         |                                     |  |
| HLG                            | „01“ (GS)                           | Girosammelverwahrung                       |
| GUT-KTO                        | interner Kontonummer der CEU        | Tresorkontonummer                          |
| LAST-KTO                       | Bank-Nr. des erfassenden Institutes |  |
| WKN-KENNUNG                    | „I“                                 | ISIN                                       |
| WKN                            |                                     |  |
| NOMINALE                       |                                     | Buchungsnominale                           |
| NOM-URK                        |                                     | Summe aus Anzahl Urkunden je Stückelung    |
| KUNDENREFERENZ<br>GITDRITTBANK |                                     |  |
| SET-DAY                        | TTMMJHJJ                            | Nächstmögliche Buchungsvaluta              |
| UMLEGUNG                       |                                     |  |
| SAMMELURKUNDE                  | „N“                                 | Einzelurkunden                             |
| AUSLIEF-VORG                   | „1“                                 | Auslieferung Urkunde                       |
| AUSLIEFERUNG RU                | „N“                                 | Keine Rahmenurkunde                        |
| ABW. VERSANDADR                | „N“                                 | Keine abweichende Versandadresse gewünscht |

Neben der allgemeingültigen Felddescription (siehe [Allgemeingültige Felddescriptionen und Formalprüfungen](#) auf Seite 10-1) gelten bei der Erfassung der buchungsrelevanten Auftragsdaten für eine laufende Auslieferung folgende Felddescriptions.

| Feld      | Beschreibung   |
|-----------|--|
| PRIMANOTE | Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.   |
| AUFTNR    | Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 7.000.000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Kunden/Eingebener darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus und in den CEU internen Prüfstellen kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren. |

#### (D) Abhängigkeitsprüfungen

##### AUSLIEF-VORG

Dieses Feld ist stets mit dem Wert „1“ (Auslieferung) vorbelegt. Die Ausprägung bedeutet, dass eine effektive Auslieferung von Urkunden erfolgen soll. Bei Revalutierungsaufträgen ist das Feld „AUSLIEF-VORG:“ mit dem Wert „2“ zu füllen. Bei einem Revalutierungsauftrag muss grundsätzlich das Feld „SAMMELURKUNDE (J/N)“ auf „J“ geändert werden. Zusätzlich kann auch die Auslieferung einer Rahmenurkunde erfolgen, indem das Feld „AUSLIEFERUNG RU (J/N)“ mit „J“ belegt wird.

Bei Teilreduzierungsaufträgen muss das Feld „AUSLIEF-VORG:“ mit dem Wert „3“ gefüllt werden. Das Feld „AUSLIEFERUNG RU“ muss mit „N“ gefüllt sein.

Bei Reduzierung Rahmennominale ist das Feld „AUSLIEF-VORG:“ mit dem Wert „6“ zu füllen. Das Feld „AUSLIEFERUNG RU“ muss mit „N“ gefüllt sein.

Für das Feld „AUSLIEF-VORG/NOMINALE/SAMMELURKUNDE (J/N)“ ist bei einer Reduzierung der Rahmennominale das Feld NOMINALE mit dem Wert „0“ und das Feld SAMMELURKUNDE (J/N) mit „J“ zu füllen.

##### GUT-KTO/LAST-KTO-/HLG

Handelt es sich beim Last-Konto um ein Kundenkonto aus dem Bereich Vorratslager für Fonds, so muss das Gut-Konto diesem entsprechen und als Hinterlegungsart ist nur (GS-) Vorratslager Bank möglich.

##### LAST/GUT-KTO

Last-Konto und Gut-Konto dürfen nicht gleich sein.

Entspricht das Last-Konto einem Kundenkonto Spezialabwicklung, dann muss es sich beim Gut-Konto ebenfalls um ein Tresorkonto Spezialabwicklung handeln.

##### LAST-KTO/USER-ID

Die ersten vier Stellen der eingegebenen Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen. Filialen können nur zu Gunsten der Zentrale erfassen (ausgenommen, wenn es sich bei dem Gut-Konto um die Konto-Art zum „Einrichten von Teilbeständen nur Kundenbestand“ handelt).

##### NOMINALE/NOM-URK

Wird das Feld Nominale-Urkunde gefüllt, wird systemseitig das Feld Nominale ermittelt und gefüllt. Werden beide Felder gefüllt, wird systemseitig die Inhalte geprüft.

## UMLEGUNG/WKN/LAST-KTO

Handelt es sich bei dem eingegebenen LAST-KTO um einen Depotbestand in Fonds im Vorratslager so können die Umlegungsgründe

- 1 Vorratslager in GS
- 2 GS in Vorratslager

angegeben werden. Es wird automatisch die Einbuchung der entsprechenden Eingangsbuchungen vorgenommen.

## 15.3.5 Folgedaten Versand

### (A) Allgemeine Beschreibung

Soll ein Versand an eine Dritte Bank (Vereinbarung mit CEU erforderlich) kann auf der Basismaske bei „Abw. Versandadresse“ „J“ = Ja eingegeben werden.

### (B) Folgemaske Versandadressdaten

```

TRAN: KVEW FC: AL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      AUSLIEFERUNG / ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                        ADRESSDATEN
AUFTNR      :      653003      WKN: I DE0006202005
                        HLG: 01 GS
NAME        : _____
STRASSE     : _____
LAND/PLZ/ORT: _____

AN ADRESS-NR: _____ BIC-CODE: _____
NAME        : CEU W/KUNDENSIMULATION CRC      PLZ/GROK:

NAMENSZUSATZ:
STRASSE     : MERGENTHALERALLEE 61
PLZ/POSTFACH:
LAND/PLZ/ORT: DE 65760 ESCHBORN
HINWEISTEXT :

-- ID-KZ: 7907123444 -- PW:      ----- B79074P4 -- 01/07/19 -- 09:00:00 --

PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF7:Zurück PF8:Vor
    
```

### (C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung der Adressfolgedaten gelten folgende Muss-Eingaben:

| Feld      | Vorbelegt mit:  |
|-----------|---|
| NAME      |   |
| ORT       |   |
| Optional: | Ist die interne Adress-Nummer der CEU dem Eingaber bekannt, kann diese verwendet werden. Die Eingabe des BIC ist ebenfalls möglich. |

## 15.3.6 Stückenummern und Stückelung Folgedaten

### (A) Allgemeine Beschreibung

Je nach Unterauftragsart erscheint als eine dritte Eingabemaske entweder die Stückelungswunschmaske oder die Urkundenwunschmaske:

| Vorgang  | Maske                  |
|--|------------------------|
| Auslieferung von Einzelurkunden (AUSL.-VORG 1)                   | Stückelungswunschmaske |
| Auslieferung einer Globalurkunde (AUSL.-VORG 1)                  | Urkundenwunschmaske    |
| Auslieferung einer Rahmenurkunde (AUSL.-VORG 2)                  | Stückelungswunschmaske |
| Revalutierung mit Auslieferung der Rahmenurkunde (AUSL.-VORG 2)  | Stückelungswunschmaske |
| Revalutierung ohne Auslieferung der Rahmenurkunde (AUSL.-VORG 2) | Stückelungswunschmaske |
| Teilreduzierung (AUSL.-VORG 3)                                   | Stückelungswunschmaske |
| Reduzierung Rahmennominale (AUSL.-VORG 6)                        | Stückelungswunschmaske |

**Hinweis:** Für die Auslieferung von Bezugsrechten ist die Eingabe von Stückelungswünschen explizit ausgeschlossen.

### (B) Folgemaske: Stückelungswunsch

```

TRAN: KVEW FC: AL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      AUSLIEFERUNG / ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                        STUECKELUNGSWUNSCH

AUFTNR:      653001                      WKN:  I DE0008474040
                                           HLG:  01 GS
ORD-NR: _____ / SAMMEL-NR: _____   GES-NOM:      0
REDUZ.RU-NOM. : _____                 SUM-NOM:

ANZ-URKUNDEN  LIT      STUECKELUNG  ANZ-URKUNDEN  LIT      STUECKELUNG
_____-_____-  _____  _____  _____  _____  _____
_____-_____-  _____  _____  _____  _____  _____
_____-_____-  _____  _____  _____  _____  _____
_____-_____-  _____  _____  _____  _____  _____

TEXT: _____
_____
_____

-- ID-KZ: 7999230001 -- PW:      ----- B7907495 -- 01/07/19 -- 09:00:00 --

PF4:Abbruch  PF7:Zurück

```

In diese Folgemaske kann der Kunde der CEU vorgeben, in welcher Stückelung die Auslieferung bedient werden soll. Sämtliche Eingaben der Bank auf dieser Maske sind Kann-Eingaben und werden als Wunschvorgabe für die spätere Stückezuweisung aus CARAD interpretiert.

- Einzelurkunden

Mögliche Eingaben zu Einzelurkunden:

LIT (Litera) ist bei Einzelurkunden ein Eingabefeld wird bei Eingabe einer Stückelung zur WKN/ISIN geprüft

ANZ-URKUNDEN\*STUECKELUNG (Eingabe von max. 10 Stückelungsangaben möglich).

Es wird systemseitig geprüft, ob diese Angaben nicht den Nominalbetrag des Auftrages übersteigen. Gleichzeitig werden die in CARAD hinterlegten Stückelungen gegen die gewünschten Stückelungen direkt geprüft.

Im freien Text kann der Erfasser Informationen für den Stückedisponenten eingeben.

- Sammelurkunden

Mögliche Eingaben zu Sammelurkunden:

LIT (Litera) ist bei Sammelurkunden ein reines Anzeigefeld und wird bei Eingabe einer Stückelung mit „\*“ vorbelegt. Dies bedeutet, dass die Zuweisung von Stückenummern mit oder ohne Litera ausschließlich nach dem LIFO-Prinzip erfolgt.

Wenn auf der ersten Seite für das Feld AUSL.-VORG. Der Wert „6“ erfasst wurde, dann wird auf der Stückelungsmaske zusätzlich das Feld REDUZ.RU-NOM. zusätzlich angezeigt. Dort muss die Nominale eingetragen werden, um welche die Rahmennominale der im Feld ORD-NR ausgewählten Rahmenurkunde reduziert werden soll. Bei der Speicherung des Auftrages mit PF3 wird systemseitig geprüft, ob die Rahmennominale der Urkunde eine ausreichende Nominale aufweist, um entsprechend dem Auftrag reduziert zu werden. Eine Rahmennominale kann nicht auf einen Wert kleiner „1“ reduziert werden.

Für die restlichen Maskenfelder gibt es keine Änderungen bzgl. der Eingabemöglichkeiten. Sämtliche Eingaben der Bank auf dieser Maske sind Kann-Eingaben und werden als Wunschvorgabe für die spätere Zuweisung interpretiert.

So kann der Kunde

- eine bestimmte Ordnungs-Nummer/Sammel-Nummer eingeben, wenn sich die Revalutierung auf genau diese Rahmenurkunde beziehen soll

und zusätzlich

- eine Kombination von Anzahl Stückenummern pro Stückelung (max. 10) angeben

und/oder

- Informationen für den Stückedisponenten im freien Text eingeben.

Ohne Eingabe einer Ordnungs-/Sammelnummer wird geprüft, ob die Summe aus dem valuierten Bestand aller in CARAD zur Gattung hinterlegten Rahmenurkunden größer oder gleich der Auftragsnominale (Nominale-Urkunde) ist.

Bei Eingabe einer Ordnungs-/Sammel-Nummer wird geprüft, ob in CARAD eine Rahmenurkunde mit genau dieser Ordnungs-/Sammel-Nummer vorhanden ist und ob deren valuiertes Bestand größer oder gleich der Nominale-Urkunde des Auftrags ist.

Mit diesen Prüfungen wird zumindest für den Zeitpunkt der Auftragserfassung sichergestellt, dass für diesen Revalutierungsauftrag ausreichend valuiertes Bestand vorhanden ist. Eingaben in der Stückelungswunschtable sind nur zulässig, wenn auch eine Ordnungs-/Sammelnummer angegeben wurde. Zusätzlich wird geprüft, dass die Addition der sich ergebenden Teilbeträge aus Anzahl Urkunden \* Stückelung die Nominale-Urkunde des Auftrags ergibt. Ein Abgleich gegen die im CARAD-Bestand tatsächlich hinterlegten Stückelungen der Rahmenurkunde findet dabei nicht statt.

Sind die getätigten Eingaben auf allen Masken plausibel, kann der Auftrag mit Betätigung der PF3-Taste abgespeichert werden.

**(C) Folgemaske: Urkundenwunsch**

|   |                          |                          |              |                  |             |
|---|--------------------------|--------------------------|--------------|------------------|-------------|
| TRAN: KVEW FC: AL SB:   |                          |                          |              |                  |             |
| AUFTRAGSABWICKLUNG  |                          | AUSLIEFERUNG / ERFASSUNG |              | ERFASSUNGSSTATUS |             |
| STUECKELUNGSWUNSCH  |                          |                          |              |                  |             |
| AUFTNR:   | 653003                   | WKN: I DE0006202005      |              | HLG: 01 GS       |             |
| ORD-NR:   | _____ / SAMMEL-NR: _____ | GES-NOM: 10              |              | SUM-NOM:         |             |
| ANZ-URKUNDEN  | LIT                      | STUECKELUNG              | ANZ-URKUNDEN | LIT              | STUECKELUNG |
| _____ 10  | _*                       | _____ 1                  | _____        | ---              | _____       |
| _____   | ---                      | _____                    | _____        | ---              | _____       |
| _____   | ---                      | _____                    | _____        | ---              | _____       |
| _____   | ---                      | _____                    | _____        | ---              | _____       |
| TEXT: _____   |                          |                          |              |                  |             |
| _____   |                          |                          |              |                  |             |
| _____   |                          |                          |              |                  |             |
| -- ID-KZ: 7907123444 -- PW: ----- B79074P4 -- 01/07/19 -- 09:00:00 -- |                          |                          |              |                  |             |
| PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF7:Zurück                               |                          |                          |              |                  |             |

Sofern es dem Eingabe nicht wichtig ist, über welche Urkunden die Auslieferung physisch dargestellt wird, kann er diese Maske ohne Eingaben übergehen.

Anderenfalls werden seine Eingaben als Wunschvorgabe bei der späteren Urkunden Zuweisung berücksichtigt.

Dabei gibt es für den Erfasser folgende Eingabemöglichkeiten:

- Eingabe einer einzelnen Ordnungs- oder Sammelnummer, wenn genau eine eindeutig zu identifizierende Sammelurkunde ausgeliefert werden soll.

oder alternativ

- Eingabe eines Intervalls (Von-Bis) für Ordnungs- oder Sammelnummern, wenn bei der automatischen Zuweisung nur die innerhalb dieser Begrenzung (einschließlich Anfangs- und Endnummer) hinterlegten Sammelurkunden berücksichtigt werden sollen.

oder alternativ

- Eingabe von 1 bis zu 15 unterschiedlichen Urkunden-Nominalen und der Anzahl an Sammelurkunden, die mit der jeweiligen Nominale ausgeliefert werden sollen.

und/oder

- Eingabe von Zusatzinformationen für die Stückedisposition (z. B. Stückenummernkreise) im freien Text.
- Ohne Eingaben zu Ordnungs-/Sammelnummer, Intervall oder Nominalen wird lediglich geprüft, ob die Auftragsnominale mit den in der Hinterlegungsart im Bestand befindlichen Globalurkunden darstellbar ist. D. h. die Summe der Nominale-Sammel aller berücksichtigten Globalurkunden muss gleich oder größer der Auftragsnominale sein.

- Bei Eingabe einer Ordnungs-/Sammelnummer wird geprüft, ob eine Globalurkunde mit dieser Ordnungs-/Sammelnummer in CARAD vorhanden ist. Hinterlegungsart und Wert (Nominale-Sammel) der Urkunde müssen mit den Daten des Auftrages (HLG, Nom-URK) übereinstimmen.
- Bei Eingabe eines Intervalls zu Ordnungs-/Sammelnummern wird überprüft, ob die Summe der Nominale-Sammel aller in CARAD in der Hinterlegungsart vorhandenen und innerhalb des Intervalls liegenden Globalurkunden gleich oder größer als die Nominale-Urkunde des Auftrages ist.
- Bei Eingaben in der Nominalentabelle wird zunächst geprüft, dass die Summierung der Vorgaben aus den Feldern ANZ \* NOM-URK mit der Nominale-Urkunde des Auftrags übereinstimmt. Als Zusatzinformation wird dabei während des Erfassungsvorganges die aus den Vorgaben aktuelle ermittelte Summe im Feld SUM-NOM angezeigt.
- Sind die Vorgaben plausibel, wird pro Nominalangabe überprüft, ob in CARAD mindestens die gewünschte Anzahl an Globalurkunden mit der entsprechenden Nominale in der Hinterlegungsart vorhanden ist.
- Mit der Plausibilisierung gegen CARAD wird nur sichergestellt, dass ausreichend physischer Bestand zur Bedienung des Auslieferungsauftrages vorhanden ist. Eine Prüfung auf Lieferbarkeit der Urkunden wird an dieser Stelle jedoch noch nicht durchgeführt.

Sofern alle Auftragsdaten gültig erfasst worden sind, kann der Auftrag mit PF3 abgespeichert werden.

## 16 Autodispo-Service

### 16.1 Einführung der automat. Valutierung und Revalutierung für Zertifikate, Optionsscheine und definierte Anleihen

CEU bietet mit einem neuen Produkt seinen Kunden die Möglichkeit, für Emissionen von Zertifikaten; Optionsscheinen und definierte Anleihen sowohl eine effiziente und zeitnahe Bestandsdisposition als auch eine möglichst hohe Settlement-Sicherheit für CASCADE-Instruktionen der Auftragsart 01 (WP Übertrag – Wertpapier-Übertrag mit und ohne Gegenwertverrechnung) zu gewährleisten.

Hierdurch ist für die Valutierung bzw. Revalutierung des jeweiligen Emissionsvolumens unter Berücksichtigung der Rahmennominale ein automatisierter straight-through-process (STP) implementiert.

Charakteristisch für den neuen Service ist eine von CEU im Auftrag des Kunden erfolgende automatisierte Disposition der Depotbuchbestände („mark up“ – Valutierung), die durch die jeweils zur Ausführung in CASCADE eingestellten Verkaufsinstruktionen zu börslichen und außerbörslichen Wertpapiergeschäften gesteuert wird. Ein Abräumen („mark down“ – Revalutierung) der zum Ende des Tages vorhandenen Depotbuchbestände stellt zudem sicher, dass vom emissionsbegleitenden Institut nicht verkaufte Anteile nicht auf dem Depotbestandskonto geführt werden.

Clearstream Europe AG wird alle interessierten Kunden, die über eigene Konten in Zertifikate, Optionsscheine und bestimmte Anleihen begeben oder als emissionsbegleitendes Institut darin eingebunden sind, einzeln in dem Prozess der Einführung beraten und begleiten.

**Nähere Auskünfte zum „AutoDispo-Prozess“ erteilt der Clearstream CSD Client Services Core Products and Connectivity.**

## 16.2 Prozessvoraussetzungen

Für den Prozess ausschlaggebende Eckpunkte sind:

- Ein auf den Kunden lautendes CASCADE Hauptkonto.
  - Zugelassene Wertpapiergruppen aus der Klasse der Zertifikate und der verbrieften Optionsscheine sowie definierte Anleihen
  - Der Kunde fungiert als emissionsbegleitendes Institut (EBI) für die berechtigten Gattungen.
  - Die Wertpapiere einer Gattung müssen in einer oder mehreren Bis-Zu Globalurkunden verbrieft sein.
  - Emittenten-Nummer
- Auf dem Hauptkonto dürfen nur Eigenbestände geführt werden. Unterkonten werden nicht berücksichtigt.
- Gattungen, die nach ihren Bedingungen vorübergehend oder dauerhaft besonderen Überwachungspflichten oder Verfügungsbeschränkungen, unterliegen, Namenswertpapiere oder Global Bonds sind generell von der Einbeziehung in den AutoDispo Service ausgeschlossen.
- Gattungen, die für den neuen Prozess zugelassen wurden, können sowohl durch die automatische Generierung als auch über die herkömmliche Auftragserteilung valuiert und revaluiert werden.
- Für den neuen Service-Prozess stehen die standardisierten CASCADE Auswertungen und Reports zur Verfügung. Via Swift können die MT535 Bestandsmeldungen sowie MT536 Settlement-Statements zur Verfügung gestellt werden (siehe Connectivity Handbuch 2.1.5 ff).
- Für die CASCADE Auftragsarten 16 und 18 können von CEU-Kunden LIMA - Queries angefordert werden (siehe CEU Connectivity Handbuch).

# 17 Änderung/Löschung (EB)

## 17.1 Änderung von Aufträgen

### (A) Allgemeine Beschreibung

Ein Auftrag kann im Erfassungsstatus nur dann geändert werden, wenn er noch nicht kontrolliert oder wenn er bei der Kontrolle als fehlerhaft gekennzeichnet wurde. Es können sowohl bereits vorhandene Daten durch Überschreiben der alten Feldinhalte geändert als auch neue Daten durch Füllen leerer Felder hinzugefügt werden.

Mit diesem Vorgang werden auch die im Auftragsstatus zur Änderung markierten und daraufhin in den Erfassungsstatus generierten Aufträge bearbeitet. Dies beinhaltet ebenfalls die von der CEU als fehlerhaft an die Bank zurück generierten Aufträge. Diese müssen zumindest zur Änderung geöffnet werden und wieder gespeichert und danach kontrolliert werden. Eine direkte Kontrolle ist nicht möglich. Ob der Auftrag aber vor der erneuten Kontrolle wirklich geändert wurde, wird nicht geprüft. Über die Funktion Änderung im Erfassungsstatus können auch unvollständig erfasste Aufträge über die Auftragsnummer weitererfasst werden. Die Eingabe erfolgt analog der Ersterfassung.

### (B) Hauptauswahl Änderung/Löschung Erfassungsstatus Wertebereich

```
TRAN: KVEB FC: SB: #
AUFTRAGSABWICKLUNG A E N D E R U N G / L O E S C H U N G ERFASSUNGSSTATUS
                     W E R T E B E R E I C H
AN  AENDERUNG EINES AUFTRAGES      : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
AF  AENDERUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE
LN  LOESCHUNG EINES AUFTRAGES      : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
LF  LOESCHUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE
ET  BEARBEITEN TEXT ZUR URKUNDE    : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
-- ID-KZ: 7999260001 -- PW:          ----- B7907497 -- 19/10/06 -- 11:23:07 --
EA0395F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch
```

Abbildung 17.1 Hauptauswahl Änderung/Löschung Erfassungsstatus Wertebereich

Die Funktion ET ist den Mitarbeitern der CEU vorbehalten und kann von Kunden nicht beantragt werden.

### 17.1.1 Änderung fehlerhafter Aufträge (AF)

**(A) Allgemeine Beschreibung**

Mit dem Einstieg „AF“ werden alle vom Kontrolleur als fehlerhaft gekennzeichneten Aufträge angezeigt. Zunächst erfolgt die tabellarische Kurzanzeige aller fehlerhaften Aufträge. Diese sind sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung. Hier können nur die buchungsrelevanten Felder wiedergegeben werden. Mit Ausnahme des Feldes KZ sind alle Felder gesperrt, d. h. in dieser Kurzanzeige kann nicht geändert werden.

**(B) Tabellarische Anzeige/Änderung Erfassungsstatus**

```

TRAN: KVEB FC: AF SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRÄGE / ÄNDERUNG          ERFASSUNGSSTATUS
                               SEITE 1
KZ PRIM  AUFTR-NR LAST-KTO GUT-KTO  WKN          NOMINALE
-   653   6530000 7960 000 7930 000 DE0007224008          1.000

-- ID-KZ: 7930200002 -- FW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:03:11 --
PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 17.2 Tabellarische Anzeige/ Änderung Erfassungsstatus

**Eingebbare Kennzeichen (KZ):**

„I“ Selektion des Auftrages zur Vollanzeige

„X“ Selektion des Auftrages zur Änderung

Es ist jeweils nur ein „I“ bzw. ein „X“ auf einer Maskenseite erlaubt, d.h. es können nicht gleichzeitig mehrere Aufträge zur Vollanzeige selektiert werden.

„X“ und „I“ dürfen auch nicht miteinander kombiniert werden.

Der einzige Unterschied zwischen „X“ und „I“ besteht darin, dass man nach „I“ nicht ändern kann, während man nach „X“ den Auftrag in der Vollanzeige ändern darf.

**(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige**

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an. Da es sich bei allen Aufträgen um fehlerhafte Aufträge handelt, wird das Kennzeichen immer leer angezeigt.

Zur Änderung wird der gewünschte Auftrag durch Eingabe eines „X“ in der Spalte KZ der entsprechenden Zeile ausgewählt.

**(D) Vollanzeige/Änderung Erfassungsstatus**

```

TRAN: KVEB FC: AF SB: I##
AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / INFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                          NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG
PRIMANOTE:      1          AUFTNR:      8112          HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7961 200      CBF TR. B. SVG BIS-ZU URK. GS
GUT-KTO  : 7930 000      TESTBANK
WKN       : I DE0006305006 DEUTZ AG O.N.

NOMINALE :      3.000      EINHEIT: ST      ST-ART:
NOM-URK   :      3.000      EINLIEF-ART : 4  NEUZULASSUNG VAL. RU
RAHMEN-NOM:      21.000      ORD-NR       :      1
SET-DAY   : 08.11.2023      EINLIEF-GRUND: 1 AUS EMISSION
KUNDENREFERENZ :      -      -      KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE:

BEARB-STATUS: 100 EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor

```

Abbildung 17.3 Vollanzeige/ Änderung Erfassungsstatus

Diese Maske gilt ebenfalls für die Auftragsarten Neuzulassung/Aufstockung, Valutierung. In dieser Vollanzeige sowie der Vollanzeige für die Folgemasken können jetzt die vorgesehenen Änderungen eingegeben werden. Neben der Prüfung, ob alle Mussfelder vorhanden sind, werden die Eingaben auf formale Richtigkeit und auf gültige Abhängigkeiten zueinander geprüft. Gleiches gilt für die Kennzeichen zur Bearbeitung der Stücknummern in den Einlieferungsaufträgen.

**Hinweis:** Sind in einem Auftrag bereits Stücknummern erfasst, dann können die Auftragsnummer, WKN/ISIN, der Einlif-Grund und die zugehörige Stückelung nicht mehr geändert werden. Nach der Verarbeitung mit PF3 kehrt das System zur tabellarischen Kurzanzeige zurück, in der der Benutzer den nächsten zu ändernden Auftrag auswählen kann. Nach der Änderung eines fehlerhaften Auftrages wird dieser Auftrag aus der tabellarischen Anzeige entfernt, da er jetzt nicht mehr als fehlerhaft gilt. Sind alle fehlerhaften Aufträge abgearbeitet, kehrt das System automatisch in die Menümaske zurück.

**Sonderfall:**

Wurde ein Auftrag von der CEU-Prüfstelle mit der Nachweisart = „2“ (Urkunden liegen vor) zurückgewiesen, dann ist das Feld nicht zu ändern. Die Urkunden wurden nicht an den Einreicher zurückgegeben, der Auftrag muss allerdings vom Kunden in Abstimmung mit CEU abgepasst werden.

**17.1.2 Änderung eines Auftrages über die Auftragsnummer (AN)****(A) Allgemeine Beschreibung**

Kennt der Benutzer die Auftragsnummer des zu ändernden Auftrages, steigt er mit dem Transaktionscode KVEB und dem Funktionscode „AN“ sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erfolgt die Vollanzeige aller bisher gespeicherten Daten dieses Auftrages.

Unter „AN“ sind folgende Aufträge änderbar:

- Ein noch nicht kontrollierter Auftrag
- Ein in der Kontrolle als fehlerhaft markierter Auftrag
- Ein aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag
- Ein noch nicht vollständig erfasster Auftrag

**(B) Hauptauswahl Änderung/Löschung Erfassungsstatus Wertebereich**

```

TRAN: KVEB FC: an SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG      A E N D E R U N G / L O E S C H U N G      ERFASSUNGSSTATUS
                          W E R T E B E R E I C H
AN  AENDERUNG EINES AUFTRAGES      : 5010014.. (AUFTRAGS-NUMMER)
AF  AENDERUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE
LN  LOESCHUNG EINES AUFTRAGES      : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
LF  LOESCHUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE

-- ID-K2: 7930230003 -- PW:          ----- B7930497 -- 19/11/01 -- 11:39:05 --
KV0003I Verarbeitung abgebrochen
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 17.4 Hauptauswahl Änderung/ Löschung Erfassungsstatus

**(C) Änderung Kennzeichen SAMMELURKUNDE (J/N)**

Wenn innerhalb eines Einlieferungsauftrages irrtümlich eine Sammelurkunde anstelle von Einzelurkunden (oder umgekehrt) erfasst wurde, dann ist es möglich, das Kennzeichen SAMMELURKUNDE J/N zu ändern, ohne den gesamten Auftrag löschen zu müssen.

Um dieses Kennzeichen ändern zu können, ist es allerdings erforderlich, zuerst die erfassten Stückenummern bzw. die ggfs. erfasste Ordnungsnummer zu löschen.

Nach erfolgter Änderung des Kennzeichens können die Stückenummern direkt wieder erfasst werden.

## 17.2 Löschung von Aufträgen

Ein Auftrag kann im Erfassungsstatus nur dann gelöscht werden, wenn er noch nicht kontrolliert, wenn er bei der Kontrolle als fehlerhaft gekennzeichnet wurde oder wenn durch CEU der Auftrag zurückgestellt wurde.

```

TRAN: KVEB FC:      SB: #

AUFTRAGSABWICKLUNG  A E N D E R U N G / L O E S C H U N G  ERFASSUNGSSTATUS
                       WERTEBEREICH

AN  AENDERUNG EINES AUFTRAGES      : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
AF  AENDERUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE

LN  LOESCHUNG EINES AUFTRAGES      : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
LF  LOESCHUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE

ET  BEARBEITEN TEXT ZUR URKUNDE    : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)

-- ID-KZ: 7999260001 -- FW:          ----- B7907497 -- 19/10/06 -- 11:23:07 --
EA0395F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch

```

Abbildung 17.5 Löschung von Aufträgen

### 17.2.1 Löschung fehlerhafter Aufträge (LF)

#### (A) Allgemeine Beschreibung

Mit dem Einstieg "LF" werden alle vom Kontrolleur als fehlerhaft gekennzeichneten Aufträge angezeigt. Zunächst erfolgt die tabellarische Kurzanzeige aller fehlerhaften Aufträge. Diese sind sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung. Hier können nur die buchungsrelevanten Felder wiedergegeben werden. Mit Ausnahme des Feldes KZ sind alle Felder gesperrt. Nur hier in der Kurzanzeige können Aufträge gelöscht, d. h. Löschkennzeichen in den entsprechenden Zeilen gesetzt werden.

**Hinweis:** Aufträge, die durch CEU-Prüfstelle in den CASCADE-Erfassungsstatus zurückgestellt wurden, können dort nicht direkt gelöscht werden. Solche Aufträge müssen zunächst kontrolliert, danach im Auftragsstatus zur Löschung in den Erfassungsstatus generiert und dort endgültig gelöscht werden.

#### Sonderfall:

Ein von der CEU-Prüfstelle zurückgegebener Auftrag, kann nicht direkt gelöscht werden, sondern muss geändert und kontrolliert werden. Sind die physischen Urkunden durch CEU zurückgegeben worden, kann der Auftrag zur Löschung generiert werden.

**(B) Tabellarische Anzeige/Löschung Erfassungsstatus**

```

TRAN: KVEB FC: LF SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / LOESCHUNG          ERFASSUNGSSTATUS
                                SEITE 1
KZ PRIM  AUFTR-NR  LAST-KTO  GUT-KTO  WKN          NOMINALE
-   653   6530000  7960 000  7930 000  DE0007224008          1.000

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:04:45 --
PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 17.6 Tabellarische Anzeige/Löschung Erfassungsstatus

**Eingebbare Kennzeichen (KZ):**

„I“ - Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

„X“ - Löschung des Auftrages

Es darf jeweils nur ein „I“ auf einer Maskenseite eingegeben werden, da nur ein Auftrag zur Vollanzeige selektiert werden kann.

„X“ und „I“ dürfen nicht miteinander kombiniert werden.

Es ist jedoch möglich, mehrere Aufträge auf einer Seite mit „X“ zur Löschung zu kennzeichnen.

**(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige**

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an. Da es sich bei allen Aufträgen um fehlerhafte Aufträge handelt, wird das Kennzeichen immer leer angezeigt.

**17.2.2 Löschung eines Auftrages über die Auftragsnummer (LN)**

Kennt der Benutzer die Auftragsnummer des zu löschenden Auftrages, steigt er mit dem Transaktionscode KVEB und dem Funktionscode „LN“ sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erfolgt die tabellarische Kurzanzeige der buchungsrelevanten Daten dieses Auftrages.

Im Unterschied zur Änderung eines einzelnen Auftrages wird bei der Löschung über den Einstieg „LN“ die tabellarische Form des Auftrages angezeigt, da nur dort das Löschkennzeichen gesetzt werden kann.

**Unter „LN“ können folgende Aufträge gelöscht werden:**

- ein noch nicht kontrollierter Auftrag,
- ein in der Kontrolle als fehlerhaft markierter Auftrag.

## 18 Information (EI)

Im Informationsdienst des Erfassungsstatus können sich die Teilnehmer über selbst eingestellte Aufträge Ein- und Auslieferungen informieren. Es besteht nicht die Möglichkeit, von hier aus zu ändern oder zu löschen.

Es werden hier nur Beispielmasken für den Informationsdienst angeboten. Die Masken entsprechen den Masken aus dem Erfassungsstatus.

### Der Informationsdienst bietet folgende Möglichkeiten:

Anzeige des Bearbeitungsstatus eines Auftrages (nicht kontrolliert/fehlerhaft/vollständig erfasst/teilerfasst/zurückgegeben),

- Tabellarische Kurzanzeige mehrerer Aufträge,
- Vollanzeige eines Auftrages mit allen erfassten Informationen,
- Online Druck mit allen erfassten Informationen zu einem Auftrag in der Vollanzeige.

```
TRAN: KVEI FC: SB: #####
AUFTRAGSABWICKLUNG          I N F O R M A T I O N          ERFASSUNGSSTATUS

AA  ALLE AUFTRAEGE
AF  ALLE FEHLERHAFTEN AUFTRAEGE

NR  AUFTRAGS-NUMMER   : .....
PN  PRIMANOTEN-NUMMER : ....
LK  LASTSCHRIFT-BANK  : ....
GK  GUTSCHRIFT-BANK   : ....

ZUSAETZLICHE AUSWAHL - WKN : . .....

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:05:33 --
KV0013F Feld muß einen der angeseigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch
```

Abbildung 18.1 Informationsdienst des Erfassungsstatus

### Folgende Funktionen (FC) sind möglich:

- AA - Alle Aufträge
- AF - Alle fehlerhaften Aufträge
- NR - Auswahl nach Auftragsnummer
- PN - Auswahl nach Primanoten-Nummer
- LK - Auswahl nach Lastschrift-Bank

GK - Auswahl nach Gutschrift-Bank

**(A) Allgemeine Beschreibung**

Bei allen Abfragen erfolgt zuerst eine tabellarische Anzeige aller mit dem Funktionscode übereinstimmenden Aufträge. Angezeigt wird immer der aktuelle Zustand des Auftrages, da im Erfassungstatus keine Historie geführt wird.

Bereits kontrollierte Aufträge sind aus dem Erfassungstatus des Eingebers in den CASCADE-Auftragsstatus CEU übergegangen und werden im Informationsdienst des Erfassungstatus nicht mehr angezeigt.

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an.

**Möglicher Bearbeitungsstatus:**

- „ “ - nicht kontrollierter Auftrag
- „F“ - fehlerhafter Auftrag
- „A“ - aus dem Auftragsstatus zum Ändern generiert
- „L“ - aus dem Auftragsstatus zum Löschen generiert

**Hinweis:** Beim Einstieg über den Funktionscode „AF“ (fehlerhafte Aufträge) werden alle Aufträge (Ein- bzw. Auslieferungen) mit dem Bearbeitungszustand “ “ angezeigt, der in diesem speziellen Fall für fehlerhafte Aufträge steht.

**(B) Tabellarische Anzeige/Information Erfassungstatus**

```

TRAN: KVEI FC: AF SB: I##
AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / INFORMATION          ERFASSUNGSSTATUS
                                                                    SEITE  1
K PRIM  AUFTNR LAST  GUT WKN          NOMINALE          GEGENWERT
653    6530000  7960 7930 DE0007224008          1.000
653    6530001  7960 7930 DE0007224008          1.000.000

GESAMTSUMMEN ANZAHL AUFTRAEGE:      2          1.001.000
-- ID-KZ: 7930200002 -- FW:          ----- B7930498 -- 16/10/02 -- 11:07:13 --
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 18.2 Tabellarische Anzeige Erfassungstatus

**Eingebbares Kennzeichen (K):**

- „I“ - Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit „I“ überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, ggf. über mehrere Masken (für bestimmte Auftragsarten).

**(C) Vollanzeige von Aufträgen/Information Erfassungsstatus****(C1) Beispielmaste "Lfd. Einlieferung" (gilt für andere Unterauftragsarten entsprechend)**

```

TRAN: KVEI FC: NR SB: 000651655##

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / INFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                          LFD. EINLIEFERUNG
PRIMANOTE: 651           AUFTNR: 651655           HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 000      CBF TRESORBESTAND GS
GUT-KTO  : 7930 000      TESTBANK
WKN       : I DE0005035505 ALLGAEUER BRAUHAUS

NOMINALE :           30      EINHEIT: ST      ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :           30      EINLIEF-ART : 1  LFD. EINLIEFERUNG
                          EINLIEF-GRUND:

KUNDENREFERENZ          :      -      -      KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE:

BEARB-STATUS: 10 EINLIEFERUNG TEILERFASST - ZU WENIG STUECKE

PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF8:Vor

```

Abbildung 18.3 Beispielmaste Information Einlieferung

Von der Vollanzeige aus kann mittels PF2 ein Online Druck des angezeigten Auftrages erfolgen. Wenn die Vollanzeige sich über mehrere Masken erstreckt, werden alle Maskeninhalte ausgedruckt, unabhängig davon, in welcher Maske der Online Druck initiiert wurde. Dafür muss der Bildschirm leitungsbezogen dem Drucker zugeordnet sein.

```

TRAN: KVEI FC: NR SB: 006530000

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / FOLGEINFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                          LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR: 6530000           WKN: I DE0007224008
                          HLG: 01 GS

VERWAHR-MOEGlichkeit    : 9 GIROSAMMELVERW.
BESONDERHEIT            :
ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG : 0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG

NAECHSTER KUPON         :           16      LETZT. KUPON :           20
UEBERF KUPON            VON :           BIS :
NACHWEISART: 1 EINLIEF. EFF. URK.      SAMMELKUNDE : N (J/N)

TEXT:

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:           ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:22:00 --

PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF7:Zurück PF8:Vor

```

Abbildung 18.4 Vollanzeige Information Einlieferung

**Hinweis:** Handelt es sich bei der WKN/ISIN um einen Optionsschein, wird anstelle des „nächster Kupon“ der „nächste Leg-Schein“ und anstelle des „letzt. Kupon“ der „letzte Leg-Schein“ angezeigt.

```

TRAN: KVEI FC: NR SB: 006530000

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / STUECKINFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                          LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR      :      6530000                GES-NOM      :      2.000
WKN         : I DE0007224008            ANZ-URK:      100 SUMME-NOM:      2.000
STCKL       :                          10          SCHRITTWEITE:
SERIEN-WKN:
KZ STUECKENUMMERN

                               MAN MAN E
                               GEL GEL

          99996001-100, .*

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:22:20 --
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF7:Zurück PF8:Vor
    
```

Abbildung 18.5 Detailanzeige Information Einlieferung (1/2)

**Hinweis:** CASCADE verarbeitet unterschiedliche Stückelungen in einem Einlieferungsauftrag in absteigender Reihenfolge. Die zugehörigen Urkunden müssen in dieser Reihenfolge bei der CEU eingeliefert werden.

```

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / STUECKINFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                          LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR      :      6530000                GES-NOM      :      2.000
WKN         : I DE0007224008            ANZ-URK:      1000 SUMME-NOM:      2.000
STCKL       :                          1          SCHRITTWEITE:
SERIEN-WKN:
KZ STUECKENUMMERN

                               MAN MAN E
                               GEL GEL

          99990001-100, .*
          99990101-200, .*
          99990201-300, .*
          99990301-400, .*
          99990401-500, .*
          99990501-600, .*
          99990601-700, .*
          99990701-800, .*
          99990801-900, .*
          99990901-1000, .*

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:22:39 --
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF7:Zurück
    
```

Abbildung 18.6 Detailanzeige Information Einlieferung (2/2)

**Hinweis:** Wird ein Auftrag ausgewählt, der zwischenzeitlich oppositionsbelegte Stückenummern enthält, zeigt CASCADE diese mit dem Oppositionsgrund im Feld Mangel 1 hell erleuchtet an.

Zusätzlich wird bei einem Online Druck die Anzahl der vorkommenden Oppositionen, die in der Hinweiszeile auf der Basismaske buchungsrelevanter Auftragsdaten angegeben sind, ausgedruckt.

Leerseite

## 19 Kontrolle (EC)

Um die erfassten Aufträge verbindlich an die Clearstream Europe AG zu erteilen, muss das Vier-Augen-Prinzip gewahrt werden, d. h. die vom Erfasser in das System eingegebenen Ein- und Auslieferungen werden von einer zweiten Person kontrolliert. Vom System wird sichergestellt, dass der Kontrolleur ein vom Erfasser abweichendes ID-KZ hat.

**Die Kontrolle bietet für den Effektivbereich folgende Möglichkeiten:**

- Kontrolle über Vollanzeige
- Kontrolle über Kurzanzeige

Im Rahmen der Zuordnung von Funktionen zu Transaktionen durch Ihren Security-Beauftragten wird die Art der Kontrolle von Aufträgen festgelegt.

```
TRAN: KVEC FC: TA SB: I#
AUFTRAGSABWICKLUNG           K O N T R O L L E           ERFASSUNGSSTATUS
                               WERTEBEREICH
VOLLANZEIGE                   TABELLARISCHE KURZANZEIGE
VA ALLE AUFTRAEGE             TA ALLE AUFTRAEGE
VN AUFTRAGS-NUMMER : .....  TN AUFTRAGS-NUMMER : .....
VP PRIMANOTEN-NUMMER : ..... TP PRIMANOTEN-NUMMER : .....
VL LASTSCHRIFT-BANK : .....  TL LASTSCHRIFT-BANK : .....
VG GUTSCHRIFT-BANK : .....   TG GUTSCHRIFT-BANK : .....
                               ZUSAEZTLICHE AUSWAHL - WKN : I .....
-- ID-KZ: 7930200001 -- PW:          ----- B7930494 -- 16/10/02 -- 11:19:01 --
KV0009I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch
```

Abbildung 19.1 Auswahlanzeige Kontrolle

Zusätzliche Eingaben sind zu den folgenden Funktionscodes notwendig:

„VN“/„TN“= AUFTRAGS-NUMMER

„VP“/„TP“= PRIMANOTEN-NUMMER

„VL“/„TL“ = LASTSCHRIFT-BANK

„VG“/„TG“ = GUTSCHRIFT-BANK

Zusätzlich ist die Eingabe einer WKN/ISIN bei allen Funktionscodes erlaubt und bewirkt die Einschränkung der zu bearbeitenden Aufträge auf eine bestimmte Gattung.

## 19.1 Kontrolle über die Vollanzeige

### (A) Allgemeine Beschreibung

Ausgehend von der Hauptauswahl gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes 'EC' in das Menü Kontrolle.

Kontrolle über Vollanzeige bedeutet, dass dem Kontrolleur alle zu den eingegebenen Auswahlkriterien gefundenen Aufträge (sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung) hintereinander mit allen gespeicherten Daten angezeigt werden. So hat er die Möglichkeit, alle Daten eines Auftrages zu überprüfen. Erst auf der letzten Seite eines Auftrages erscheint das Feld für das Kontrollkennzeichen.

Die verschiedenen Funktionscodes für die Vollanzeige unterscheiden sich lediglich im Umfang der ausgewählten Aufträge.

**Hinweis:** Ein kontrollierter Einlieferungsauftrag wird mit dem Übergang in den Auftragsstatus automatisch für die Disposition und Buchung bei der Clearstream Europe AG gesperrt. Der Verwahrer gibt den Auftrag nach erfolgreicher Prüfung der Stücke frei.

Es können nur Einlieferungen kontrolliert werden, die vollständig erfasst sind.

In der Vollanzeige der Kontrolle wird bei oppositionsbelegten Stücken eine entsprechende Meldung für die im Auftrag enthaltenen Oppositionsstücke ausgegeben. Die Kontrolle eines Auftrages, in dem Oppositions- Stücke enthalten sind, ist nicht möglich.

Angabe der Primanoten-Nummer „0“ bei Einstieg mit dem Funktionscode „VP“ bedeutet, dass alle Aufträge angezeigt werden, die keiner Primanote zugeordnet sind.

Innerhalb eines Auftrages, der über mehrere Seiten geht, bewegt sich der Kontrolleur mit PF8 vorwärts bzw. mit PF7 rückwärts. Wenn er auf der letzten Seite das Kontrollkennzeichen setzt, drückt er PF3 zur Verarbeitung.

Es folgt die erste Seite des nächsten zu kontrollierenden Auftrages.

**(B) Vollanzeige eines zu kontrollierenden Auftrages (VG)****(B1) Beispielmaske für lfd. Einlieferung (gilt entsprechend für alle Auftragsarten)**

```

TRAN: KVEC FC: VG SB: 000651655#####

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / KONTROLLE      ERFASSUNGSSTATUS
                          LFD. EINLIEFERUNG
PRIMANOTE: 651          AUFTNR: 651655          HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 000      CBF TRESORBESTAND GS
GUT-KTO  : 7930 000      TESTBANK
WKN       : I DE0005035505 ALLGAEUER BRAUHAUS

NOMINALE :          30      EINHEIT: ST      ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :          30      EINLIEF-ART : 1  LFD. EINLIEFERUNG
                          EINLIEF-GRUND:

KUNDENREFERENZ          :      -      -      KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE:

BEARB-STATUS: 10 EINLIEFERUNG TEILERFASST - ZU WENIG STUECKE

PF2:Druck  PF4:Abbruch  PF8:Vor

```

Abbildung 19.2 Vollanzeige eines zu kontrollierenden Auftrages

## Folgemaske 1:

```

TRAN: KVEI FC: NR SB: 006530000

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / FOLGEINFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                          LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR: 6530000          WKN: I DE0007224008
                          HLG: 01 GS

VERWAHR-MOEGlichkeit    : 9 GIROSAMMELVERW.
BESONDERHEIT           :
ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG : 0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG

NAECHSTER KUPON        :          16          LETZT. KUPON :          20
UEBERF KUPON          VON :          BIS          :

NACHWEISART: 1 EINLIEF. EFF. URK.          SAMMELURKUNDE : N (J/N)

TEXT:

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:24:50 --

PF2:Druck  PF3:Ruecksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurueck  PF8:Vor

```

Abbildung 19.3 Folgemaske 1 der Vollanzeige eines zu kontrollierenden Auftrages

Letzte Maske eines Einlieferungsauftrages:

```

TRAN: KVEI FC: NR SB: 006530000

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / STUECKINFORMATION      ERFASSUNGSSTATUS
                        LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR   :   6530000                GES-NOM   :           2.000
WKN      : I DE0007224008          ANZ-URK:   100 SUMME-NOM:   2.000
STCKL    :                          10                SCHRITTWEITE:
SERIEN-WKN:
KZ STUECKENUMMERN

                        MAN MAN E
                        GEL GEL

99996001-100, .*

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:25:05 --
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
    
```

Abbildung 19.4 Folgemaske 2 der Vollanzeige eines zu kontrollierenden Auftrages

**Eingebbare Kennzeichen (KZ):**

- „K“ - Der Auftrag ist kontrolliert und wird nach PF3 als verbindlicher Auftrag an die CEU übergeben.
- „F“ - Der Auftrag ist fehlerhaft und verbleibt im Erfassungsstatus.
- „ “ - Der Auftrag ist noch nicht kontrolliert.

**(C) Feldeingabemöglichkeiten und Abhängigkeitsprüfungen**

Im Feld „Kontrollkennzeichen“ (KZ) wird der Bearbeitungszustand des Auftrages angezeigt.

**Sonderfall:**

Ein von der CEU-Prüfstelle zurückgegebener Auftrag, kann nicht direkt gelöscht werden, sondern muss geändert und kontrolliert werden. Sind die Urkunden durch CEU zurückgegeben worden, kann der Auftrag zur Löschung generiert werden.

**Mögliche Bearbeitungsstatus:**

- „ “ - nicht kontrollierter Auftrag
- „F“ - fehlerhafter Auftrag
- „A “ - aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag
- „L“ - aus dem Auftragsstatus zur Löschung generierter Auftrag

Einziges eingabefähiges Feld auf der letzten Seite eines Auftrages ist das Kontrollkennzeichen.

Nach PF3 wird die erste Seite des nächsten Auftrages mit einer Verarbeitungsbestätigung für den vorherigen Auftrag angezeigt.

## 19.2 Kontrolle über die tabellarische Kurzanzeige

### (A) Allgemeine Beschreibung

Ausgehend von der Hauptauswahl gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes „EC“ in das Menü Kontrolle.

Kontrolle über tabellarische Kurzanzeige bedeutet, dass dem Kontrolleur alle zu den eingegebenen Auswahlkriterien gefundenen Aufträge (sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung) in tabellarischer Form angezeigt werden. Diese Form der Kontrolle ist angebracht, wenn die buchungsrelevanten Daten der Aufträge für die Kontrolle ausreichen. Auf einer Seite der tabellarischen Kurzanzeige können die Aufträge dann entweder als Einzel- oder Blockkontrolle freigegeben werden.

Die verschiedenen Funktionscodes für die tabellarische Kurzanzeige unterscheiden sich lediglich im Umfang der ausgewählten Aufträge.

**Hinweis:** Die Angabe der Primarnoten-Nummer „0“ bei Einstieg mit dem Funktionscode „P“ bedeutet, dass alle Aufträge angezeigt werden, die keiner Primarnote zugeordnet sind.

In der tabellarischen Kurzanzeige werden die selektierten Aufträge sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung zur Verfügung gestellt.

### (B) Tabellarische Anzeige der zu kontrollierenden Aufträge

| TRAN: KVEC FC: TA SB: I# |      |          |          |                      |      |          |              |                  |  |
|--------------------------|------|----------|----------|----------------------|------|----------|--------------|------------------|--|
| AUFTRAGSABWICKLUNG       |      |          |          | AUFTRÄGE / KONTROLLE |      |          |              | ERFASSUNGSSTATUS |  |
| SEITE 1                  |      |          |          |                      |      |          |              |                  |  |
| KZ                       | PRIM | AUFTR-NR | LAST-KTO | GUT-KTO              | WKN  | NOMINALE |              |                  |  |
|                          | 0    | 21062    | 7960     | 217                  | 7930 | 000      | DE0008400003 | 1.012            |  |
|                          | 0    | 21064    | 7960     | 217                  | 7930 | 000      | DE0008400003 | 20               |  |
|                          | 0    | 21065    | 7960     | 217                  | 7930 | 000      | DE0008400003 | 1                |  |
| -                        | 0    | 21061    | 7960     | 217                  | 7930 | 000      | DE0008400003 | 11               |  |
|                          | 0    | 21063    | 7960     | 217                  | 7930 | 000      | DE0008400003 | 448              |  |
| F                        | 653  | 6530001  | 7960     | 000                  | 7930 | 000      | DE0007224008 | 1.000.000        |  |
| L                        | 653  | 6530000  | 7960     | 000                  | 7930 | 000      | DE0007224008 | 2.000            |  |
| A                        | 653  | 650001   | 7961     | 000                  | 7930 | 000      | DE0007616765 | 100.000          |  |
| A                        | 653  | 650002   | 7961     | 000                  | 7930 | 000      | DE0007616773 | 100.000          |  |

KONTROLLKENNZEICHEN:

-- ID-KZ: 7930200001 -- FW: ----- B7930494 -- 16/10/02 -- 11:25:36 --

PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch

Abbildung 19.5 Tabellarische Anzeige der zu kontrollierenden Aufträge

**Hinweis:** Im Feld „Kontrollkennzeichen“ (KZ) wird der Bearbeitungsstatus des Auftrages angezeigt.

#### Mögliche Ausprägungen:

- „ “ - nicht kontrollierter Auftrag
- „F“ - fehlerhafter Auftrag
- „A “ - aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag
- „L“ - aus dem Auftragsstatus zur Löschung generierter Auftrag

## 19.2.1 Kontrollvorgänge

Die angezeigten Aufträge können nun einzeln (Kennzeichen vor jedem einzelnen Auftrag) oder als Block (Kontrollkennzeichen am Ende der Tabelle) kontrolliert werden. Der Kontrolleur kann beide Möglichkeiten mischen, d. h. er kann eine Seite als Block und die nächste Seite mit Einzelkontrollen bearbeiten.

### (A) Feldeingabemöglichkeiten und Abhängigkeitsprüfungen

Eingabefähige Felder auf dieser Maske sind die Kontrollkennzeichen am Anfang jeder Zeile der Tabelle (für die Einzelkontrolle) sowie das Kontrollkennzeichen unterhalb der Tabelle (für die Blockkontrolle). Folgende Eingaben im Feld Kontrollkennzeichen (KZ) in der ersten Spalte sind möglich:

#### Eingebare Kontrollkennzeichen:

- „K“ - Der Auftrag ist kontrolliert und wird nach PF3 als verbindlicher Auftrag an die CEU übergeben.
- „I“ - Vollanzeige eines einzelnen Auftrages zur Information
- „F“ - Der Auftrag ist fehlerhaft und verbleibt im Erfassungsstatus.
- „ “ - Der Auftrag ist noch nicht kontrolliert.

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur ein „I“ eingeben. Außerdem darf „I“ nicht mit anderen Eingaben kombiniert werden, z. B. mit einem „F“ in einer Zeile oder einem „K“ im Kennzeichen Gesamtkontrolle. Es ist jedoch möglich, ein „I“ einzugeben, wenn beim ersten Einstieg in die tabellarische Anzeige ein bereits als fehlerhaft gekennzeichnete Auftrag mit „F“ erscheint und somit überschrieben wird.

Jedoch können mehrere Aufträge der Tabelle mit „F“ bzw. „K“ gekennzeichnet werden, d. h. diese beiden Eingaben sind miteinander kombinierbar.

Werden in den einzelnen Zeilen Aufträge mit „K“ gekennzeichnet, darf das Kennzeichen Gesamtkontrolle nicht gesetzt werden.

Einzige Eingabemöglichkeit für das Kennzeichen Gesamtkontrolle ist „K“ für Kontrolle aller Aufträge dieser Seite. Einzelne Aufträge kann man von dieser Kontrolle ausnehmen, indem man sie in der Zeile mit „F“ kennzeichnet.

#### Eingebbares Kontrollkennzeichen bei Blockkontrolle:

- „K“ - Alle Aufträge dieser Seite (mit Ausnahme der mit „F“ gekennzeichneten) sind damit kontrolliert und werden nach PF3 verbindlich an die CEU übergeben.

#### Kombination Einzelkontrolle/Blockkontrolle:

In bestimmten Fällen können sowohl in den Zeilenkennzeichen als auch im Kennzeichen Blockkontrolle Eingaben gemacht werden.

Will der Benutzer auf einer Seite nur einen Posten kontrollieren, dann setzt er vor dem gewünschten Auftrag ein „K“.

Will er auf einer Seite einen Posten als fehlerhaft kennzeichnen, während alle anderen Posten kontrolliert werden sollen, setzt er vor dem fehlerhaften Auftrag ein „F“ und in das Kontrollkennzeichen unter der Tabelle ein ““K“.

Soll auf einer Seite ein Auftrag als unkontrolliert stehen bleiben, während alle anderen Aufträge kontrolliert werden können, so muss er vor jedem kontrollierten Auftrag ein „K“ setzen, während das Kontrollkennzeichen des unkontrollierten Auftrages leer bleibt.

Nach PF3 blättert das System auf die nächste Seite der tabellarischen Anzeige mit weiteren zu kontrollierenden Aufträgen. Auf dieser Seite wird die Verarbeitung der vorherigen Seite bestätigt. Wenn PF3 auf der letzten Seite gedrückt wird, kehrt das System zum Menü der Kontrolle zurück und gibt ebenfalls eine Verarbeitungsbestätigung aus.

Jeder mit „F“ gekennzeichnete Auftrag bleibt im Erfassungsstatus stehen und muss vom Erfasser mit dem Vorgang „Änderung im Erfassungsstatus (EB)“ berichtet werden. Alle kontrollierten Aufträge werden verbindlich an die CEU übergeben.

Ein von der CEU-Prüfstelle zurück gestellter Auftrag kann nicht direkt wieder kontrolliert werden. Dies kann erst nach Durchführung einer Änderung ausgeführt werden.

Nach erfolgter Kontrolle geht der Auftrag vom Erfassungs- in den Auftragsstatus über.

## 19.3 Automatische Löschung von Einlieferungsaufträgen im Erfassungsstatus

---

Alle Aufträge im Erfassungsstatus werden automatisch nach zehn Bankarbeitstagen gelöscht.

## 20 Information (AI)

Im Informationsdienst für die im CASCADE-Auftragsstatus<sup>1</sup> befindlichen Aufträge können Sie sich über Aufträge informieren,

- die Sie selbst in den CASCADE-Auftragsstatus eingestellt haben sowie

Die Informationsabfrage bietet darüber hinaus folgende Möglichkeiten:

- Kurzanzeige von Aufträgen aufgrund der angegebenen Auswahlkriterien
- Vollanzeige eines Auftrages mit ausführlicher Statusanzeige für Bearbeitung und Disposition
- Online-Druck eines Auftrages mit allen Informationen
- Online-Druck des vollständigen Einlieferungsbeleges in der Kurzanzeige zur Ablieferung bei CEU

```
TRAN: KVAI FC:      SB: ###M#####I####
AUFTRAGSABWICKLUNG      I N F O R M A T I O N      AUFTRAGSSTATUS
AA  AUFTRAGSART          : ..                KZ-AA: .
AN  AUFTRAGS-NUMMER      : .....
AR  REFERENZ             : M .....
AD  NICHT ERFOLGREICH DISPONIERTE AUFTRAEGE
MA  MATCH-AUFTRAEGE      : . M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
MI  MATCH-INSTRUKTIONEN : . M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
AK  AUFTRAEGE KAPITALDIENSTE TA : ...      BID : .....
CI  ALLE AUFTRAEGE ZU EINER ISIN
ZUSAEZTLICHE           LASTSCHRIFT-BANK : ....      WKN           : I .....
AUSWAHL                 GUTSCHRIFT-BANK : ....      SETTLEMENT-DAY : .....
                        GESCHAFTSART   : .        WRG GEGENWERT  : ...
HA  HISTORISCHE AUFTRAEGE           EINGEBER      : ....
KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus
```

Abbildung 20.1 Informationsanzeige AI

Es ist zu unterscheiden zwischen aktuellen und historischen Aufträgen:

1. Siehe auch CASCADE Handbuch, Band 1, z.B. Abschnitt 1.1.1.

## 20.1 Aktuelle Aufträge (AA, AN, AD, AK, SR)

Aktuelle Aufträge sind gültig an die CEU erteilte Aufträge im Auftragsstatus.

**Folgende Funktionen (FC) stehen zur Verfügung:**

| Funktionscode | Funktion   | Eingaben   |
|---------------|--|--|
| AA            | alle Aufträge einer Auftragsart (nach PF1 werden die möglichen Auftragsarten angezeigt). | <p>wenn AA = 16<sup>a</sup></p> <p>Gut-Bank = Mussfeld (Kundenkonto)</p> <p>Last-Bank = Kannfeld (internes Tresorkonto CEU)</p> <p>WKN/ISIN (optional)</p> <p>zusätzliche Auswahl möglich</p> <p>KZ AA: 16 L = Laufende Einlieferung</p> <p>N = Neuzulassung</p> <p>V = Valutierung</p> <p>wenn AA = 18<sup>a</sup></p> <p>Last-Bank = Mussfeld (Kundenkonto)</p> <p>Gut-Bank = Mussfeld (internes Tresorkonto CEU)</p> <p>WKN/ISIN (optional)</p> <p>zusätzliche Auswahl möglich</p> <p>KZ AA: = 18</p> <p>A = Laufende Auslieferung</p> <p>R = Auslieferung Rahmenurkunde</p> <p>S = Auslieferung Stückelose Werte</p> |

a. Das Gegenkonto entspricht jeweils einem internen Abwicklungskonto bei der CEU.

Zur Eingabe des zweistelligen Kürzels der Auftragsart bei dem Funktionscode AA kann der Benutzer die PF1-Taste drücken. Ihm werden dann zwei Masken mit den möglichen Auftragsarten, getrennt nach Giro- und Wertebereich, angezeigt:

**(A) Hilfemaske zur Funktion AA**

```

TRAN: KVAI FC:      SB: ###M#####I#####

AUFTRAGSABWICKLUNG      ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

      ANZEIGE DER MOEGlichen AUFTRAGSARTEN --GIROBEREICH--
01 WP-UEBERTRAG
  KZ-AA = A - CCP-AUFTRAG                03 BSV/LSV-UEBERTRAG
        = C - XEMAC-AUFTRAG              04 VERPFAENDUNG
        = E - EMISSIONSEINF. RS          05 FREIGABE
        = P - DEPOTUEBERTRAG RS          07 GBC-UMTAUSCH
        = B - BESTANDSUEBERTRAG RS       09 GBC-RUECKTAUSCH
        = L - ALLEGEMENT                  11 WP-LEIHAUFTRAG
        = I - REALIGNMENT                 12 WP-LEIHE/RUECKFUEHRUNG
        = R - SETTL.-RESTRICTION         13 KADI NON-INCOME
        = W - OHNE KZ-AA ARTEN           14 BOND-STRIPPING:AUFTEILUNG
02 MATCH-INSTRUKTION      15 BOND-STRIPPING:ZUSAMMENFUEHRUNG
  KZ-AA = A - CCP-INSTRUKTION           17 OPTIONSSCHEINTRENNUNG
        = E - EMISSIONSEINF. RS          19 OPTIONSSCHEINZUSAMMENFUEHRUNG
        = L - ALLEGEMENT                  99 STORNO/NACHBUCHUNG DEPOTUMSATZ
        = I - REALIGNMENT
        = W - OHNE KZ-AA ARTEN

KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus

```

Abbildung 20.2 Hilfemaske der Informationsanzeige AA (AA 10-12 werden nicht mehr genutzt)

**(B) Hilfemaske zur Funktion AA - Folgemaske Wertebereich**

```

TRAN: KVAI FC:      SB: ###M#####I#####

AUFTRAGSABWICKLUNG      ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

      ANZEIGE DER MOEGlichen AUFTRAGSARTEN --WERTEBEREICH--
16 EINLIEFERUNG
  KZ-AA
  L          LFD. EINLIEFERUNG
  N          NEUZULASSUNG SAMMELURKUNDE
  V          VALUTIERUNG
  E          NEUZULASSUNG SAMMELURKUNDE EDI
  F          EINLIEFERUNG FREMDTRESOR
  B          EINLIEFERUNG SONDERVERWAHRUNG
  M          EINLIEFERUNG EDELMETALL

KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus

```

Abbildung 20.3 Folgemaske 1 zur Hilfemaske der Informationsanzeige AA

```

TRAN: KVAI FC:      SB: ###M#####I#####

AUFTRAGSABWICKLUNG      ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

          ANZEIGE DER MOEGlichen AUFTRAGSARTEN --WERTEBEREICH--
18  AUSLIEFERUNG
    KZ-AA
      A          LFD. AUSLIEFERUNG
      R          RAHMENURKUNDE / TEILREDUZIERUNG
      S          GLOBALURKUNDE
      F          AUSLIEFERUNG FREMDTRESOR
      M          EDELMETALL
      B          SONDERVERWAHRUNG
    
```

Abbildung 20.4 Folgemaske 2 zur Hilfemaske der Informationsanzeige AA

Folgende weitere Funktionen stehen zur Verfügung:

Nachfolgende weitere Funktionen können für Aufträge des Wertebereichs Bank aus dem Auswahlménü *Information CASCADE-Auftragsstatus* genutzt werden.

| Funktionscode | Funktion  | Eingaben   |
|---------------|---|--|
| AN            | Einzelauftrag mit der eingegebenen Auftragsnummer. Es können nur eigene Aufträge aufgerufen werden. | Entweder LAST- oder GUT-BANK muss gefüllt sein.<br>SETTLEMENT-DAY (optional)<br>WKN/ISIN (optional)                    |
| AD            | Alle nicht disponierten Aufträge  | Entweder LAST- oder GUT-BANK muss gefüllt sein.<br>WKN/ISIN (optional)   |
| AK            | Aufträge aus Kapitaldiensten  | Entweder LAST- oder GUT-BANK muss gefüllt sein.<br>WKN/ISIN (optional)   |
| SR            | Alle RTS (Real-Time-Settlement)- Aufträge   | Entweder LAST- oder GUT-BANK muss gefüllt sein.<br>WKN/ISIN (optional)<br>SETTLEMENT-DAY = Tagesdatum (wird vorbelegt) |

## 20.2 Historische Aufträge (HA)

Soll ein aktueller Auftrag geändert oder gelöscht werden, so wird dieser im Auftragsstatus markiert und damit in den Erfassungsstatus überführt. Dadurch wird der Auftrag im Auftragsstatus ungültig. Gleichzeitig wird er als historischer Auftrag in seinem vollen Umfang und mit allen Statusausprägungen, die er zum Zeitpunkt der Markierung hatte, abgelegt.

```

TRAN: KVAI FC: HA SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / INFORMATION          AUFTRAGSSTATUS
HISTORISCHE AUFTRAEGE                      SEITE 1
K AA  AUFTNR LAST-KTO  GUT-KTO  WKN          NOMINALE          GEGEGENWERT
  16  6530000 7960 000  7930 000 DE0007224008          2.000

-- ID-KZ: 7930200002 -- FW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:42:38 --
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch

```

Abbildung 20.5 Anzeige Historische Aufträge

### Mögliche Funktion:

| Funktionscode | Funktion  | Eingaben                                 |
|---------------|---|--|
| HA            | Anzeige aller historischen Aufträge, die am Tagesdatum abgelegt werden. | Zusätzliche Eingaben sind nicht erlaubt. |

Die historische Anzeige erfolgt über alle Auftragsarten.

## 20.3 Information über Vollanzeige

### (A) Allgemeine Beschreibung

Aktuelle und historische Aufträge können auch als Vollanzeige aufgerufen werden. Über die Maske der tabellarischen Kurzanzeige kann in die Vollanzeige verzweigt werden. Diese Auswahl ist für alle Funktionscodes gleich. Hier werden alle selektierten Aufträge mit den buchungsrelevanten Feldern angezeigt. Es werden folgende Statusmeldungen je Auftrag ausgegeben:

- Bearbeitungsstatus („S“) und
- Dispositions-Status („D“)

**Hinweis:** Unabhängig von der zeitlichen Erfassung und Kontrolle werden die Auslieferungs- bzw. Einlieferungsaufträge immer mit der Settlement-Art „RTS“ für Real-Time-Settlement angezeigt.

Für die Ausdrücke muss der Bildschirm dem Drucker leitungsbezogen zugeordnet sein.

### (B) Tabellarische Maske aktueller Aufträge Einlieferung/Auslieferung

```

TRAN: KVAI FC: AA SB: 16##7960#I####
AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / INFORMATION          AUFTRAGSSTATUS
LAST-BANK: 7960              WRG GEGENWERT:                    SEITE 1
K M S D AA SA  AUFTNR GUT  WKN          NOMINALE          GEGENWERT SET-D
  1 1 16 5      700305 7930 DE0005151005      1.000             30.09
  1 1 16 5      21163 7930 DE0006283302         21             08.10
-  1 1 16 5        202 7930 DE0006283302      1.000             10.09
  1 1 16 5     6530000 7930 DE0007224008      2.000             16.10
-  4 16 5      559008 7930 DE0007277105     810.001           16.09
  1 1 16 5      21070 7930 DE0008400003         1             18.10
  1 1 16 5      21069 7930 DE0008400003         2             18.10
  1 1 16 5      21068 7930 DE0008400003        11             18.10
-  1 1 16 5      21066 7930 DE0008400003        200             18.10
  1 1 16 5      21067 7930 DE0008400003     33.333           18.10

GESAMTSUMMEN ANZAHL AUFTRAEGE:    10      847.569

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:30:47 --
KV0043I Keine Währung für Gegenwert selektiert
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 20.6 Tabellarische Anzeige AA

### Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“ = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

„S“ = Druck des Einlieferungsbeleges (E-Beleg) für die CEU mit buchungs- und verwahrrelevanten Daten aber ohne Stückenummern nach Betätigung der Taste PF2 (siehe [Einlieferungsauftrag](#) auf Seite 22-1)

„D“ = Druck aller Daten des selektierten Auftrages nach Betätigung der Taste PF2

**(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige**

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur ein „I“ eingeben. Außerdem darf „I“ nicht mit der Eingabe eines „D“ kombiniert werden.

Die Markierung mehrerer Aufträge mit dem Kennzeichen „D“ ist zulässig.

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit „I“ überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, ggf. über mehrere Masken (für bestimmte Auftragsarten).

**(D) Beispiel Vollanzeige aktueller Auftrag Einlieferung**

```

TRAN: KVAI FC: AA SB: 16##7960#I###21.11.2023##
AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / INFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
                          LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR   :    651225   HLG: 01 GS
LAST-KTO : 7960 000   CBF TRESORBESTAND GS
GUT-KTO  : 7930 000   TESTBANK
WKN      : I DE000KH3JPE3 CITI.GL.M. CALL25 NVD
NOMINALE :           5           EINHEIT: ST   ST-ART:
NOM-URK  :           5           EINLIEF-ART : 1   LFD. EINLIEFERUNG
                          EINLIEF-GRUND:
KUNDENREFERENZ          : -           -           KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE:
EING-NR:      4758
BEARB-STATUS: 200 EINLIEFERUNG ANGENOMMEN
DISPO-STATUS: 0 NICHT BEANTRAGT, INSTRUKTION GESPERRT
-- ID-KZ: 7907230003 -- PW:           ----- B7907494 -- 21/11/23 -- 13:22:08 --
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor

```

Abbildung 20.7 Vollanzeige aktueller Auftrag

Im Auftragsstatus werden zusätzliche Informationen bezüglich Bearbeitungs- und Dispositionsstatus eines Auftrages angezeigt.

**(E) Beispiel Vollanzeige aktueller Auftrag aus Kapitaldiensten**

```

TRAN: KVAI FC: AK SB: ##8996#I##08.10.2020#

AUFTRAGSABWICKLUNG          I N F O R M A T I O N          AUFTRAGSSTATUS

AA  AUFTRAGSART              : ..                KZ-AA: .
AN  AUFTRAGS-NUMMER         : .....
AR  REFERENZ                 : M .....
AD  NICHT ERFOLGREICH DISPONIERTE AUFTRAEGE

MA  MATCH-AUFTRAEGE         : . M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
MI  MATCH-INSTRUKTIONEN     : . M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)

AK  AUFTRAEGE KAPITALDIENSTE TA : ...      BID : .....
CI  ALLE AUFTRAEGE ZU EINER ISIN

ZUSAETZLICHE                LASTSCHRIFT-BANK : 8996      WKN           : I .....
AUSWAHL                      GUTSCHRIFT-BANK : ....      SETTLEMENT-DAY : 08.10.2020
                                       WRG GEGENWERT : ...

HA  HISTORISCHE AUFTRAEGE                    EINGEBER      : ....

-- ID-KZ: 7907230001 -- PW:                ----- B790745E -- 28/09/20 -- 15:14:44 --

PF1:Hilfe  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 20.8 Vollanzeige aktueller Auftrag aus Kapitaldiensten

```

TRAN: KVAI FC: AK SB: ##8996#I##08.10.2020#

AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / INFORMATION          AUFTRAGSSTATUS

LAST-BANK: 8996                WRG GEGENWERT:                SEITE 1

K M S D AA  RTS  AUFTNR  GUT  WKN                TA LAUFNR BTG          GEGENWERT SET-D

_ 2 0 0 02    6386833 7930 DE000AK0CC40 130 01098 501          409.301,00 12.08
_ 2 0 0 01    9926475 7930 DE000AK0CC40 130 01098 501          409.301,00 12.08
_ 2 0 0 02    6386829 7930 DE000HSH5WZ2 141 01098 601          135.000,00 12.08
_ 2 0 0 01    9926471 7930 DE000HSH5WZ2 141 01098 601          135.000,00 12.08

-- ID-KZ: 7907230001 -- PW:                ----- B790745E -- 28/09/20 -- 15:11:30 --

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 20.9 Tabellarische Anzeige AK

## 21 Änderung/Löschung (AA)

### 21.1 Markierung zur Änderung (MA)

#### (A) Allgemeine Beschreibung

Ein- und Auslieferungsaufträge, die sich bereits im CASCADE-Auftragsstatus befinden, können unter bestimmten Voraussetzungen noch geändert werden. Einlieferungen können bis zum Bearbeitungsstatus „Annahme bei CEU erfolgt“ zur Änderung bzw. Löschung durch den Eingabe bearbeitet werden. Auslieferungen sind bis zur Buchung durch den Eingabe zur Änderung bzw. Löschung bearbeitbar.

Änderungen sind jedoch nicht direkt im Auftragsstatus möglich. *Die Aufträge werden im Auftragsstatus nur markiert und damit in den Erfassungsstatus des Benutzers überführt.* Dieses Verfahren ist notwendig, um auch für Änderungen im Auftragsstatus das Vier-Augen-Prinzip sicherzustellen. Folgende Schritte laufen dabei ab:

- Markierung des zu ändernden Auftrages im Auftragsstatus
- Herausnahme des markierten Auftrages aus dem Auftragsstatus und Ablegen in die Historie des Auftragsstatus
- Generierung des markierten Auftrages in den Erfassungsstatus
- Änderung des generierten Auftrages im Erfassungsstatus
- Kontrolle des geänderten Auftrages im Erfassungsstatus
- Übergang des geänderten Auftrages aus dem Erfassungsstatus in den Auftragsstatus als Neuauftrag

Mit der Eingabe der Funktion „AA“ erscheint folgende Auswahlmaske:

```
TRAN: KVAA FC:    SB: ####
AUFTRAGSABWICKLUNG   A E N D E R U N G / L O E S C H U N G   AUFTRAGSSTATUS

MA  MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR AENDERUNG : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
ML  MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR LOESCHUNG : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)

LM  LOESCHEN MASCHINELL ERZEUGTER AUFTRAEGE : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)

ZUSAETZLICHE AUSWAHL - AUFTRAGSURSPRUNG : ...
                           EINGEBER       : .....

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:33:43 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

Abbildung 21.1 Auswahlmaske Änderung/Löschung

**Folgende Funktionen (FC) sind möglich:**

MA = Markierung eines Auftrages zur Änderung über die Auftragsnummer

ML = Markierung eines Auftrages zur Löschung über die Auftragsnummer

Die Funktion „LM“ kann nur von der CEU genutzt werden.

Um einen Auftrag zur Änderung markieren zu können, muss dessen Auftragsnummer bekannt sein. Der Benutzer steigt also mit dem Transaktionscode KVAA und dem Funktionscode „MA“ sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erscheint die tabellarische Anzeige des ausgewählten Auftrages.

**(B) Tabellarische Anzeige/Markierung zur Änderung**

Beispielmaske für Einlieferung

```

TRAN: KVAA FC: MA SB: 006530000
AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / MARKIERUNG          AUFTRAGSSTATUS
LAST-KTO: 7960 000                      SEITE 1
K M S D AA SA  AUFTRN GUT  WKN          NOMINALE          GEGENWERT SET-D
      1 16 5   6530000 7930 DE0007224008      2.000           16.10

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:34:17 --
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 21.2 Tabellarische Anzeige/Markierung zur Änderung

**Eingebare Kennzeichen (KZ):**

„I“ - Selektion des Auftrages zur Vollanzeige

„X“ - Markierung des Auftrages zur Änderung

**(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige**

Es kann im Feld Kennzeichen also entweder ein „I“ oder ein „X“ eingegeben werden.

**(D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus**

Wird vor dem Auftrag im Feld KZ ein „I“ eingegeben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller gespeicherten Daten dieses Auftrages, ggf. über mehrere Masken (bei bestimmten Auftragsarten).

Das Verzweigen in die Vollanzeige/Information kann notwendig werden, wenn die tabellarische Information nicht ausreicht.

Mit PF3 kehrt man in die tabellarische Kurzanzeige zurück.

### **(E) Markierung zur Änderung**

In der tabellarischen Kurzanzeige wird der Auftrag mit einem „X“ zur Änderung markiert. Nach Bestätigung der Markierung mit PF3 springt das System in das Menü der Änderung/Löschung zurück und gibt dort eine Verarbeitungsbestätigung aus. Der markierte Auftrag wird mit dem internen Status „Auftrag zur Änderung markiert, nicht mehr zur Verarbeitung heranziehen“ versehen. Außerdem werden Datum, Uhrzeit, Terminal und User-ID der Markierung festgehalten. Der Auftrag ist im Informationsdienst des Auftragsstatus als historischer Auftrag abrufbar. Anschließend wird der markierte Auftrag in den Erfassungsstatus des Eingabers generiert. Dort kann er dann geändert werden. Nach erfolgter Kontrolle wird er als Neuauftrag in den CASCADE-Auftragsstatus übernommen.

## 21.2 Markierung zur Löschung (ML)

### (A) Allgemeine Beschreibung

Ein- und Auslieferungsaufträge, die sich bereits im CASCADE-Auftragsstatus befinden, können unter bestimmten Voraussetzungen gelöscht werden. Einlieferungen können bis zum Bearbeitungsstatus „Annahme bei CEU erfolgt“ zur Löschung durch den Eingabe bearbeitet werden. Auslieferungen sind bis zur Buchung durch den Eingabe zur Löschung bearbeitbar.

Löschungen sind jedoch nicht direkt im Auftragsstatus möglich. *Die Aufträge werden im Auftragsstatus nur markiert und damit in den Erfassungsstatus des Benutzers überführt.* Dieses Verfahren ist notwendig, um das Vier-Augen-Prinzip sicherzustellen.

Folgende Schritte laufen dabei ab:

- Markierung des zu löschenden Auftrages im Auftragsstatus
- Herausnahme des markierten Auftrages aus dem Auftragsstatus und Ablegen in die Historie des Auftragsstatus
- Generierung des markierten Auftrages in den Erfassungsstatus
- Kontrolle des zu löschenden Auftrages im Erfassungsstatus
- Physische Löschung des kontrollierten Auftrages aus dem Erfassungsstatus

Mit der Eingabe der Funktion „AA“ erscheint folgende Auswahlmaske:

```

TRAN: KVAA FC:    SB: ####
AUFTRAGSABWICKLUNG      A E N D E R U N G / L O E S C H U N G      AUFTRAGSSTATUS

MA  MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR AENDERUNG : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
ML  MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR LOESCHUNG : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)

LM  LOESCHEN MASCHINELL ERZEUGTER AUFTRAEGE : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
    ZUSAETZLICHE AUSWAHL - AUFTRAGSURSPRUNG : .....
    EINGEBER : .....

-- ID-KZ: 7930200002 -- FW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:35:07 --
KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 21.3 Auswahlmaske Änderung/Löschung

Folgende Funktionen (FC) sind möglich:

- MA = Markierung eines Auftrages zur Änderung über die Auftragsnummer
- ML = Markierung eines Auftrages zur Löschung über die Auftragsnummer

Die Funktion „LM“ kann nur von der CEU genutzt werden

Um einen Auftrag zur Löschung markieren zu können, muss dessen Auftragsnummer bekannt sein. Der Benutzer steigt also mit dem Transaktionscode KVAA und dem Funktionscode 'ML' sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erscheint die tabellarische Anzeige des ausgewählten Auftrages.

### (B) Tabellarische Anzeige/Markierung zur Löschung

Beispielmaske Einlieferung:

```

TRAN: KVAA FC: ML SB: 006530000
AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / MARKIERUNG          AUFTRAGSSTATUS
LAST-KTO: 7960 000                      SEITE 1
K M S D AA SA  AUFTNR GUT  WKN          NOMINALE          GEGENWERT SET-D
      1 16 5   6530000 7930 DE0007224008      2.000             16.10

-- ID-KZ: 7930200002 -- PW:          ----- B7930495 -- 16/10/02 -- 11:35:28 --
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch
    
```

Abbildung 21.4 Tabellarische Anzeige/Markierung zur Löschung

#### Eingebbare Kennzeichen (KZ):

- „I“ - Selektion des Auftrages zur Vollanzeige
- „X“ - Markierung des Auftrages zur Löschung

### (C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es kann im Feld Kennzeichen nur ein „I“ oder ein „X“ eingegeben werden.

### (D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus

Wird vor dem Auftrag im Feld KZ ein „I“ eingegeben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller gespeicherten Daten dieses Auftrages, ggf. über mehrere Masken (bei bestimmten Auftragsarten).

Das Verzweigen in die Vollanzeige/Information kann notwendig werden, wenn die tabellarische Information nicht ausreicht und der Benutzer sich vergewissern will, dass er den richtigen Auftrag bearbeitet. Mit PF3 kehrt man in die tabellarische Kurzanzeige zurück.

### (E) Markierung zur Löschung

In der tabellarischen Kurzanzeige wird der Auftrag mit einem „X“ zur Löschung markiert. Nach Bestätigung der Markierung mit PF3 springt das System in das Menü der Änderung/Löschung zurück und gibt dort eine Verarbeitungsbestätigung aus. Der markierte Auftrag wird mit dem internen Status „Auftrag zur Löschung markiert, nicht mehr zur Verarbeitung heranziehen“ versehen. Außerdem werden Datum, Uhrzeit, Terminal und User-ID der Markierung festgehalten. Der Auftrag ist im Informationsdienst des Auftragsstatus als historischer Auftrag abrufbar. Anschließend wird der

markierte Auftrag in den Erfassungsstatus des Eingebers generiert. Dort läuft dieser Auftrag dann direkt in die Kontrolle. Nach erfolgter Kontrolle wird dieser Auftrag physisch aus dem Erfassungsstatus gelöscht.

## 21.3 Autom. Löschung von Einlieferungsaufträgen zu denen keine Stücke eingeliefert wurden

In der bisherigen Verarbeitung werden Einlieferungsaufträge, die erfasst, kontrolliert aber noch nicht von CEU angenommen wurden, ungeachtet ihres Erfassungsdatums täglich vorgetragen.

Einlieferungsaufträge werden im CASCADE-Auftragsstatus im Laufe der buchungstäglichen RTS-Ende-Verarbeitung auf Fristüberschreitung geprüft. Abhängig vom Ergebnis der Prüfung werden sie entweder vorgetragen, gemahnt oder gelöscht. Die Mahnung oder Löschung wird auf der entsprechenden CASCADE-Warnliste dokumentiert.

Ausgenommen von der Prüfung sind Aufträge in Namensaktien (RS).

### 21.3.1 Systeminformationen zu Fristen (KVAV)

Für Einlieferungsaufträge werden drei Fristen definiert, die von den schon für die anderen Auftragsarten geltenden Werten abweichen (können):

- 1. Mahnungsfrist: 65 Tage
- 2. Mahnungsfrist: 85 Tage
- Löschung nach 90 Tagen

Auftragsarten aus der Tresorverwaltung, die zu keiner Abwicklung auf T2S führen, werden höchstens fünf Bankarbeitstage vorgetragen und danach von CASCADE gelöscht. Eine Warnung erfolgt nach zwei Bankarbeitstagen.

### 21.3.2 Online-Information zu den gültigen Fristen (IS)

Diese Fristen können online über die Transaktion „KVAV“ Funktion: „IS“ eingesehen werden.

Weitere Informationen finden Sie im [CASCADE Handbuch Band 2](#).

### 21.3.3 Prüfung auf Fristüberschreitung

Die Prüfung kann abhängig vom Settlement-Day des Auftrags zu folgenden Ergebnissen führen:

- Settlement-Day = Verarbeitungsdatum – 65 Bankarbeitstage

Der Auftrag wird vorgetragen und in der entsprechenden Warnliste für CASCADE-Aufträge als zum ersten Mal gemahnter Auftrag angedruckt und vorgetragen.

- Settlement-Day = Verarbeitungsdatum – 85 Bankarbeitstage

Der Auftrag wird vorgetragen und in der entsprechenden Warnliste für CASCADE-Aufträge als zum zweiten Mal gemahnter Auftrag angedruckt und vorgetragen.

- Settlement-Day = Verarbeitungsdatum – 90 Bankarbeitstage

Der Auftrag und alle zugehörigen Stücke werden gelöscht und in der entsprechenden Warnliste für CASCADE-Aufträge als gelöschter Auftrag angedruckt und vorgetragen. In allen anderen Fällen werden die Aufträge nur vorgetragen.

## 21.4 Automatische Löschung von Aufträgen bei Redenomination

---

Werden Gattungen in Euro umgestellt, werden alle offenen Ein- und Auslieferungen im Auftragsstatus automatisch gelöscht.

## 22 Belege

### 22.1 Einlieferungsauftrag

---

Die Geschäftsbedingungen der CEU sehen vor, dass zusätzlich zur Einlieferung der effektiven Urkunden ein Einlieferungsauftrag mitgeliefert werden muss.

Dieses Formular enthält die buchungs- und verwahrrelevanten Daten (ohne Stückenummern), wie sie im CASCADE-Einlieferungsauftrag erfasst wurden und zu dem Einlieferungsposten gehören. Bei Einlieferungen in Namensaktien (Registered Shares - RS) vor dem GS-Stichtag entfällt der Einlieferungsauftrag.

Den effektiven Urkunden muss dieser Einlieferungsauftrag als Beleg zweifach beigelegt werden. Die Erstellung des Beleges online kann über den Informationsdienst des CASCADE-Auftragsstatus erfolgen. Mit Aufruf des entsprechenden Auftrages, kann der Anwender durch Kennzeichen „S“ in der Kurzanzeige und Betätigung der PF2-Taste den Ausdruck direkt anfordern. Voraussetzung hierzu ist die leitungsbezogene Zuordnung des Bildschirms zum Drucker. Kunden, die Einlieferungsaufträge an die CEU aus ihren Inhouse-Systemen per Datenfern-Übertragung übermitteln, können den Einlieferungsauftrag auch über ihre eigenen DV-Anwendungen erstellen. Dieser Beleg muss inhaltlich mit dem CASCADE-Ausdruck identisch sein. Lediglich die Information zum Last-Konto kann entfallen.

```

ERFASSUNGSSTATUS

ERFASSUNG          : 7907230003   21.11.2023   14:27
KONTROLLE          :
                                                           OFFEN

AUFTRAGSABWICKLUNG   EINLIEFERUNG / INFORMATION   ERFASSUNGSSTATUS
                    LFD. EINLIEFERUNG
PRIMANOTE: 653       AUFTNR: 653403       HLG: 01 GS

LAST-KTO : 7960 000       CBF TRESORBESTAND GS
GUT-KTO  : 7004 000       COMMERZBANK AG
WKN      : I DE0005035505 ALLGAEUER BRAUHAUS

NOMINALE :           30       EINHEIT: ST       ST-ART: M + B GETRENNT
NOM-URK  :           30       EINLIEF-ART : 1   LFD. EINLIEFERUNG
                                       EINLIEF-GRUND:

KUNDENREFERENZ      : -           -           KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON-NAME:
ADRESSE:
WKN-STAMMRECHT:

BEARB-STATUS: 100 EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST

VERWAHR-MOEGlichkeit : 9 GIROSAMMELVERW.
BESONDERHEIT         :
ABWEICHENDE-BEZEICHNUNG : 0 KEINE ABW. BEZEICHNUNG

NAECHSTER KUPON/LEG :           57           LETZTER KUP/LEG:           60

UEBERF. KUPON/LEG   VON:           BIS           :

NACHWEISART: 1 EINLIEF. EFF. URK.           SAMMELURKUNDE : N

TEXT:

ONLINE-DRUCK ZU AUFTRAG-NR.:           653403

GUT-KTO :           7004 000       EING-NR :           WKN : I
SUMME-NOM:           30

STUECKELUNG:           1       ANZ-URKUNDEN:           30

KZ STUECKENUMMERN           MAN MAN E
                             GEL GEL

9000001-30, .<
    
```

Abbildung 22.1 Einlieferungsauftrag

## 23 Auswertungen

Alle Auswertungen sind in Band 2 des Benutzerhandbuchs, Kapitel 6 (Reporting) detailliert beschrieben.

Auswertungen für die CASCADE-Anwendung gibt es bereits in Listform für

- den Erfassungsstatus und
- den Auftragsstatus.

Darüber hinaus existieren weitere Auswertungen wie

- die Avise,
- Listen aus der Disposition,
- Regulierungsliste/-datenträger und
- die Depottagesauszüge.

CASCADE-Aufträge, die den Effektivbereich betreffen, werden entweder in dieses Umfeld integriert oder entsprechend neu hinzugefügt.

Leerseite

## 24 Listen aus CASCADE

Die Ein- und Auslieferungsaufträge aus der abendlichen Buchung werden in zwei CASCADE-Tageslisten dokumentiert.

Die nicht kontrollierten Aufträge stehen in der Liste der nicht freigegebenen Aufträge. Die kontrollierten Aufträge finden sich in der Liste der an die CEU gültig erteilten Aufträge.

### 24.1 CASCADE-Tageslisten Erfassungstatus

Speziell für die Auftragsarten im Wertebereich werden folgende ergänzende Listen erstellt:

- Liste der Aufträge für Einlieferungen, die bereits fünf Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungstatus stehen (nachfolgend eine Beispielliste)
- Liste der Aufträge für Einlieferungen, die bereits zehn Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungstatus stehen und somit gelöscht werden. Diese Liste ist inhaltlich identisch mit der Liste für Aufträge, die bereits fünf Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungstatus stehen.
- Liste der Aufträge für Auslieferungen, die bereits fünf Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungstatus stehen (nachfolgend eine Beispielliste)
- Liste der Aufträge für Auslieferungen, die bereits zehn Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungstatus stehen und somit gelöscht werden. Diese Liste ist inhaltlich identisch mit der Liste für Aufträge, die bereits fünf Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungstatus stehen.

### 24.1.1 Liste der Aufträge für Einlieferungen, die bereits fünf Bankarbeitsarbeitstage im Erfassungsstatus stehen

|  |                     |                           |                   |              |          |                     |
|--|---------------------|---------------------------|-------------------|--------------|----------|---------------------|
| CLEARSTREAM BANKING AG                 |                     | FRANKFURT, DEN 23.10.2001 |                   |              |          |                     |
| NEUE BOERSENSTRASSE 1                  |                     | TELEFON                   | +49-69-50955-0    |              |          |                     |
|  |                     | TELEFAX                   | +49-69-50955-3701 |              |          |                     |
| TESTBANK AG                            |                     |                           |                   |              |          |                     |
| DEPOTBUCHHALTUNG-ABWICKLUNG            |                     |                           |                   |              |          |                     |
| POSTFACH 10 08 50                      |                     |                           |                   |              |          |                     |
| D 60008 FRANKFURT AM MAIN              |                     |                           |                   |              |          |                     |
| BANK-NUMMER : 7 513                    |                     |                           |                   |              |          |                     |
| VON CBF ZUM 1. MAL GEWARANTE AUFTRAEGE |                     | 23.10.2001 SEITE : 1      |                   |              |          |                     |
| LOESCHUNG ERFOLGT AM 25.10.2001 ABENDS |                     |                           |                   |              |          |                     |
| AUFTRAGSART 16 EINLIEFERUNG-NEU        |                     |                           |                   |              |          |                     |
| ENOTE                                  | AUFTR-NR            | LAST-KTO                  | GUT-KTO           | WKN          | NOMINALE | SET-DAY             |
| 999                                    | 1011209             | 7960 000                  | 7930 000          | DE0005151001 | 20.100   | 02.11.01            |
| 999                                    | 1011210             | 7960 000                  | 7930 000          | DE0005151001 | 20.100   | 02.11.01            |
| 999                                    | 1011211             | 7960 000                  | 7930 000          | DE0005151001 | 20.100   | 02.11.01            |
| SUMMEN                                 | EINLIEFERUNG-NEU    |                           |                   |              |          |                     |
|  |                     | ANZAHL                    |                   | NOMINALE     |          | GEGENWERT           |
|  |                     | 3                         |                   | 60.300       |          |                     |
| SUMMEN                                 | ALLER AUFTRAGSARTEN |                           |                   |              |          |                     |
|  |                     | ANZAHL                    |                   | NOMINALE     |          | GEGENWERT           |
|  |                     | 3                         |                   | 60.300       |          |                     |
|  |                     | 0                         |                   | 0            |          | - IN FREMDWAERUNG - |

Abbildung 24.1 Beispielliste Tagesliste (5 Arbeitstage im Erfassungsstaus)

## 24.2 CASCADE-Tageslisten Auftragsstatus

Auslieferungsaufträge sind in nachfolgende Listen aus dem CASCADE-Auftragsstatus integriert:

- Liste der nicht zur Disposition übernommenen Aufträge;
- Liste der Aufträge, die 65 Tage nach Settlement-Day nicht disponiert werden konnten (erste Warnung) mit Statusmeldung;
- Liste der Aufträge, die 85 Tage nach Settlement-Day nicht disponiert werden konnten (zweite Warnung) mit Statusmeldung;
- Liste der Aufträge, die nach 90 Tagen gelöscht wurden;
- Liste der historischen Aufträge.

## 24.3 Erfassungs- und Auftragsstatus CASCADE

### 24.3.1 Oppositionsliste zu Einlieferungen

Die *Oppositionsliste* enthält alle teilweise bzw. vollständig erfassten Einlieferungsaufträge im Erfassungsstatus und/oder kontrollierte Aufträge im Auftragsstatus, die durch die täglichen Oppositionsprüfungen mit Oppsdaosition belegt wurden. Aufträge mit oppositionsbelegten Stücknummern, die bereits im Auftragsstatus stehen, werden in den Erfassungsstatus zurückgeneriert.

|  |                |                           |                 |                    |
|--|----------------|---------------------------|-----------------|--------------------|
| CLEARSTREAM BANKING AG   |                | FRANKFURT, DEN 28.11.2001 |                 |                    |
| BOERSENPLATZ 7 - 11  |                | TELEFON                   | (069) 2101-0    |                    |
| 60313 FRANKFURT AM MAIN  |                | TELEFAX                   | (069) 2101-0    |                    |
|  |                | TELEX                     | 413 773 WSBFM D |                    |
| TESTBANK AG  |                |                           |                 |                    |
| HAUPTVERWALTUNG FRANKFURT/MAIN                                 |                |                           |                 |                    |
| POSTFACH 111111  |                |                           |                 |                    |
| D 66666 FRANKFURT AM MAIN                                      |                |                           |                 |                    |
| BANK-NUMMER : 7 513  |                |                           |                 |                    |
| DIE NACHFOLGENDEN OFFENEN AUFTRAEGE FUER EFFEKTIVE             |                |                           |                 | SEITE : 1          |
| EINLIEFERUNGEN WURDEN UEBER DIE ABENDLICHE OPPOSITIONSPRUEFUNG |                |                           |                 |                    |
| ALS FEHLERHAFT ERKANNT:  |                |                           |                 |                    |
| AUFTRAGSART  | 16             | EINLIEFERUNG              |                 |                    |
| PRIM AUFTNR  | GUT-KTO        | WKN                       | NOMINALE        | BEARBEITUNGSSTATUS |
| USER-ID  | KUNDENREFERENZ |                           |                 |                    |
| ERFASSTER  |                |                           |                 |                    |
| STUECKELUNG  | STUECKENUMMERN |                           |                 |                    |
| OPPOSITIONSGRUND   |                |                           |                 |                    |
| 962 2384000  | 7930 000       | DE0002384005              | 2.000.000       | 50                 |
| 7930000001   | BIC-DE222222   |                           |                 |                    |
| 10.000   | 10001          |                           |                 |                    |
| TOTALFÄLSCHUNG MÖGLICH   |                |                           |                 |                    |
| 23 234567  | 7930 000       | DE0004750153              | 1.500.000       |                    |
| 7930000004   | KTO-00303000   | KTO-1234000000000         |                 | 100                |
| 1.000  | 5000           |                           |                 |                    |
| ZAHLUNGSSPERRE   |                |                           |                 |                    |
| SUMMEN EINLIEFERUNGEN  |                |                           |                 |                    |
| ANZAHL   | NOMINALE       |                           |                 |                    |
| 2  | 3.500.000      |                           |                 |                    |
| DIESE EINLIEFERUNGEN WURDEN NOCH NICHT KONTROLLIERT !!         |                |                           |                 |                    |

Abbildung 24.2 Oppositionsliste

## 24.4 Weitere Auswertungen für Einlieferungen

### 24.4.1 Avise

Die bereits existierenden Avise für Depotgutschriften enthalten für Einlieferungen zusätzlich folgende Informationen:

- HLG (Hinterlegungsart-CEU)
- Nachweisart

```

CLEARSTREAM BANKING AG                VALUTA :      09.11.2004
AVIS ZU EINLIEFERUNG                 AUFTR-NR:    658013

WIR HABEN VERANLASST, DASS IHREM DEPOTBESTAND HEUTE FOLGENDE WERTPAPIERE
GUTGESCHRIEBEN WERDEN:

GUT-KTO: 79999                      TESTBANK AG
WKN:      I AT00000796651           YLINE E-COMMERCE SVCS
EINHEIT:  ST                        NOMINALE:      50.000
HLG-CBF:  01 GS

NACHWEISART:  1 EINLIEF. EFF. URK.

LAST-KTO: 7961                      CBF TRESORBESTAND SVG           FRANKFURT AM MAIN
    
```

Abbildung 24.3 Avis

## 24.5 Auswertungen für die Einlieferung von Namensaktien vor dem GS-Stichtag

Die Einlieferungen von Namensaktien sind in den Auswertungen, wie sie für die Auftragsart „laufende Einlieferung“, Neuzulassung und Valutierung existieren, integriert.

Darüber hinaus wird zusätzlich eine Liste erstellt, die abgelehnte Aufträge aus der Prüfung gegen die Emittentendatei enthält.

## 24.6 List-Identifikation

Kunden der CEU können mit Hilfe der spezifischen Listidentifikation Listen in der von ihnen festlegten Priorität ausdrucken. Es sind hier nur die für den Wertebereich betroffenen Listen aufgeführt.

### 24.6.1 CASCADE-Auftragsabwicklung

| <b>CASCADE–Auftragsabwicklung</b>  |                |
|--|----------------|
| <i>Listbezeichnung</i>   | <i>Merkmal</i> |
| AN CEU/T2S ERTEILTE AUFTRAEGE  | KV102001       |
| AN CEU/T2S GUELTIG ERTEILTE AUFTRAEGE HIST.  | KV102002       |
| VON CEU /T2S WEGEN FRISTABLAUF ZUR<br>LOESCHUNG MARKIERTE AUFTRAEGE                  | KV102003       |
| VOM EINGEBER GELOESCHTE AUFTRAEGE  | KV102004       |
| VOM KONTRAHENTEN GELOESCH. AUFTRAEGE   | KV102005       |
| BISHER OHNE FREIGABE AN CEU  | KV102006       |
| VON CEU/T2S ZUM 1. MAL GEWARANTE AUFTRAEGE   | KV102007       |
| VON CEU/T2S ZUM 2. MAL GEWARANTE AUFTRAEGE   | KV102008       |
| NICHT ZUR BUCHUNG VALUTA TT.MM.JJJJ<br>UEBERNOMMEN                                   | KV197930       |
| AENDERUNGSHISTORIE AUFTRAEGE<br>AUFTRAGSSTATUS                                       | KV132001       |
| LISTE DER NACH RTS-ENDE AUF DEM CEU-<br>ZWISCHENKONTO VERBLIEBENEN<br>UEBERWEISUNGEN | KV243001       |

## 24.6.2 CASCADE-Verarbeitung

| <b>CASCADE-Auftragsabwicklung</b>   |                |
|---|----------------|
| <i>Listbezeichnung</i>  | <i>Merkmal</i> |
| ZUSAMMENSTELLUNG ALLER DURCH<br>KAPITALDIENSTE BETROFFENER GESCHAEFTE   | KV259001       |
| DIE NACHFOLGENDEN OFFENEN AUFTRAEGE FUER<br>EFFEKTIVE EINLIEFERUNGEN WURDEN UEBER DIE<br>ABENDLICHE OPPOSITIONSPRUEFUNG ALS<br>FEHLERHAFT ERKANNT | KV271001       |
| DEPOTTAGESAUSZÜGE   | KV124001       |

## 24.6.3 CASCADE-Dienste für Namensaktien (RS)

| <b>CASCADE-RS-Abwicklung</b>   |                |
|--|----------------|
| <i>Listbezeichnung</i>   | <i>Merkmal</i> |
| FEHLERHAFT EINGELIEFERTE AUFTRAEGE IM<br>ERFASSUNGS- BZW. AUFTRAGSSTATUS AUS<br>PRUEFUNG GEGEN EMITTENTENDATEI | KG 100001      |
|  | KG 100002      |

## 25 Depot-Disposition und Buchung

Für Informationen zur Wertpapierdisposition und -Buchung innerhalb des GS-Abwicklungssystems wird auf CASCADE Handbuch Band 1 (Kapitel 1) und Band 2 (Kapitel 1) des Benutzerhandbuchs sowie das CEU Kundenhandbuch verwiesen. Die nachfolgenden Abschnitte erläutern die Einbindung des Effektivbereiches in diese Abläufe.

### 25.1 Die Auftragsarten „Einlieferung“ und „Auslieferung“

#### 25.1.1 Gesamtablauf im zeitlichen Überblick

Nachfolgende Graphik verdeutlicht die zeitliche Abfolge für die Abwicklung der Einlieferungsaufträge bzw. Auslieferungsaufträge (laufende Einlieferung, Neuzulassung und Valutierung) von der Auftragserteilung, Prüfung und Freigabe bei der CEU bis zur Buchung.

##### Permanente Auftragserteilung/Auftragsverarbeitung in CASCADE

| Start<br>CASCADE Online | Beschreibung   | Ende<br>Real-Time<br>Settlement in T2S | Start<br>Night-Time<br>Settlement | Ende<br>CASCADE Online |
|-------------------------|--|--|-----------------------------------|------------------------|
| 05:00 Uhr               | Freigabe von Einlieferungsaufträgen durch die CEU für RTS-Buchung.                           | 18:00 Uhr                              | 20:00 Uhr                         | 03:00 Uhr              |
| 05:00 Uhr               | Freigabe von Auslieferungsaufträgen durch Kunden der CEU und Prüfstelle CEU für RTS-Buchung. | 18:00 Uhr                              | 20:00 Uhr                         | 03:00 Uhr              |

Ein- und Auslieferungsaufträge, die bis 17:30 Uhr von der CEU freigegeben sind und Settlement-Day gleicher Tag haben, werden gleichartig im Real-Time Settlement (RTS) verbucht.

Auslieferungsaufträge für Einzelkunden, die bis 17:30 Uhr durch den Kunden mit dem entsprechenden Settlement-Tag eingestellt werden und von der CEU-Prüfstelle zur Buchung freigegeben werden, werden gleichartig in RTS verbucht. Auslieferungsaufträge für Sammelkunden werden erst nach der Freigabe zur Buchung via KPZS FA/KPST FA in RTS verbucht. Kann ein freigegebener Auftrag mangels Depotbestand, nicht gebucht werden, wird er im CASCADE-Auftragsstatus für die nächste Disposition und Buchung vorgetragen.

Ein- und Auslieferungsaufträge mit Settlement-Tag in der Zukunft können bereits vor Erreichen des Settlement-Tages zur Buchung freigegeben werden. Die Aufträge werden nach der Buchungsfreigabe mit einer Settlementsperre versehen und mit dem Erreichen des Settlement-Tages automatisch gebucht.

**Hinweis:** Kontensperrungen werden bereits mit der Freigabe zur Buchung geprüft, so dass im Falle einer Sperre keine Buchung möglich ist.

## 25.2 Rückgabe von Aufträgen

---

### 25.2.1 Rückgabe von Einlieferungen

Bei Rückgabe der effektiven Stücke durch die CEU an den Auftraggeber wird der zugehörige Auftrag automatisch in den CASCADE-Erfassungsstatus generiert und mit dem Kennzeichen „A“ versehen. Dort kann er vom Kunden erneut bearbeitet werden. Rückgaben können

- die vollständige Einlieferung einschließlich Einlieferungsauftrag oder
- nur den Einlieferungsauftrag (bei Rückgabe ohne Urkunden)

beinhalten.

### 25.2.2 Rückgabe von Auslieferungen

Auslieferungen werden, sofern keine Settlementsperre vorhanden ist, bis zu 40 Bankarbeitstage im System vorgetragen. Danach erfolgt eine automatische Löschung. Zusätzlich kann von der CEU auch eine Rückgabe veranlasst werden. Die Aufträge werden in den Erfassungsstatus zurückgestellt.

## 26 Euro-Umstellung

In Abhängigkeit von der Umstellungsmethode (Bottom-Up/Top-Down), mit der die Umstellung des Depotbestandes einer Gattung vorgenommen wurde, sind bzgl. der Nominalen i. d. R. Alternativ-Eingaben möglich.

- Bei Umstellung durch die Top-Down Methode ist immer die Euro-Nominale einzugeben.
- Erfolgte die Bestandsumstellung durch die Bottom-Up Methode, kann wahlweise die Euro-Nominale oder die Nominale-Urkunde erfasst werden.

Bei Erfassung der Nominale-Urkunde wird die Buchungs-Nominale vom System errechnet. Alternativ ist die Buchungs-Nominale zu erfassen, insbesondere wenn die Bank die Währung der Stückelungen nicht kennt. In diesem Fall wird die Nominale-Urkunde errechnet. In beiden Fällen wird systemseitig auf Darstellbarkeit der kleinsten Stückelung bzw. der kleinsten übertragbaren Einheit geprüft.

### 26.1 Top-Down mit Eingabe der Nominale in EUR

Kf = Konversionsfaktor = 1,95583 (nur Beispiel)

#### Umrechnung:

$$\frac{\text{kleinste Stueckelung DM}}{Kf} = \text{kleinste Einheit EURO}$$

(auf zwei Nachkommastellen gerundet)

$$\frac{\text{Nominale EURO}}{\text{kleinste Einheit EURO}} = \text{Anzahl Stuecke}$$

Ist der Wert in Anzahl Stücke eine ganze Zahl, so ist die Darstellbarkeit gegeben.

#### Berechnung der Nominale-Urkunde für die Anzeige:

Anzahl Stücke x kleinste Stückelung DM = Nominale-Urkunde DM

#### Beispiele:

a) Nominale: 5.000 EUR

kleinste Stückelung DM: 100

$$\frac{100}{Kf} = 51,13 (\text{kleinste Einheit EURO})$$

$$\frac{5000,00 \text{ EURO}}{51,13} = 97,79 \text{ Stuecke}$$

Die Berechnung der Anzahl Stücke ergibt keine ganze Zahl, somit ist die Darstellbarkeit nicht gegeben.

b) Nominale: 4.959,61 EUR

kleinste Stückelung DM: 100

$$\frac{100}{Kf} = 51,13 (\text{kleinste Einheit EURO})$$

$$\frac{4959,61 \text{ EURO}}{51,13} = 97 \text{ Stuecke}$$

Die Berechnung der Anzahl Stücke ergibt eine ganze Zahl, somit ist die Darstellbarkeit gegeben.

97 x 100 = 9.700 DM → Nominale Urkunde

c) Nominale: 1.549.300.000 EUR

kleinste Stückelung DM: 10.000

$$\frac{10000 \text{ EURO}}{Kf} = 5112,92 \text{ (kleinste Einheit EURO)}$$

$$\frac{1549300000 \text{ EURO}}{5112,92} = 303016,67 \text{ Stuecke}$$

Die Berechnung der Anzahl Stücke ergibt keine ganze Zahl, somit ist die Darstellbarkeit nicht gegeben.

d) Nominale: 1.549.296.567 EUR

kleinste Stückelung DM: 10.000

$$\frac{10000 \text{ EURO}}{Kf} = 5112,92 \text{ (kleinste Einheit EURO)}$$

$$\frac{1549296567 \text{ EURO}}{5112,92} = 303016,0000547632 \text{ Stuecke}$$

Die Berechnung der Anzahl der Stücke ergibt keine ganze Zahl, somit ist die Darstellbarkeit nicht gegeben.

307.933 x 10.000 = 3.079.330.000 DM → Nominale Urkunde

e) Nominale: 1.549.296.566,72 EUR

kleinste Stückelung DM: 10.000

$$\frac{10000 \text{ EURO}}{Kf} = 5112,92 \text{ (kleinste Einheit EURO)}$$

$$\frac{1549296566,72 \text{ EURO}}{5112,92} = 303016 \text{ Stuecke}$$

Die Berechnung der Anzahl Stücke ergibt eine ganze Zahl, somit ist die Darstellbarkeit gegeben.

303.016 x 10.000 = 3.030.160.000 DM → Nominale Urkunde

## 26.2 Bottom-Up mit Eingabe der Nominale in EUR

### Umrechnung:

Nominale Euro x Kf = Nominale DM (auf zwei Nachkommastellen gerundet)

### Darstellbarkeit:

$$\frac{\text{Nominale DM}}{\text{kleinste Stueckelung DM}} = \text{Anzahl Stuecke (auf Ganze gerundet)}$$

Anzahl Stücke x kleinste Stückelung DM = Nominale-Urkunde

Wenn  $\frac{\text{Nominale-Urkunde}}{Kf}$ , so ist die Nominale Euro darstellbar.

### Beispiele:

a) Nominale: 4.980,69 EUR

kleinste Stückelung DM: 100

4.980,69 Euro x Kf = 9.741,3829 DM gerundet auf 9.741,38 DM

$$\frac{9741,38 \text{ DM}}{100} = 97,4138 \text{ (gerundet auf 97 Stueck)}$$

97 x 100 = 9.700 DM → Nominale-Urkunde

### Prüfung auf Darstellbarkeit:

$$4980,69 \text{ EUR} - \frac{9700 \text{ DM}}{Kf} = 0 ?$$

$$4.980,69 \text{ EUR} - 4.959,53 = 21,16 > 0$$

Die Differenz zwischen Nominale Euro und der berechneten Nominale-Urkunde ist größer als Null. Deshalb ist eine Darstellbarkeit nicht gegeben.

b) Nominale: 5.061,79 EUR

kleinste Stückelung DM: 100

5.061,79 EUR x Kf = 9.900,0007 DM gerundet auf 9.900,00 DM

$$\frac{9900 \text{ DM}}{100} = 99 \text{ Stueck}$$

99 x 100 = 9.900 DM → Nominale-Urkunde

### Prüfung auf Darstellbarkeit:

$$5061,79 \text{ EUR} - \frac{9900 \text{ DM}}{Kf} = 0 ?$$

$$5.061,79 \text{ EUR} - 5.061,79 \text{ EUR} = 0$$

Die Differenz zwischen Nominale Euro und der berechneten Nominale-Urkunde ist Null. Die Darstellbarkeit ist damit gegeben.

c) Nominale: 1.549.300.224 EUR

kleinste Stückelung DM: 10.000

1.549.300.224 EUR x Kf = 3.030.167.857,10592 DM

gerundet auf 3.030.167.857,10 DM

$$\frac{3030167857,10 \text{ DM}}{10000} = 303016,78571 \text{ gerundet auf } 303.016 \text{ Stück}$$

303.016 x 10.000 = 3.030.160.000 DM → Nominale-Urkunde

**Prüfung auf Darstellbarkeit:**

$$1549300224 \text{ EURO} - \frac{3030160000 \text{ DM}}{Kf} = 0 ?$$

$$1.549.300.224 \text{ EUR} - 1.549.296.206,73 = 4017,27 > 0$$

Die Differenz zwischen Nominale Euro und der berechneten Nominale-Urkunde ist größer als Null. Die Darstellbarkeit ist deshalb nicht gegeben.

d) Nominale: 1.549.296.206,74 EUR

kleinste Stückelung DM: 10.000

1.549.296.206,74 EUR x Kf = 3.030.160.000,03537 DM

gerundet auf 3.030.160.000,04 DM

$$\frac{3030160000,04}{10000} = 303016 \text{ Stueck}$$

303.016 x 10.000 = 3.030.160.000 DM → Nominale-Urkunde

**Prüfung auf Darstellbarkeit:**

Kf

3.030.160.000 DM

$$1.549.296.206,74 \text{ EUR} - \frac{3030160000 \text{ DM}}{Kf} = 0 ?$$

$$\rightarrow 1.549.296.206,74 \text{ EUR} - 1.549.296.206,73 = 0,01 > 0$$

Die berechnete Differenz zwischen Nominale Euro und der berechneten Nominale-Urkunde ist größer als Null. Damit ist eine Darstellbarkeit nicht gegeben.

## 26.3 Bottom-Up mit Eingabe der Nominale Urkunde

### Umrechnung:

$$\frac{\text{Nominale-Urkunde}}{Kf} = \text{Nominale EURO (auf zwei Nachkommastellen gerundet)}$$

### Darstellbarkeit:

$$\frac{\text{Nominale-Urkunde}}{\text{kleinste Stueckelung DM}} = \text{Anzahl Stuecke}$$

Ist der Wert in Anzahl Stücke eine ganze Zahl, so ist die Darstellbarkeit gegeben.

### Beispiele:

a) Nominale-Urkunde: 5000 DM

kleinste Stückelung DM: 100

$$\frac{5000,00 \text{ DM}}{Kf} = 2556,46 \text{ EURO} \rightarrow \text{Nominale Euro}$$

### Prüfung auf Darstellbarkeit:

$$\frac{5000,00 \text{ DM}}{100,00 \text{ DM}} = 50 \text{ Stueck}$$

Die Anzahl Stücke ist ganzzahlig, somit ist eine Darstellbarkeit gegeben.

b) Nominale-Urkunde: 3.079.330.000 DM

kleinste Stückelung DM: 10.000

$$\frac{3079330000,00 \text{ DM}}{Kf} = 1574436428,52 \text{ EURO} \rightarrow \text{Nominale Euro}$$

### Prüfung auf Darstellbarkeit:

$$\frac{3079330000,00 \text{ DM}}{10000,00 \text{ DM}} = 307933 \text{ Stueck}$$

Die Anzahl Stücke ist eine ganze Zahl, damit ist die Darstellbarkeit gewährleistet.

Leerseite

# Anhang 1: Transaktionscodes und die zugehörigen Funktionscodes

Als Überblick werden in diesem Kapitel alle möglichen Transactionscodes mit den dazugehörigen Funktionscodes des Wertebereiches aufgelistet. In der ersten Spalte sind die Transaktionscodes aufgeführt, in der zweiten Spalte werden die dazugehörigen Funktionscodes genannt, und in der dritten Spalte wird eine kurze verbale Erläuterung gegeben. Die Transaktions-/Funktionscodes des Girobereiches entnehmen Sie bitte dem Anhang des CASCADE Handbuchs Band 2.

## Clearing und Settlement/Custody

### CASCADE-Erfassungsstatus

| TRAN        | FC                                    | Bedeutung  |
|-------------|---------------------------------------|--|
| <b>KVEW</b> | <b>Erfassung Wertebereich</b>         |  |
| KVEW        | EL                                    | Laufende Einlieferung (Einzelurkunden und techn. Sammelurkunden)     |
|             | NV                                    | Neuzulassung/Valutierung (Globalurkunden/Jungscheine/Rahmenurkunden) |
|             | AL                                    | Auslieferung   |
|             | EF                                    | Einlieferung Kundentresor (nur Outsourcer-Kunden)                    |
|             | AF                                    | Auslieferung Kundentresor (nur Outsourcer-Kunden)                    |
|             | SV                                    | Neuzulassung öffentliche Anleihe                                     |
| <b>KVEB</b> | <b>Änderung/Löschung Wertebereich</b> |  |
| KVEB        | AN                                    | Änderung eines Auftrags  |
|             | AF                                    | Änderung fehlerhafter Aufträge                                       |
|             | LN                                    | Löschung eines Auftrags  |
|             | LF                                    | Löschung fehlerhafter Aufträge                                       |
| <b>KVEC</b> | <b>Kontrolle Wertebereich</b>         |  |
| KVEC        | Vollanzeige                           |  |
|             | VA                                    | Kontrolle aller Aufträge   |
|             | VN                                    | Kontrolle eines Auftrags mit Auftragsnummer                          |
|             | VP                                    | Kontrolle aller Aufträge mit Primanoten-Nummer                       |
|             | VL                                    | Kontrolle aller Aufträge mit Lastschrift-Bank                        |
|             | VG                                    | Kontrolle aller Aufträge mit Gutschrift-Bank                         |
|             | Tabellarische Kurzanzeige             |  |

| <b>TRAN</b> | <b>FC</b>                                    | <b>Bedeutung</b>                               |
|-------------|--|--|
|             | TA   | Kontrolle aller Aufträge                       |
|             | TN   | Kontrolle eines Auftrages mit Auftrags-Nummer  |
|             | TP   | Kontrolle aller Aufträge mit Primanoten-Nummer |
|             | TL   | Kontrolle aller Aufträge mit Lastschrift-Bank  |
|             | TG   | Kontrolle aller Aufträge mit Gutschrift-Bank   |
| <b>KVEI</b> | <b>Information/online Druck Wertebereich</b> |  |
| KVEI        | AA   | Anzeige aller Aufträge                         |
|             | AF   | Anzeige aller fehlerhaften Aufträge            |
|             | NR   | Anzeige eines Auftrages mit Auftrags-Nummer    |
|             | PN   | Anzeige aller Aufträge mit Primanoten-Nummer   |
|             | LK   | Anzeige aller Aufträge mit Lastschrift-Bank    |
|             | GK   | Anzeige aller Aufträge mit Gutschrift-Bank     |

## Anhang 2: Tabellen (Schlüsselverzeichnis)

### AUFTRAGSART

Feldname: AA/URSPR AUFTRAGSART

#### BESCHREIBUNG

Unter Auftragsart versteht man eine feste Form einer Anweisung an den Kassenverein, z. B. eine Auslieferung.

| Feldinhalt | Text                               | Bedeutung  |
|------------|------------------------------------|--|
| 01         | WP-UEBERTRAG                       | Wertpapier-Übertrag mit und ohne Gegenwertverrechnung                                |
| 02         | MATCH-INSTR                        | Match-Instruktion  |
| 03         | SV-UEBERTRAG                       | BSV/LSV-Übertrag   |
| 04         | VERPFAENDUNG                       | Verpfändung  |
| 05         | FREIGABE                           | Freigabe von Verpfändungen/<br>Sicherheiten  |
| 07         | UMTAUSCH                           | Umtausch GBC   |
| 09         | RUECKTAUSCH                        | Rücktausch GBC   |
| 13         | KADI-SONDPRO                       | Umsatz aus Kapitaldienste-Sondpro  |
| 14         | STRIP-AUFTEILUNG                   | Trennung einer Cum-Anleihe in Mantel<br>und einzelne Zinsscheine                     |
| 15         | STRIP-ZUSAMMENFUHRUNG              | Zusammenführung von Mantel und<br>einzelnen Zinsscheinen zur Cum-<br>Anleihe         |
| 16         | EINLIEFERUNG                       | Einlieferung   |
| 17         | OPTIONSSCHEIN- TRENNUNG            | Trennung von cum-Optionsanleihen in<br>Ex-Anleihe und nur Optionsschein              |
| 18         | AUSLIEFERUNG                       | Auslieferung   |
| 19         | OPTIONSSCHEIN-<br>ZUSAMMENFUEHRUNG | Zusammenführung von Ex-<br>Optionsanleihe und Optionsschein in<br>cum-Optionsanleihe |
| 99         | STORNO-NACHB                       | Storno/Nachbuchung Depot (nur CEU<br>erlaubt)  |

**BEARBEITUNGSSTATUS AUSLIEFERUNG**

Feldname: Bearb-Status

**BESCHREIBUNG**

Die Ausprägungen des Bearbeitungsstatus spiegeln den aktuellen Erfassungsstand der Bank und nach der Kontrolle durch die Bank den aktuellen „Stand“ der Aufträge in den Clearing-Prüfstellen wider.

| Feldinhalt | Text   |
|------------|--|
| 10         | AUSLIEFERUNG NICHT VOLLSTAENDIG ERFASST                      |
| 100        | AUSLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST                            |
| 150        | AUSLIEFERUNGSaufTRAG KONTROLLIERT                            |
| 200        | AUSLIEFERUNG IN KPZS VOLLSTAENDIG GEAENDERT                  |
| 210        | AUSLIEFERUNG IN KPZS ZUR RUECKGABE GENERIERT                 |
| 220        | BUCHUNGSFREIGABE IN KPZS ZURUECKGENOMMEN                     |
| 300        | AUSLIEFERUNG IN KPST VOLLSTAENDIG GEAENDERT                  |
| 310        | AUSLIEFERUNG IN KPST ZUR RUECKGABE GENERIERT                 |
| 320        | BUCHUNGSFREIGABE IN KPST ZURUECKGENOMMEN                     |
| 400        | AUSLIEFERUNG ZUR BUCHUNG FREIGEgeben                         |
| 410        | ABGELEHNT IN DISPOSITION/ZURUECK IN KPZS                     |
| 500        | AUSLIEFERUNG ZUR BUCHUNG FREIGEgeben                         |
| 510        | ABGELEHNT IN DISPOSITION/ZURUECK IN KPST                     |
| 590        | AUFTRAG ERFOLGREICH GEBUCHT                                  |
| 600        | AUSTRAGUNG DER AUSLIEFERUNG AUS CARAD BESTAETIGT             |
| 610        | AUSLIEFERUNG GELOESCHT                                       |
| 620        | MANUELLE ZUWEISUNG UNVOLLSTAENDIG                            |
| 630        | MANUELLE ZUWEISUNG VOLLSTAENDIG                              |
| 640        | ABGELEHNT IN MASCHINELLER ZUWEISUNG                          |
| 650        | AUSLIEFERUNG STORNIERT                                       |
| 700        | ALLE SENDUNGEN DURCH EFFEKTEN-AUSGANG AUSGELIEFERT           |
| 701        | NOCH TEILSENDUNGEN OFFEN                                     |
| 702        | ALLE SENDUNGEN AUSGELIEFERT, AUFTRAG IST ZU LOESCHEN         |
| 703        | ZUWEISUNG ABGESCHLOSSEN                                      |
| 720        | VOM E-AUSGANG ZURUECKGEN. - MASCH. ZUWEISUNG ZURUECKGENOM.   |
| 730        | VOM E-AUSGANG ZURUECKGEN. - MAN. ZUWEISUNG NOCH VORHANDEN    |
| 750        | KEINE AUSLIEFERUNG DURCH EFFEKTEN-AUSGANG ERFORDERLICH       |
| 790        | AUSLIEFERUNG DURCH EFFEKTEN-AUSGANG GEAENDERT                |
| 791        | ENDBEARBEITETE AUSLIEFERUNG DURCH EFFEKTEN-AUSGANG GEAENDERT |
| 792        | HISTORISCHE AUSLIEFERUNG IN KPHI GEAENDERT                   |
| 993        | UMLEGUNG AUTOMATISCH ENDBEARBEITET                           |
| 999        | LOESCHUNG WG. REDENOMINATION                                 |

### BEARBEITUNGSSTATUS EINLIEFERUNG

Feldname: Bearb-Status

#### BESCHREIBUNG

Der Bearbeitungsstatus informiert über den aktuellen 'Zustand' des Einlieferungsauftrages bei der CEU.

| Feldinhalt | Text  |
|------------|---|
| 10         | EINLIEFERUNG TEILERFASST - ZU WENIG STUECKE                   |
| 30         | EINL. Z. RUECKGABE GENERIERT, ZU WENIG STUECKE                |
| 50         | EINLIEFERUNG TEILERFASST - ZU VIELE STUECKE                   |
| 70         | EINL. Z. RUECKGABE GENERIERT, ZU VIELE STUECKE                |
| 100        | EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG ERFASST                             |
| 150        | EINLIEFERUNG ZUR RUECKGABE GENERIERT                          |
| 200        | EINLIEFERUNG ANGENOMMEN                                       |
| 410        | EINLIEFERUNG GEAENDERT - ZU WENIGE STUECKE                    |
| 450        | EINLIEFERUNG GEAENDERT - ZU VIELE STUECKE                     |
| 500        | EINLIEFERUNG VOLLSTAENDIG GEAENDERT                           |
| 522        | BUCHUNGSFREIGABE ONLINE ZURUECKGENOMMEN                       |
| 523        | BUCHUNGSFREIGABE ZURUECKGENOMMEN, INKONSISTENZEN MIT CARAD    |
| 700        | EINLIEFERUNG ZUR BUCHUNG FREIGEgeben                          |
| 701        | ZUSTIMMUNG ZUR EINLIEFERUNG ERTEILT                           |
| 800        | AUFTRAG ERFOLGREICH GEBUCHT - UM-/FESTSCHREIBUNG AUSSTEHEND   |
| 801        | MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT NICHT VEREINNAHMT, KEIN GEGENTRESOR |
| 802        | BOGENTRESOR HAT NICHT VEREINNAHMT, KEIN GEGENTRESOR           |
| 803        | MANTEL-/UNIKATE- UND BOGENTRESOR HABEN NICHT VEREINNAHMT      |
| 811        | MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT VEREINNAHMT, BOGENTRESOR NICHT      |
| 812        | BOGENTRESOR HAT VEREINNAHMT, MANTEL/UNIKATETRESOR NICHT       |
| 821        | MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT VEREINNAHMT, KEIN GEGENTRESOR       |
| 822        | BOGENTRESOR HAT VEREINNAHMT, KEIN GEGENTRESOR                 |
| 823        | MANTEL-/UNIKATETRESOR UND BOGENTRESOR HABEN VEREINNAHMT       |
| 911        | MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT GELOESCHT, BOGENTRESOR NICHT        |
| 912        | BOGENTRESOR HAT GELOESCHT, MANTEL-/UNIKATETRESOR NICHT        |
| 921        | MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT GELOESCHT, KEIN GEGENTRESOR         |
| 922        | BOGENTRESOR HAT GELOESCHT, KEIN GEGENTRESOR                   |
| 923        | MANTEL-/UNIKATETRESOR UND BOGENTRESOR HABEN GELOESCHT         |
| 931        | MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT STORNIERT, BOGENTRESOR NICHT        |
| 932        | BOGENTRESOR HAT STORNIERT, MANTEL-/UNIKATETRESOR NICHT        |
| 941        | MANTEL-/UNIKATETRESOR HAT STORNIERT, KEIN GEGENTRESOR         |
| 942        | BOGENTRESOR HAT STORNIERT, KEIN GEGENTRESOR                   |
| 943        | MANTEL-/UNIKATETRESOR UND BOGENTRESOR HABEN STORNIERT         |
| 990        | UEBERLEITUNG NACH CARAD                                       |

| Feldinhalt | Text                               |
|------------|------------------------------------|
| 991        | LOESCHUNG WG. KADI AUF CARAD       |
| 999        | GELÖSCHT DURCH SYSTEM ODER MANUELL |

### BESONDERHEIT

Feldname: Besonderheit

#### BESCHREIBUNG

Dieses Kennzeichen dient zur Angabe einer abweichenden Urkundenausstattung für die WKN.

| Feldinhalt | Bedeutung                               |
|------------|---|
| 1          | NORMALER BLOCK                          |
| 2          | BOGENLOS                                |
| 3          | NUR MANTEL, KEIN BOGENAUSDRUCK          |
| 4          | EINZELURKUNDE, MANTEL/GLOBALBOGEN       |
| 5          | MANTEL, BOGEN, ZESSION                  |
| 6          | MANTEL, TALON, ZESSION                  |
| 7          | BLOCK MANUELL ERFASST                   |
| 8          | BLOCK AUS HANDBESTAND                   |
| 9          | EINZELURKUNDE, GLOBALMANTEL/EINZELBOGEN |
| 11         | ALTE URKUNDEN                           |
| 14         | M + B GETRENNT                          |
| 15         | NUR MANTEL                              |
| 16         | UNIKAT                                  |
| 17         | UNITS                                   |
| 18         | CF- UND K-STUKKEN                       |
| 19         | CF-STUKKEN                              |
| 20         | TECHN.GLOBALURK. M.BOG. (MAN.ERST.)     |
| 21         | TECHN.GLOBALURK. O.BOG. (MAN.ERST.)     |
| 22         | TECHN.GLOBALURK. M.BOG. (LIEFERBAR)     |
| 23         | TECHN.GLOBALURK. O.BOG. (LIEFERBAR)     |
| 24         | MIT BOGEN                               |
| 25         | OHNE BOGEN                              |
| 26         | JGS OHNE BOGEN                          |
| 27         | FESTSCHREIBUNG                          |
| 28         | NUR BOGEN                               |
| 29         | MANTEL,ZESSION                          |
| 30         | BOGEN, ZESSION                          |
| 31         | MANTEL,BOGEN,ZESSION,ABTRETUNG(en)      |
| 32         | MANTEL,ZESSION,ABTRETUNG(EN)            |
| 33         | BOGEN,ZESSION,ABTRETUNG(EN)             |

## Anhang 2: Tabellen (Schlüsselverzeichnis)

| <b>Feldinhalt</b> | <b>Bedeutung</b>              |
|-------------------|-------------------------------|
| 34                | ZSESSION,ABTRETUNG(EN)        |
| 35                | ZSESSION                      |
| 36                | ABTRETUNG(EN)                 |
| 37                | MIT GEWINNANTEILSSCHEIN       |
| 38                | MÖGLICHER BEZUG VON URKUNDEN  |
| 39                | KEIN ZINSEN-/DIVIDENTENDIENST |
| 40                | KEIN ZINSSCHEIN / TALON       |
| 41                | NUR TALON                     |
| 47                | IGL MIT BOGEN                 |
| 48                | IGL OHNE BOGEN                |
| 49                | JUNGSCHHEIN MIT BOGEN         |
| 50                | NICHT VALUTIERT               |
| 52                | DAUERGLOBALURKUNDE MIT BOGEN  |
| 53                | DAUERGLOBALURKUNDE OHNE BOGEN |
| 54                | RAHMENURKUNDE MIT BOGEN       |
| 55                | RAHMENURKUNDE OHNE BOGEN      |
| 56                | GLOBALBONDS MIT BOGEN         |
| 57                | GLOBALBONDS OHNE BOGEN        |
| 97                | UMDEUTUNG GU/RU               |
| 98                | UMDEUTUNG WG: 670             |

## KENNZEICHEN BESTAND

Feldname: KZ-BST

### BESCHREIBUNG

Dieses Kennzeichen benennt die erweiterte Bestandsart bei RS, in die die Wertpapiere gebucht werden sollen.

| Feldinhalt | Text                |
|------------|---------------------|
| HB         | Hauptbestand        |
| FM         | Freier Meldebestand |

## EINLIEFERUNGS-ART

Feldname: EINLIEF-ART

### BESCHREIBUNG

Angabe über die Art des Auftrages

| Feldinhalt | Text                 | Bedeutung                             |
|------------|----------------------|---------------------------------------|
| 1          | LFD. EINLIEFERUNG    | Laufende Einlieferung                 |
| 2          | NEUZULASSUNG GLOBAL  | Neuzulassung Globalurkunde            |
| 3          | NEUZULASSUNG RU      | Neuzulassung Rahmenurkunde            |
| 4          | NEUZULASSUNG VAL. RU | Neuzulassung valutierte Rahmenurkunde |
| 5          | VALUTIERUNG          | Valutierung                           |

## EINLIEFERUNGS-GRUND

Feldname: EINLIEF-GRUND

### Beschreibung

Grund für die Einlieferung

| Feldinhalt | Beschreibung                                     |
|------------|--|
| 1          | aus Emission                                     |
| 2          | KE gegen Einlage                                 |
| 3          | Kapitalerhöhung bedingt – Optionsscheinausübung- |
| 4          | Rahmenurkunde Ersteinlieferung RS                |
| 5          | Urkundenumtausch                                 |
| 7          | Gratisaktien KE-unbedingt                        |
| 8          | Sperre, Revalutierung möglich                    |
| 10         | Direktbelieferung                                |
| 11         | SPERRE TEMP.URK. TD.                             |
| 12         | SPERRE FINAL.URK TD                              |

### UMLEGUNG-KZ

Feldname: UMLEGUNG

Beschreibung

Grund für die Umlegung

| KZ | Erläuterung |
|----|-------------|
| 1  | VL IN GS    |
| 2  | GS IN VL    |
| 3  | GS IN FTB   |
| 4  | FTB IN GS   |
| 5  | FTB IN FTB  |
| 6  | UMLEGUNG RU |

### KONTROLLKENNZEICHEN (BEARBEITUNGSZUSTAND)

Feldname: KONTROLLKENNZEICHEN/KZ

BESCHREIBUNG

Dieses Kennzeichen gibt an, ob und um welche Art von generiertem Auftrag es sich handelt.

Es ist unerheblich, ob ein im Auftragsstatus zur Änderung markierter und daraufhin im Erfassungsstatus generierter Auftrag tatsächlich geändert wird oder nicht. In der Kontrolle wird darauf keine Rücksicht genommen, d. h. ein im Erfassungsstatus zur Änderung generierter Auftrag kann ohne Änderung wieder in den Auftragsstatus gelangen.

| Feldinhalt | Bedeutung  |
|------------|--|
| „ “        | Auftrag ist nicht generiert  |
| „A“        | Auftrag wurde aus dem Auftragsstatus zur Änderung in den Erfassungsstatus generiert  |
| „L“        | Auftrag wurde aus dem Auftragsstatus zur Löschung in den Erfassungsstatus generiert oder Rücknahme Match-Auftrag/Match-Instruktion |

### KONTROLL-STATUS

Feldname: KONTROLLKENNZEICHEN/KZ

BESCHREIBUNG

Dieses Kennzeichen beinhaltet den momentanen Status des Auftrages bezüglich Kontrolle/Fehler.

| Feldinhalt | Bedeutung                     |
|------------|-------------------------------|
| „ “        | Auftrag noch nicht bearbeitet |
| F          | Auftrag fehlerhaft            |
| K          | Auftrag kontrolliert          |

Mangel

Feldname: MANGEL

BESCHREIBUNG

Dieses Kennzeichen identifiziert ein Mangelstück (Ausprägungen ab 50) oder kennzeichnet eine oppositionsbelegte Stückenummer (Ausprägungen 0 bis 49).

| WSS-KZ            | WM-KZ | Mangelgrund   |
|-------------------|-------|---|
| <b>OPPOSITION</b> |       |   |
| 0                 |       | Keine Angabe  |
| 1                 | A     | Aufgebot  |
| 2                 | B     | Aufgebot, Zahlungssperre  |
| 3                 | C     | Kraftloserklärung Aufgebot  |
| 4                 | D     | Diebstahl/Raub  |
| 5                 | F     | aus ausländischer Oppositionsliste  |
| 7                 | K     | Kraftloserklärung Aktiengesellschaft  |
| 8                 | L     | Aufhebung einer Verlustmeldung  |
| 9                 | M     | Aufhebung eines Aufgebots   |
| 10                | N     | Aufhebung einer Zahlungssperre  |
| 11                | O     | Aufhebung eines Aufgebots und einer Zahlungssperre  |
| 12                | T     | Totalfälschung möglich  |
| 13                | V     | Verlust ohne Angabe   |
| 14                | X     | Verlust auf dem Postweg   |
| 15                | Z     | Zahlungssperre  |
| 16                | W     | Verlust   |
| 17                | U     | Totalfälschung möglich  |
| 18                | P     | Aufgebot  |
| 19                | Y     | Zahlungssperre  |
| 20                | Q     | Aufgebot/Zahlungssperre - Umtausch  |
| 21                | R     | Kraftloserklärung, Aufgebot   |
| 22                | S     | Aufhebung eines Aufgebots und einer Zahlungssperre  |
| 24                | G     | aus ausländischer Oppositionsliste  |
| 25                | E     | siehe Textinfo  |
| 26                | H     | Kraftloserklärung nach ausländischem Recht  |
| 27                | J     | Kraftloserklärung nach ausländischem Recht (Ersatzurkunden sind ausgestellt, Stücknummern bleiben gesperrt) |
| 28                | I     | Aufgebotsfrist abgelaufen, kein Ausschlussurteil (Stücknummern bleiben gesperrt)                            |
| 29                | 1     | Übernahme in neue ISIN/WKN  |
| <b>MANGEL</b>     |       |   |
| 51                |       | Alturkunden mit Litera  |
| 52                |       | Verletzung verahrungstechnischer Angaben  |

## Anhang 2: Tabellen (Schlüsselverzeichnisse)

| <b>WSS-KZ</b> | <b>WM-KZ</b> | <b>Mangelgrund</b>  |
|---------------|--------------|---|
| 53            |              | Verletzung von Kontroll- oder Treuhänderunterschriften                    |
| 54            |              | Kupon-Beschädigung  |
| 55            |              | Nicht lieferbare Urkunden w/Einlieferung zu Gunsten ausl. Sammelverwahrer |
| 56            |              | Roll Over mit Stempel   |
| 57            |              | Versiegelt oder verplompt   |
| 58            |              | Geheftet  |
| 61            |              | Kupongroße Ausstanzungen  |
| 62            |              | Abrisse und Ausrisse, soweit die Guillochen verletzt sind                 |
| 63            |              | Einrisse und Einschnitte, die über die Mitte des Stückes hinausgehen      |
| 64            |              | Reservierte Urkunden  |
| 70            |              | nicht zumutbare Lieferung   |
| 71            |              | Mantel abweichende Stückenummer   |
| 72            |              | Bogen abweichende Stückenummer  |
| 81            |              | Mantel effektiv/Bogen global  |
| 82            |              | Mantel global/Bogen effektiv  |
| 83            |              | Haftungserklärung Einlieferer   |
| 91            |              | Haftungserklärung CEU   |

## NACHWEISART

Feldname: Nachweisart

Kennzeichen, in welcher Form die Urkunden bei der CEU eingeliefert werden. Juni 2026

| Feldinhalt | Text  | Bedeutung   |
|------------|---|---|
| 01         | EINLIEFERUNG EFFEKTIVER URKUNDEN                        | Einlieferung effektiver Urkunden                        |
| 02         | URKUNDEN LIEGEN BEREITS VOR                             | Urkunden liegen bereits vor                             |
| 03         | URK. VON DRUCK./EM.                                     | Urkunde von Druckerei oder Emittent                     |
| 04         | EINLIEFERUNG MIT RAHMENVERTRAG                          | Einlieferung ohne Urkunden                              |
| 05         | EINLIEFERUNG EFFEKTIVER URKUNDEN VORGESEHEN UND ZESSION | Einlieferung effektiver Urkunden vorgesehen und Zession |
| 06         | UM-/FESTSCHREIBUNG                                      | Zession liegt wegen Um-/Festschreibung noch nicht vor   |
| 07         | ZESSION FEHLT   | Zession liegt nicht vor                                 |
| 08         | EINLIEF EDT <sup>a</sup>                                | Einlieferung in eMission                                |
| 09         | EDELMETALL  | Einlieferung von Edelmetallen                           |
| 10         | EINLIEF. LEAN   | Einlieferung im EDT LEAN Verfahren                      |
| 12         | PUBLIC ISSUANCE   | Öffentliche Emission                                    |
| 13         | SCHALTERHALLE   | Einreichung über Publikumsverkehr                       |
| 14         | SONSTIGES   |   |

- a. Die Bezeichnung "EDT" bleibt im Gebrauch der CASCADE-Texte erhalten, verweist aber auf den eMission-Prozess.

## Anhang 3: Tabellen (Berechtigungsprüfung)

### Definition der Gattungen mit Berechtigungsprüfung

Valutierungen und Revalutierungen ohne Auslieferung Rahmenurkunde von Gattungen mit folgender Wertpapiergruppe (G06) werden mittels einer automatischen Berechtigungsprüfung und einer automatischen Buchungsfreigabe bearbeitet:

| <b>Instrument type GD198C (GF1)</b> | <b>Beschreibung</b>  |
|-------------------------------------|--|
| 2001                                | Anleihen (Obligationen, Schuldverschreibungen, Bonds, Notes) |
| 2002                                | Kassenobligationen   |
| 2003                                | Pfandbriefe  |
| 2004                                | European Covered Bonds                                       |
| 2005                                | Schatzanweisungen  |
| 2006                                | Finanzierungs-Schätze  |
| 2007                                | Bundesschatzbriefe Typ A                                     |
| 2008                                | Trust Preferred Securities (TPS)/Renten                      |
| 2009                                | Bundesschatzbriefe Typ B                                     |
| 2010                                | Fundierungsschuldverschreibungen                             |
| 2011                                | Certificates of Deposit                                      |
| 2012                                | Gewinnobligationen   |
| 2021                                | Linked Bonds (sonstige)                                      |
| 2022                                | Inflation Linked   |
| 2031                                | Anleihen mit Andienungsrecht                                 |
| 2032                                | Tagesanleihen  |
| 2201                                | Asset Backed Securities                                      |
| 2202                                | Asset Backed Commercial Papers                               |
| 2203                                | Commercial Papers  |
| 2204                                | Credit Linked Notes  |
| 2205                                | Mortgage Backed Securities                                   |
| 2206                                | Collateral Debt Obligation                                   |
| 2207                                | Synthetische Collateral Debt Obligation                      |
| 2208                                | Synthetische Mortgage Backed Securities                      |
| 2209                                | Synthetische Asset Backed Securities                         |
| 2210                                | Loan Participation Notes                                     |
| 2701                                | Wandelanleihe/Convertible                                    |
| 2702                                | Wandelanleihe/Convertible cum Optionsschein                  |
| 2703                                | Wandelanleihe/Convertible ex Optionsschein                   |
| 2711                                | Optionsanleihe cum Optionsschein                             |
| 2712                                | Optionsanleihe ex Optionsschein                              |
| 2801                                | Anleihen mit zertifikatsähnlicher Struktur                   |

| <b>Instrument type GD198C (GF1)</b> | <b>Beschreibung</b>  |
|-------------------------------------|--|
| 2803                                | Pfandbriefe mit zertifikatsähnlicher Struktur  |
| 2805                                | Verzinsliche Schatzanweisungen mit zertifikatsähnlicher Struktur   |
| 2811                                | Certificates of Deposit mit zertifikatsähnlicher Struktur  |
| 2821                                | Linked Bonds mit zertifikatsähnlicher Struktur   |
| 2822                                | Inflation Linked mit zertifikatsähnlicher Struktur   |
| 2892                                | An.zert.-ähn.Str.MRZ←80%   |
| 2893                                | Pf.zert.-ähn.Str.MRZ←80%   |
| 2894                                | Schatzanweisungen mit zertifikatsähnlicher Struktur und Mindestrückzahlung von weniger als 80% des eingesetzten Kapitals (Grundlage Emissionskurs) |
| 2895                                | CD zert.-ähn.Str.MRZ←80%   |
| 2896                                | LB zert.-ähn.Str.MRZ←80%   |
| 2897                                | UA zert.-ähn.Str.MRZ←80%   |
| 3001                                | Warrants   |
| 3101                                | Covered Warrants   |
| 4001                                | Zertifikate auf Wertpapiere  |
| 4002                                | Zertifikate auf Indizes  |
| 4003                                | Zertifikate auf Rohstoffe  |
| 4004                                | Zertifikate auf Währungen  |
| 4005                                | Zertifikate auf Zinssätze  |
| 4006                                | Zertifikate auf sonstige Werte   |
| 4007                                | Zertifikate auf Futures  |
| 5001                                | Wertpapierfonds  |
| 5002                                | Immobilienfonds  |
| 5003                                | Indexfonds   |
| 5004                                | Terminmarktfonds   |
| 5005                                | Sonstige Anlagefonds   |
| 5006                                | Hedgefonds   |
| 5007                                | Altersvorsorgefonds  |
| 5011                                | Gemischte Wertpapier- und Immobilienfonds  |
| 5012                                | Beteiligungsfonds  |
| 6111                                | Genussrechte/Genussscheine   |

## Anhang 3: Tabellen (Berechtigungsprüfung)

### Definition der nicht zugelassenen Gattungen

Folgende Instrumenten-Arten (GD198C) obliegen nicht den automatisch zu verarbeitenden Gattungen (gemäß obiger Definition).

| <b>Instrument type GD198C (GF1)</b> | <b>Beschreibung</b>  |
|-------------------------------------|----------------------|
| 6005                                | Droit de Vote        |
| 7001                                | Futures              |
| 7501                                | Options              |
| 7601                                | Basis Trade          |
| 7801                                | Option/Option        |
| 7802                                | Future/Future        |
| 7803                                | Product Spread       |
| 8011                                | Commercial Paper Pro |
| 8012                                | Commercial Paper MTN |
| 8021                                | Medium-Term Note Pro |
| 8041                                | Spezifische Programm |
| 8103                                | Dummy-WKN tech.Werte |
| 8105                                | Dummy-WKN Basisw.WMI |
| 8201                                | Durchschn.Kurse Dep. |
| 8202                                | Durchschn.Zinssätze  |
| 8301                                | synth. Rente/Anleihe |
| 8401                                | Geldmarkt-Satz       |
| 8501                                | Swap-Satz            |
| 8601                                | Maß-Einheit          |
| 8603                                | Ausgleichsfaktor     |
| 8604                                | Differenzbetrag      |
| 8701                                | Aktien-Index         |
| 8702                                | Renten-Index         |
| 8704                                | Währungs-Index       |
| 8705                                | Edelmetall-Index     |
| 8706                                | Sonstiger Index      |
| 8707                                | Fonds-Index          |
| 8708                                | Volatilitäts-Index   |
| 8709                                | Commodity-Index      |
| 8710                                | Geldmarkt-Index      |
| 8711                                | Div.-Index           |
| 8801                                | Aktien-Basket        |
| 8802                                | Renten-Basket        |
| 8806                                | Sonstiger Basket     |
| 8807                                | Index-Basket         |
| 8808                                | Invest.Ant. Basket   |

| <b>Instrument type GD198C (GF1)</b> | <b>Beschreibung</b> |
|-------------------------------------|---------------------|
| 8809                                | Commodity-Basket    |
| 9101                                | Strom               |
| 9701                                | Währungen           |
| 9801                                | Cross Rates         |

## Anhang 4: Tabellen (Buchungstextschlüssel)

### BUCHUNGS-TEXT-SCHLÜSSEL-TABELLE - DEPOTBUCHHALTUNG

| Textschlüssel | Bedeutung   |
|---------------|---|
| 01            | WP-Übertrag ohne Gegenwert - Bank-Erfassung                                 |
| 02            | WP-Übertrag ohne Gegenwert - CEU-Erfassung                                  |
| 03            | Auslieferung  |
| 05            | Verpfändung/Freigabe  |
| 06            | WP-Übertrag mit Gegenwert Bank-Erfassung                                    |
| 08            | Einbuchung einer Reservierung zugunsten des Unterkontos/995                 |
| 09            | WP-Übertrag mit Gegenwert CEU-Erfassung                                     |
| 10            | Einbuchung aufgrund von Beständen (aus Kapitaldienste)                      |
| 12            | Rückzahlung (aus Kapitaldienste)  |
| 13            | Split (aus Kapitaldienste)  |
| 14            | Ausgleich (aus Kapitaldienste)  |
| 15            | Berichtigungsaktien (aus Kapitaldienste)                                    |
| 16            | Umbuchung (aus Kapitaldienste)  |
| 17            | Umstellung (aus Kapitaldienste)   |
| 18            | Aktienumtausch (aus Kapitaldienste)   |
| 19            | Änderung der Verbriefungsart/Jungschein-Auflösung (aus Kapitaldienste)      |
| 20            | Gesamt-Depot-Übertrag   |
| 22            | DTCC-Überträge ohne Gegenwert   |
| 24            | Bondstripping-Trennung  |
| 25            | Bondstripping-Zusammenführung   |
| 26            | Optionsscheintrennung   |
| 27            | Optionsscheinzusammenführung  |
| 30            | Einlieferung  |
| 31            | Altsparer-Entschädigung   |
| 33            | Rücktausch GBC  |
| 34            | Umtausch GBC  |
| 35            | WP-Leihe  |
| 36            | WP-Leihe Rückübertragung  |
| 37            | Redenomination Ausbuchen (EURO)   |
| 38            | Redenomination Einbuchen (EURO)   |
| 39            | Ausgleichsbuchung ohne Gegenwert (automatischer WP-Übertrag ohne Gegenwert) |
| 41            | GS-Börse  |
| 42            | STR-Börse   |
| 43            | WPR-Börse   |

| <b>Textschlüssel</b> | <b>Bedeutung</b>                         |
|----------------------|--|
| 44                   | AKV-Börse                                |
| 50                   | Eurex                                    |
| 97                   | Rücknahme der Reservierungsbuchung (RTS) |
| 99                   | Storno                                   |



---

**Kontakt**

[www.clearstream.com](http://www.clearstream.com)

**Veröffentlicht von**

**Clearstream Europe AG**

Clearstream Europe AG  
Mergenthalerallee 61  
65760 Eschborn  
Deutschland

**Postanschrift**

Clearstream Europe AG  
60485 Frankfurt/Main  
Deutschland

Juni 2026

Dokumentnummer: F-CON04

---