

CBF Release im November 2013: Vorankündigung der Änderungen

Clearstream Banking informiert die Kunden bereits vorab über einige Änderungen, die mit dem Einsatz des folgenden CBF Release am

18. November 2013

eingesetzt werden, da diese Änderungen auf Kundenseite ggf. Systemänderungen nach sich ziehen.

Über weitere Änderungen, die im Rahmen des CBF Release im November 2013 in Kraft treten, und Details zu den bereits unten aufgeführten Änderungen werden wir Sie zu einem späteren Zeitpunkt informieren.

1. CASCADE LION Reporting

Auf Grund der Handelszeitverlängerung an der Börse Stuttgart wird den Kunden mit dem CBF Release ab 18. November 2013 eine zusätzliche MT537-Übertragung mit offenen Börsengeschäften (Pending SE Trades) zur Verfügung gestellt.

Die neue Übertragung erfolgt im Anschluss an die aktuelle Übertragung, die heute um ca. 23:00 Uhr versandt wird.

Bisher werden alle neuen Börsengeschäfte (LION-Geschäfte) vom vorangegangenen Handelstag (Tagesgeschäfte) in der MT537-Übertragung gegen 23:00 Uhr bereitgestellt. Um weitere Verzögerungen dieser Übertragung durch die längeren Handelszeiten zu vermeiden, werden die Börsengeschäfte wie folgt auf die bisherige und die neue Übertragung aufgeteilt:

- **Regelfall, bei pünktlicher Anlieferung durch die Börsensysteme:**
Alle neuen Geschäfte (Tagesgeschäfte), die CBF von den Börsensystemen bis 23:00 Uhr erhält, sind in der ersten (heutigen) Übertragung enthalten
- **Ausnahmefall, bei verspäteter Anlieferung einzelner Börsensysteme:**
Neue Geschäfte (Tagesgeschäfte), die nach 23:00 Uhr von den Börsensystemen an CBF übermittelt werden, sind in der neuen Übertragung enthalten

Sollten alle Geschäfte vor 23:00 Uhr an CBF übermittelt worden sein, entfällt die zweite Übertragung oder es wird ein MT537 ohne Geschäftsvorfälle übertragen, falls der Kunde diese Option für den MT537-Versand beantragt hat.

Im Detail ergeben sich hierdurch folgende Änderungen:

1.1 Änderungen im MT537-Reporting (Pending SE Trades)

Kunden, die den MT537- Pending SE Trades beziehen, können grundsätzlich zwischen zwei sich inhaltlich unterscheidenden Optionen wählen.

1. Restanten und Tagesgeschäfte:
Es werden die neuen Transaktionen (Tagesgeschäfte) und die noch nicht regulierten Geschäfte (Stand nach STD) von den vorangegangenen Handelstagen (Restanten) versendet
2. Nur Tagesgeschäfte:
Es werden nur neue Transaktionen vom vorangegangenen Handelstag (Tagesgeschäfte) versendet

Die Nachrichten werden heute zeitlich und inhaltlich wie folgt bereitgestellt:

Übertragung	Option 1 Restanten und Tagesgeschäfte	Option 2 Nur Tagesgeschäfte
Nach STD	<ul style="list-style-type: none"> • Alle Tagesgeschäfte • Restanten nach STD 	<ul style="list-style-type: none"> • Alle Tagesgeschäfte
Nach SDS 1	<ul style="list-style-type: none"> • Restanten nach SDS 1 	
Nach SDS 2	<ul style="list-style-type: none"> • Restanten nach SDS 2 	

Ab 18.November 2013 werden die Nachrichten zu folgenden Versandzeiten mit den entsprechenden Inhalten zur Verfügung gestellt:

Übertragung	Option 1 Alle offenen Geschäfte	Option 2 Alle neuen Geschäfte
Übertragung 1 (ca. 23:15 oder früher)	<ul style="list-style-type: none"> • Tagesgeschäfte • Restanten nach STD 	<ul style="list-style-type: none"> • Tagesgeschäfte
Übertragung 2 (ca. 23:45 oder später)	<ul style="list-style-type: none"> • Tagesgeschäfte, die in der ersten Übertragung noch nicht enthalten waren 	<ul style="list-style-type: none"> • Tagesgeschäfte, die in der ersten Übertragung noch nicht enthalten waren
Nach SDS 1	<ul style="list-style-type: none"> • Restanten nach SDS 1 	
Nach SDS 2	<ul style="list-style-type: none"> • Restanten nach SDS 2 	

1.2 Technische Einrichtung der neuen Übertragung

Für Kunden, die MT537-Nachrichten mit Börsengeschäften heute bereits per MQ series oder SWIFT erhalten, wird die neue Übertragung automatisch generiert. Eine separate Beantragung der neuen Übertragung ist dann nicht erforderlich.

Erfolgt der Versand per File Transfer, wird CBF die neue Übertragung einrichten und sich zu Abstimmzwecken mit den betroffenen Kunden in Verbindung setzen.

Die neue MT537 Übertragung wird auf Basis der bereits heute von den Kunden bestellten Option eingerichtet.

Kunden, die bisher keine „Leerdateien“ d.h. MT537-Nachrichten ohne Geschäftsvorfälle beziehen, diese aber zukünftig benötigen, werden gebeten sich mit Customer Service Connectivity bis spätestens 4 Wochen vor Release- Einsatz in Verbindung zu setzen.

1.3 Lieferliste

Der Versand der Lieferliste erfolgt unverändert über die bestehende Übertragung und enthält weiterhin alle Tagesgeschäfte vom Vortag. Werden Geschäfte aus den Börsensystemen verspätet an LION übermittelt, kann es, wie bereits heute, hierdurch zu Verzögerungen in der Übertragung kommen.

1.4 Testdateien

Über die Möglichkeit, Testdateien oder -nachrichten in der Simulationsphase (voraussichtlich im November 2013) zu beziehen, werden wir Sie zu einem späteren Zeitpunkt informieren.

2. Neuer Geldtagesauszug

Ab 18. November 2013 wird zusätzlich zu den bestehenden Geldtagesauszügen für DD1, DD2 und DD3 ein neuer Geldtagesauszug übertragen, der die Geldumsätze aller drei DD-Geldverrechnungszyklen beinhaltet. Der Geldtagesauszug wird in einem neuen Format (Querformat) erstellt, und die einzelnen Geldbuchungen werden nach anderen Kriterien als den heutigen akkumuliert. Dadurch sind die akkumulierten Beträge auf dem Geldtagesauszug leichter mit Hilfe der CASCADE online-Anzeige KNZI-ID nachvollziehbar.

Ein Beispiel für den neuen Geldtagesauszug finden Sie im Anhang.

Sortierungskriterien für die Akkumulation von Geldumsätzen:

Sortierungskriterien Geldtagesauszug	
Nr.	Feld
1	Geldverrechnungszyklus (DD1-DD3)
2	Paketnummer
3	CBF Kontostammnummer
4	Quelle (manuell oder automatisch)
5	Buchungstextschlüssel
6	Zuerst Lastschriften, dann Gutschriften

Manuell von CBF eingestellte Buchungen werden nicht akkumuliert sondern einzeln ausgewiesen.

Die Akkumulierung nach Originalvaluta wie in den aktuellen Geldtagesauszügen entfällt.

Der neue Geldtagesauszug wird gemeinsam mit den bestehenden, in Format und Inhalt unveränderten Geldtagesauszügen in dem aktuellen Übertrager J_200785 unter der Programmnummer KN173 um ca. 15:30 Uhr ausgegeben. Die Übertragung erfolgt automatisch und muss nicht von den Kunden beantragt werden.

Hinweis: Kunden, die den Geldtagesauszug über CA-Spool erhalten, werden ausdrücklich darauf hingewiesen, dass sie ggf. intern die Druckereinstellungen so anpassen müssen, dass die bisherigen Listen im Hochformat und die neue Liste im Querformat gedruckt werden können.

3. CBF SWIFT Release

Das SWIFT Release im November 2013 wird Anpassungen im Custody Reporting per MT564 und MT566 notwendig machen. Details hierzu werden zu einem späteren Zeitpunkt bekannt gegeben.

Alle anderen Reports sind vom SWIFT Release nicht betroffen.

4. Änderungen im CBF Custody Reporting

Unabhängig von den Änderungen, die für das SWIFT Release notwendig werden, wird CBF die folgenden Änderungen im Bereich Custody Reporting vornehmen:

4.1 Abschaffung des Custody Payments File

Der Custody Payments File wird ab dem 18. November 2013 nicht mehr an die Kunden ausgegeben. Kunden, die den Custody Payments File noch beziehen, können jederzeit auf das Reporting im SWIFT-Format MT564/566 umstellen und werden gebeten, sich diesbezüglich schnellstmöglich mit dem Customer Service Connectivity in Verbindung zu setzen.

4.2 Umsetzung von „Zwei Event Szenarien“

CBF wird künftig „Zwei Event Szenarien“, d.h. Maßnahmen die in zwei unterschiedlichen Phasen umgestellt werden (z.B. obligatorische und freiwillige Phase), gemäß den von der CAJWG (Corporate Action Joint Working Group) erarbeiteten Standards ausweisen. Die folgenden Maßnahmen sind hiervon betroffen:

- Kapitalerhöhung gegen Zahlung (RHDI/EXRI – KADI-Terminart TA210):
- Obligatorische Maßnahmen unter Zwischenschaltung einer Interims-ISIN (z.B. SOFF/EXOF – KADI-Terminart TA211)
- Freiwillige Maßnahmen unter Zwischenschaltung einer Interims-ISIN (z.B. TEND/EXOF – KADI-Terminart TA280)

4.3 MT564 Vorabinformation für OGAW relevante Maßnahmen

Ab 18. November wird CBF eine bestandsbezogene Vorabinformation MT564 für OGAW relevante Informationen von Fonds versenden, die vorab angekündigt wurden, ohne dass der Termin zur Durchführung der entsprechenden Kapitalmaßnahme (Non-Income) schon bekannt ist.

Es handelt sich dabei um Maßnahmen (Non-Income), die aufgrund der OGAW Gesetzgebung vorab zu veröffentlichen sind, wie

- angekündigte Fondsverschmelzungen
- Fondsschließungen
- Aussetzung oder Wiederaufnahme der Rücknahme von Fondsanteilen
- Änderungen der Vertragsbedingungen
- Änderungen der Berechnung des Anteilswertes

Die Information wird auf Basis des WM Datenfelds UD008A (Umtauschgrund) mit der Terminart 281, der bestehenden KADI-Terminart für Informationen über Maßnahmen ohne direkte Durchführung, generiert.

4.4 MT566 Bestätigung für manuelle Buchungen

Für Geldebuchungen, die CBF auf Grund einer Kapitalmaßnahme (Income und Non-Income) manuell eingestellt hat, werden zukünftig auch MT566 Bestätigungen versandt. Die Bestätigungen werden direkt im Anschluss an den jeweiligen Geldverrechnungszyklus DD1, DD2 oder DD3 ausgegeben.

Details zu den oben beschriebenen Änderungen werden zu einem späteren Zeitpunkt veröffentlicht.

5. Xemac

Im Vorfeld der Einführung der grenzüberschreitenden Nutzung von Triparty Collateral Management Services zur Besicherung von geldpolitischen Operationen des Eurosystems, die für 2014 vorgesehen ist, werden die Prozesse in Xemac entsprechend angepasst. Insbesondere ändert sich in diesem Zusammenhang die Vorgehensweise im Falle einer Untersicherung hervorgerufen durch neue Preise als auch anstehende Kapitaldienste:

- Veränderung der Xemac Bewertungsprozesse und deren Berücksichtigung im Sicherheitenpool der Deutschen Bundesbank
- Behandlung der Zahlungsprozesse für betroffene Kapitaldienste

6. Wertpapierleihe

Die folgenden Erweiterungen sind geplant:

- Einführung der Mehrwährungs-Fähigkeit in der Wertpapierleihe, hierdurch können Kunden in Nicht-EUR Währungen instruieren
- Es werden geringe Anpassungen im pdf- und csv-Reporting vorgenommen
- Erweiterung des Tagesend-Reportings - die bestehenden Reports werden über einen neuen Reporting-Kanal angeboten

Weitere Informationen

Weitere Informationen erhalten Sie von Clearstream Banking Customer Service oder Ihrem Relationship Officer.

Anhang 1

Beispiel neuer Geldtagesauszug:

CLEARSTREAM BANKING AG						SEITE : 1	
1234/000							
Testbank							
GELDTAGESAUZUG (EOD) NR. 027 VOM 05.02.2013 PER							
LAUF PN KTO V TXT REFERENZ						SOLL	HABEN
ALTER SALDO							0,00
VALUTA: 05.02.13							
ZINSEN	DD1	1	1234	A	300		6.025.649,00
ZINSEN	DD1	1	1234	A	301	7.177.967,50	
BEZ.R.AUSUEB.	DD1	1	1234	M	701 DE0001234567	210.855,95	
ZINSEN	DD1	1	4321	A	300		90.500,00
BEZ.R.AUSUEB.	DD1	1	4321	M	701 AC. 7xxxx Ref: ACC-20000988,	3.010,05	
ZINSEN	DD1	1	5678	A	300		4.864.376,52
AUSGLEICH PAKET 1-8	DD1	1			051	3.588.692,02	
KOMP.ZINS.W/XEMAC	DD1	9	1234	A	315		1.625.000,00
GUTSCHRIFT SONST.	DD1	9	1234	M	080 Sec.Lending		115.000,00
KOMPENS.DIV.OTC	DD1	9	4321	A	412		1.785,00
AUSGLEICH PAKET 9	DD1	9			052	1.741.785,00	
GESAMTRUECKZAHL.	DD2	1	1234	A	500		87.300,00
BEZ.R.HANDEL.	DD2	1	1234	M	700		10.376,52
AUSGLEICH PAKET 1-8	DD2	1			051	97.676,52	
KOMP. DIV. BOE.	DD2	9	1234	A	413	9.300,00	
AUSGLEICH PAKET 9	DD2	9			052		9.300,00
BEZ.R.HANDEL.	DD3	9	1234	M	700 ACC.7xxxx Ref: ABC-1234		5.340,52
BRUCHST.HANDEL.	DD3	9	1234	M	704 DE0007654321	2.860,67	
AUSGLEICH PAKET 9	DD3	9			059	2.479,85	
SUMME UMSAETZE						12.834.627,56	12.834.627,56
NEUER SALDO (VORBEHALTLICH MITBESITZUEBERGANG							0,00
GEMAESS ONLINE-ANZEIGE IN CASCADE)							