

CBF Release

Informationen zum Release

18. November 2013

CBF Release

Informationen zum Release

18. November 2013

Oktober 2013

Dokumentnummer: F-CON33

Dieses Dokument ist Eigentum von Clearstream Banking AG, Frankfurt (Clearstream Banking) und darf nur mit der vorab eingeholten schriftlichen Zustimmung von Clearstream Banking abgeändert werden. Die Angaben in diesem Dokument können ohne Vorankündigung geändert werden und stellen keine Verpflichtung von Clearstream Banking, einer anderen Tochtergesellschaft oder einem anderen verbundenen Unternehmen von Clearstream International S.A. dar.

© Copyright Clearstream Banking AG, Frankfurt (2013). Alle Rechte vorbehalten.

Clearstream Banking AG, Frankfurt ist ein Unternehmen der Gruppe Deutsche Börse.

Vorwort

Die vorliegende Information stellt Ihnen umfassend und detailliert die Neuerungen vor, die am 18. November 2013 für folgende Servicebereiche eingeführt werden:

- Clearing und Settlement Services
- CASCADE-PC
- Custody Services
- GSF Service
- Vaults Services

Neben einer neuen CASCADE-PC-Version 7.9 mit Funktionen zur Anforderung von persönlichen Bestandslisten und der Möglichkeit, nunmehr auch Optionsscheintrennungen/-zusammenführungen online bearbeiten zu können, bietet CBF auch ein verbessertes Reporting für Börsengeschäfte (MT537-Reporting) sowie ein neues Layout für den Geldtagesauszug. Der Kreis der für den Selbstbesicherungs-Service zulässigen Wertpapiere wird um ausländische Wertpapiere in Girosammelverwahrung erweitert.

Im Bereich Custody Services setzt CBF Corporate Action Standards gemäß Corporate Action Joint Working Group (CAJWG) und Corporate Action Sub Group (CASG) um. Diese betreffen insbesondere die Anpassung der Periode für das Market Claiming auf 20 Tage sowie die Umsetzung von „Zwei Event Szenarien“ (MT564). Weiterhin werden Anpassungen im Rahmen der German Market Practice Groups, wie beispielsweise MT564 – “For Info Only“, vorgenommen.

Für Wertpapiere, die zu Gunsten der Deutschen Bundesbank verpfändet sind, führt GSF Service neue abendliche Bewertungsläufe in Xemac ein. Nach dem letzten Lauf in Xemac wird eine Neubewertung aufgrund von neuen Preisen und Zulässigkeitskriterien sowie eine weitere Neubewertung über zusätzlich anstehende Kapitalmaßnahmen durchgeführt.

Im Bereich Vaults Services wird unter anderem eine Vorbelegung der Besonderheiten in der CASCADE Auftragsart 16 eingeführt.

Darüberhinaus wird CBF in Vorbereitung auf TARGET2-Securities bereits erste Maßnahmen einführen.

Wir bitten Sie, das Dokument an alle betroffenen Stellen in Ihrem Hause weiterzuleiten.

Bitte wenden Sie sich bei weiterem Informationsbedarf oder Fragen zu den einzelnen Themen an unseren Customer Service.

Wir weisen unsere Kunden an dieser Stelle darauf hin, dass Telefongespräche mit Clearstream Banking – wie in der Finanzbranche üblich – in einigen Bereichen aufgezeichnet werden. Dies soll gewährleisten, dass sowohl die Interessen der Clearstream Banking als auch die ihrer Kunden bei Missverständnissen oder Fehlübertragungen geschützt sind.

Zu den Bereichen, in denen die Telefongespräche aufgezeichnet werden, gehören der Customer Service, der Treasury Dealing Room und das Back Office. Die betreffenden Telefonleitungen unterliegen einer stetigen Wartung, um einen einwandfreien Betrieb sicherzustellen.

Inhalt

1.	Clearing und Settlement Services	5
1.1	Änderungen im MT537-Reporting (Pending SE Trades)	5
1.2	Neuer Geldtagesauszug	5
1.3	Änderung der Settlement Deadline für GC Pooling Transaktionen in EUR	5
1.4	Selbstbesicherung – Erweiterung der zulässigen Wertpapiere	6
2.	CASCADE-PC Version 7.9	7
2.1	Anforderung Persönliche Bestandslisten als Einzelauftrag	7
2.2	CASCADE-System-Information – Währungsparameter	8
2.3	Wertpapierübertrag - Optionsscheintrennung/-zusammenführung	10
2.3.1	Optionsscheintrennung	11
2.3.2	Optionsscheinzusammenführung	14
3.	Custody Services.....	16
3.1	MT564: Umsetzung von “Zwei Event Szenarien”	16
3.2	Einführung des MT564 – „For Info Only“	16
3.3	MT566 Bestätigungen für manuelle Geldebuchungen	17
3.4	Anpassungen durch das SWIFT SR 2013 und der Market Practice Groups	17
3.5	Abschaltung des Custody Payments File	17
3.6	Anpassung der Periode für das Market Claiming auf 20 Tage	18
3.7	Anpassung Persönliches Journal (KD111).....	18
3.7.1	Listenlayout (Deutsch).....	19
3.7.2	Listenlayout (Englisch)	20
3.8	Kundensimulation	21
4.	GSF Service	22
4.1	Xemac.....	22
4.1.1	Einsatz der neuen Xemac Version 5.5.....	22
4.1.2	Einführung neuer Xemac Bewertungsläufe im November 2013.....	22
4.1.3	Einführung neuer Cash-Prozesse im Februar 2014	22
4.1.4	Verbesserung des Xemac Clients: Ansichten.....	23
4.2	Wertpapierleihe	24
5.	Vaults Services.....	25
5.1	Erweiterung der Tabelle „stückespezifische Besonderheiten“	25
5.2	Vorbelegung der Besonderheiten in CASCADE Auftragsart 16	27
5.3	Maskenänderungen wegen Ausbau des Feldes “Serien WKN”	28
6.	Vorbereitende Maßnahmen für TARGET2-Securities (T2S)	34
6.1	Bank-Information Alpha-Suche.....	34
6.2	KUSTA Datenträger und KUSTA Internetdatei.....	44

1. Clearing und Settlement Services

1.1 Änderungen im MT537-Reporting (Pending SE Trades)

Aufgrund der Handelszeitverlängerung an der Börse Stuttgart im März 2013 wird den Kunden mit dem CBF Release ab 18. November 2013 eine zusätzliche MT537-Übertragung mit offenen Börsengeschäften (Pending SE Trades) zur Verfügung gestellt. Diese neue Übertragung erfolgt im Anschluss an die aktuelle Übertragung, die heute um ca. 23:00 Uhr versandt wird.

Im Regelfall werden die Geschäfte aller Börsen weiterhin in einer MT537 Übertragung zum gewohnten Zeitpunkt, d.h. bis 23:00 Uhr, versandt. Nur im Ausnahmefall, d.h. wenn die Börse Stuttgart (oder auch eine der anderen Börsen) die Geschäfte der CBF nicht rechtzeitig bereitstellen kann, werden die fehlenden Geschäfte erst in der zweiten Übertragung zur Verfügung gestellt.

Die neue Übertragung wird mit folgender Ausprägung (Statement-Nummer) ausgegeben und kann darüber identifiziert werden:

Feld :13A:: STAT//250

Weitere Einzelheiten zu den neuen Übertragungszeiten und -inhalten entnehmen Sie bitte dem Dokument „CBF Release im November 2013: Vorankündigung der Änderungen“, das am 30. Mai 2013 auf der Clearstream Website veröffentlicht wurde.

CBF wird die neue MT537-Übertragung auf Basis der bereits heute von den Kunden bestellten inhaltlichen Option einrichten (nur Tagesgeschäfte oder Tagesgeschäfte und Restanten). Sollten Kunden Änderungen der technischen oder inhaltlichen Parameter wünschen, werden sie gebeten, sich rechtzeitig mit dem Customer Service Connectivity in Verbindung zu setzen.

1.2 Neuer Geldtagesauszug

Ab 18. November 2013 stellt CBF zusätzlich zu den bisherigen Geldtagesauszügen einen neuen Geldtagesauszug mit verändertem Layout (Querformat) und mit neu sortierten Inhalten bereit.

Der neue Geldtagesauszug wird in die bestehende Übertragung aufgenommen, d.h. er muss nicht von den Kunden explizit bestellt werden. Wir weisen die Kunden darauf hin, dass aufgrund der verschiedenen Formate (Längs- und Querformat) innerhalb derselben Übertragung ggf. Druckparameter auf Kundenseite entsprechend angepasst werden müssen, um den neuen Geldtagesauszug lesbar ausdrucken zu können.

Details zu den Inhalten und dem Format des neuen Geldtagesauszugs entnehmen Sie bitte dem Dokument „CBF Release im November 2013: Vorankündigung der Änderungen“, das am 30. Mai 2013 auf der Clearstream Website veröffentlicht wurde.

Die parallele Bereitstellung der Geldtagesauszüge im bisherigen Format wird dann zum CBF Release November 2014 eingestellt.

1.3 Änderung der Settlement Deadline für GC Pooling Transaktionen in EUR

Ab 18. November 2013 können GC Pooling Transaktionen, die im Rahmen des RTS-DvP Settlement eingestellt werden (GC Pooling Overnight), bis 17:40 Uhr (heute 17:15 Uhr) abgewickelt werden.

1.4 Selbstbesicherung – Erweiterung der zulässigen Wertpapiere

Der von der CBF und der Deutschen Bundesbank gemeinsam angebotene Service wird um ca. 1200 ausländische Wertpapiere in Girosammelverwahrung (GS) erweitert. Dabei handelt es sich überwiegend um französische, spanische, österreichische und niederländische Anleihen von Staat und Banken, die der Selbstbesicherungsteilnehmer bei Käufen (CBF interne OTC-Geschäfte) zur Selbstbesicherung verwenden kann.

2. CASCADE-PC Version 7.9

CBF wird im Zuge der Vervollständigung der verfügbaren Funktionalität gegenüber dem CASCADE-Host in der neuen CASCADE-PC Version 7.9 folgende Funktionen zur Verfügung stellen:

- Anforderung von Bestandslisten als Einzelauftrag
- CASCADE-System-Information – Währungsparameter
- Optionsscheintrennung/-zusammenführung

2.1 Anforderung Persönliche Bestandslisten als Einzelauftrag

CBF-Kunden können künftig über CASCADE-PC Bestandslisten durch eine online Eingabe anfordern.

Die Anforderung wird über die folgenden CASCADE-PC Masken eingestellt:

The screenshot shows the CASCADE-PC application window with a menu grid. The 'Geld' category is expanded, and a red arrow points to the 'Einzelaufträge...' option. The interface includes a top navigation bar with 'clearstream DEUTSCHE BÖRSE GROUP' and various icons. The status bar at the bottom displays 'Version 7.9 Beta (Build 002)', '7907260001', 'A KYAB AE', and '23.09.13 11:22:08'.

OTC	OTC	Börse	Geld	Depot
Erfassung	Auftragsbestand	Börsengeschäfte	Information	Umsatz
Wertpapierübertrag...	Änderung/Löschung...	Information...	Cash Forecast...	Gebuchte Depotumsätze...
Match-Instruktion...	Settlement...	Änderung...	Kontoinformation/Umsatz...	Depotumsatzstatistiken...
TEFRA-D Freigabe...	Match-Dienst...	Settlement...	Geldaufträge/Daueraufträge...	Bestand
Bestandsübertrag...	Informationsdienst...	Löschung...	Kapitaldienste und sonst. Zahlungen...	Depotbuchbestand...
Depotübertrag...	Historische Information...	Rücknahme Löschung...	Erfassung	Bestand RS Wertpapier-Besitzer...
Umtausch...	Reservierungs-Dienst...	Statistiken	Cash Forecast Regel...	Bestandsabfrage
Rücktausch...	Selbstbesicherung...	Aufgaben...	Reservierungsauftrag...	Einzelaufträge...
Optionsscheintrennung...		Abstimmsummen...	Dauerauftrag Reservierung...	
Optionsscheinzusammenführung...		Kontrollsummen...	Geldkontenverknüpfung...	
Erfassungsbestand			Geldquellenpriorisierung...	
Bearbeitung...			Marktregel...	
Kontrolle...			Erfassungsbestand	
			Änderung/Löschung...	
			Information Geldkontrolle RTS	
			Zentralbankgeld (Euro)...	
			Commercial Bank Money...	
Vaults	RS	Custody	Nachrichten	Bank-Info
Erfassung (CBF Tresor)	Aktionärsdaten...	Information...	Message Journal...	Banksuche...
Neuzulassung/Valutierung...	Eintragung...			Nutzer-Information...
Auslieferung...	Umschreibung...			Dispo-/Buchungsinformation...
Information	Bestandsanforderung...			Systeminformationen...
Urkundenbestand...				Währungsparameter...
Auftragshistorie...				

CASCADE - PC

OTC OTC Auftragsbestand Börse Geld Depot Vaults (CBF Tresor) R5 Custody Nachrichten Bank-Info Einstellungen Benutzerberechtigungen Hilfe

clearstream DEUTSCHE BÖRSE GROUP

DEUTSCH ENGLISH

OTC	OTC	Börse	Geld	Depot
Erfassung	Auftragsbestand	Börsengeschäfte	Information	Umsatz
Wertpapierübertrag...	Änderung/Löschung...	Information...	Cash Forecast...	Gebuchte Depotumsätze...
Match-Instruktion...	Settlement...	Änderung...	Kontoinformation/Umsatz...	Depotumsatzstatistiken...
TEFRA-D Freigabe...	Match-Dienst...	Settlement...	Geldaufträge/Daueraufträge...	Bestand
Bestandsübertrag...	Informationsdienst...	Löschung...	Kapitaldienste und sonst. Zahlungen...	Depotbuchbestand...
Depotübertrag...	Historische Information...	Rücknahme Löschung...	Erfassung	Bestand R5 Wertpapier-Besitzer...
Umtausch...	Reservierungs-Dienst...	Statistiken	Cash Forecast Regel...	Bestandsabfrage
Rücktausch...	Selbstbesicherung...	Aufgaben...	Reservierungsauftrag...	Einzelaufträge...
Optionsscheintrennung...		Abstimmsummen...	Dauerauftrag Reservierung...	
Optionsscheinzusammenführung...		Kontrollsummen...	Geldkontenverknüpfung...	
Erfassungsbestand			Geldquellenpriorisierung...	
Bearbeitung...			Marktregel...	
Kontrolle...			Erfassungsbestand	
			Änderung/Löschung...	
			Information Geldkontrolle RTS	
			Zentralbankgeld (Euro)...	
			Commercial Bank Money...	
Vaults	R5	Custody	Nachrichten	Bank-Info
Erfassung (CBF Tresor)	Aktionärsdaten...	Information...	Message Journal...	Banksuche...
Neuzulassung/Valutierung...	Eintragung...			Nutzer-Information...
Auslieferung...	Umschreibung...			Dispo-/Buchungsinformation...
Information	Bestandsanforderung...			Systeminformationen...
Urkundenbestand...				Währungsparameter...
Auftragshistorie...				

Version 7.9 Beta (Build 002) 7907260001 A KVAB AE 23.09.13 11:22:08



CASCADE - PC Währungsparameter Information

Fenster Hilfe

Hinweis

Quelle für die aktuellen Fristen pro Währung für valutagerechte Geldanschaffungen und Auszahlungen:
www.clearstream.com

Währung	Währungsraum	Match-Toleranzanzeige bei Gegenwert
AUD	Australien	30,00
CAD	Kanada	35,00
CHF	Schweiz	25,00
CNY	China	200,00
CZK	Tschechien	900,00
DKK	Dänemark	175,00
EUR	EWU	25,00
GBP	Großbritannien	15,00
HKD	HongKong	280,00
HUF	Ungarn	6.600,00
JPY	Japan	3.500,00
MXN	Mexiko	200,00
NOK	Norwegen	180,00
NZD	Neuseeland	35,00
PLN	Polen	100,00
RUB	Russland	1.000,00
SEK	Schweden	200,00
SGD	Singapur	200,00

Weitere Daten

Abbruch

Version 7.9 Beta (Build 005) 7907260001 A KVAV IW 28.10.13 09:30:31

2.3 Wertpapierübertrag - Optionsscheintrennung/-zusammenführung

Mit der Einführung der CASCADE-PC Version 7.9 können Instruktionen zur Trennung und Zusammenführung von Optionsscheinen (mit festverzinslichen Wertpapieren) auch online über CASCADE-PC eingestellt und angezeigt werden:

The screenshot shows the CASCADE-PC software interface. The main menu is organized into several categories:

- OTC:** Erfassung, Wertpapierübertrag..., Match-Instruktion..., TEFRA-D Freigabe..., Bestandsübertrag..., Depotübertrag..., Umtausch..., Rücktausch..., **Optionsscheintrennung...**, **Optionsscheinzusammenführung...**, Erfassungsbestand, Bearbeitung..., Kontrolle...
- OTC (Auftragsbestand):** Änderung/Löschung..., Settlement..., Match-Dienst..., Informationsdienst..., Historische Information..., Reservierungs-Dienst..., Selbstbesicherung...
- Börse:** Börsengeschäfte, Information..., Änderung..., Settlement..., Löschung..., Rücknahme Löschung..., **Statistiken**, Aufgaben..., Abstimmsummen..., Kontrollsummen...
- Geld:** Information, Cash Forecast..., Kontoinformation/Umsatz..., Geldaufträge/Daueraufträge..., Kapitaldienste und sonst. Zahlungen..., **Erfassung**, Cash Forecast Regel..., Reservierungsauftrag..., Dauerauftrag Reservierung..., Geldkontenverknüpfung..., Geldquellenpriorisierung..., Marktregel..., **Erfassungsbestand**, Änderung/Löschung..., **Information Geldkontrolle RTS**, Zentralbankgeld (Euro)..., Commercial Bank Money...
- Depot:** Umsatz, Gebuchte Depotumsätze..., **Bestand**, Depotbuchbestand..., Bestand R5 Wertpapier-Besitzer..., **Bestandsabfrage**, Einzelaufträge...
- Vaults:** Erfassung (CBF Tresor), Neuzulassung/Valutierung..., Auslieferung..., **Information**, Urkundenbestand..., Auftragshistorie...
- R5:** Aktionärsdaten..., Eintragung..., Umschreibung..., Bestandsanforderung...
- Custody:** Information...
- Nachrichten:** Message Journal...
- Bank-Info:** Banksuche..., Nutzer-Information..., Dispo-/Buchungsinformation..., Systeminformationen..., Währungsparameter...

The status bar at the bottom indicates: Version 7.9 Beta (Build 002), 7907260001, A KVAB AE, 23.09.13 11:22:08.

2.3.1 Optionsscheintrennung

Die Einstellung eines Auftrags zur Optionsscheintrennung erfolgt über die folgende Maske.

WKN		Nominale/Stückel
DE000A1R0XK5	PRAKTIKER AG CALL18 PRA	1.000.000
DE000A1R0XJ7	12,795 % PRAKTIKER AG OPS.12/16 OO 29.M/N	100.000

Die Maske ist ähnlich wie ein normaler Wertpapierübertrag frei von Zahlung auszufüllen, wobei die ISIN der cum-Anleihe (Anleihe mit Optionsschein) einzustellen ist und das Konto der Gegenpartei nicht angegeben wird. Dieses Feld wird von CASCADE abhängig von der ISIN automatisch gefüllt. Die Aufträge zur Gutschrift der Optionsscheine und der Ex-Anleihe werden ebenfalls von CASCADE automatisch generiert.

In der untenstehenden Maske ist beispielhaft zu sehen, wie Optionsscheintrennungen in den üblichen Informationsmasken angezeigt werden.

CASCADE - PC Optionsscheintrennung Information

Fenster Hilfe

Auftragsnummer: Hinterlegungsart: Primernote:

Lastschrift-Konto:

Gutschrift-Konto:

Wertpapier:

Nominale: Stückart: Einheit:

Kundenreferenz: -

Settlement-Day:

Es werden zusätzlich Buchungen zu Gunsten: vorgenommen

WKN		Nominale/Stücke
DE000A1R0XK5	PRAKTIKER AG CALL18 PRA	1.000.000
DE000A1R0XJ7	12,795 % PRAKTIKER AG OPS.12/16 OO 29.M/N	100.000

Version 7.9 Beta (Build 002) 7999269701 A KVEI NR 25.09.13 08:53:20

Die Eingabe von Optionsscheintrennungen muss nach dem 4-Augen-Prinzip von einem zweiten User kontrolliert werden, damit der Auftrag gültig ist und ausgeführt werden kann (siehe unten).

CASCADE - PC Optionsscheintrennung Kontrolle

Fenster Hilfe

Auftragsnummer: 98765 Hinterlegungsart: 01 - Girosammelverwahrung Primanote:

Lastschrift-Konto: 7004 000 COMMERZBANK AG

Gutschrift-Konto: 7926 000 CBF W/OPT.TREN.U.BOND STRIPPING

Wertpapier:
 ISIN: DE000A1R0XH1
 PRAKTIKER AG OP5.12/16 MO 29.M/N

Nominale: 100.000 Stückart: Einheit: EO

Kundenreferenz: -

Settlement-Day: 26.09.2013

Es werden zusätzlich 2 Buchungen zu Gunsten: 7004 000 vorgenommen

WKN		Nominale/Stücke
DE000A1R0XK5	PRAKTIKER AG CALL18 PRA	1.000.000
DE000A1R0XJ7	12,795 % PRAKTIKER AG OP5.12/16 OO 29.M/N	100.000

Status: nicht kontrolliert

Kontrolle Nicht kontrolliert Fehlerhaft Abbruch

Version 7.9 Beta (Build 002) 7999269701 A KVEK VA 25.09.13 08:52:16

2.3.2 Optionsscheinzusammenführung

Der Auftrag zur Zusammenführung von Optionsscheinen mit der entsprechenden ex-Anleihe ist analog dem Auftrag zur Optionsscheintrennung einzugeben. Auch hier ist nur die ISIN der cum-Anleihe einzustellen, die Aufträge zur Belastung der entsprechenden Optionsscheine und der ex-Anleihe werden auch hier automatisch von CASCADE generiert.

Auch hier gilt das 4-Augen-Prinzip. In den folgenden Darstellungen werden Beispiele für die Eingabe-, Informations- und Kontrollmasken angezeigt.

CASCADE - PC Optionsscheinzusammenführung Erfassung

Fenster Hilfe

Auftragsnummer: Hinterlegungsart: Primarnote:

Lastschrift-Konto:

Gutschrift-Konto:

Wertpapier:

ISIN:

Nominale: Stückart: Einheit:

Kundenreferenz: -

Settlement-Day:

Es werden zusätzlich Buchungen zu Lasten: vorgenommen

WKN		Nominale/Stücke
DE000A1R0XK5	PRAKTIKER AG CALL18 PRA	1.000.000
DE000A1R0XJ7	12,795 % PRAKTIKER AG OP5.12/16 OO 29.M/N	100.000

Verarbeitung Abbruch

Version 7.9 Beta (Build 002) 7999269702 A KVEE OZ 25.09.13 10:21:41

CASCADE - PC Optionsscheinzusammenführung Information

Fenster Hilfe

Auftragsnummer: Hinterlegungsart: Primanote:

Lastschrift-Konto:

Gutschrift-Konto:

Wertpapier:

ISIN:

Nominale: Stückart: Einheit:

Kundenreferenz: -

Settlement-Day:

Es werden zusätzlich Buchungen zu Lasten: vorgenommen

WKN		Nominale/Stücke
DE000A1R0XK5	PRAKTIKER AG CALL18 PRA	1.000.000
DE000A1R0XJ7	12,795 % PRAKTIKER AG OPS.12/16 OO 29.M/N	100.000

Version 7.9 Beta (Build 002) 7999269702 A KVEI NR 25.09.13 10:23:19

CASCADE - PC Optionsscheinzusammenführung Kontrolle

Fenster Hilfe

Auftragsnummer: Hinterlegungsart: Primanote:

Lastschrift-Konto:

Gutschrift-Konto:

Wertpapier:

ISIN:

Nominale: Stückart: Einheit:

Kundenreferenz: -

Settlement-Day:

Es werden zusätzlich Buchungen zu Lasten: vorgenommen

WKN		Nominale/Stücke
DE000A1R0XK5	PRAKTIKER AG CALL18 PRA	1.000.000
DE000A1R0XJ7	12,795 % PRAKTIKER AG OPS.12/16 OO 29.M/N	100.000

Status:

Version 7.9 Beta (Build 002) 7999269702 A KVEK VA 25.09.13 10:46:06

3. Custody Services

3.1 MT564: Umsetzung von "Zwei Event Szenarien"

Die German Market Practice Group hat basierend auf den Harmonisierungsanforderungen der Corporate Action Joint Working Group (CAJWG) entschieden, zum 18. November 2013 das "Zwei Event Szenario" für Kapitalerhöhungen in Zusammenhang mit der Ausgabe von Bezugsrechten bzw. Interims-Gattungen im deutschen Markt einzuführen. Mit den nachfolgend beschriebenen Implementierungen erfüllt CBF diese Anforderungen, die zugleich auch einen Bestandteil der T2S Corporate Action Subgroup Standards darstellen.

Künftig initiiert CBF in den Terminarten TA210 und TA211 (Zuteilung von Stücken), die mit der Ausschüttung von Bezugsrechten oder Interims-Gattungen verbunden sind, parallel zwei MT564 Workflows bzw. Events ab 30 Bankarbeitstage vor dem Ex Tag bzw. Record Tag:

1. Der erste Event bzw. MT564 Workflow (22F::CAMV = MAND; Mandatory Event, keine Instruktion notwendig) bezieht sich auf die KADI Terminart TA210/TA211 und die ISIN der zugrundeliegenden Wertpapiergattung und kündigt die Gutschrift der Bezugsrechte bzw. die Interims-Gattung an.
2. Der zweite Event bzw. MT564 Workflow bezieht sich auf die KADI Terminart TA280 (freiwillige Kapitalmaßnahmen) (22F::CAMV = CHOS; Mandatory Event, Instruktion ist erforderlich) und die ISIN des Bezugsrechts bzw. der Interims-Gattung. Neben den Informationen über die Bezugsfrist und den Bezugspreis weist die Nachricht die möglichen Optionen für Kunden aus, wie die Rechte bzw. die Interims-Gattung verwertet werden können.

Weitere Details zu den Workflows beider Events und den Änderungen und Erweiterungen in den Nachrichtenformaten sind in der Veröffentlichung "CBF SWIFT & Connectivity Änderungen – November 2013" und in dem "CBF Connectivity Manual Part 3 Pre-issue November 2013" beschrieben.

3.2 Einführung des MT564 – „For Info Only“

Für die Terminart TA281 zur Information über Mandatory Events ohne Auswirkung auf Bestände und die Terminart 280 zur Information über Voluntary Events, werden ab 18. November 2013 MT564 Nachrichten zusätzlich für bestimmte Werte des WM Datenfeldes UD008A (Umtauschgrund) versendet.

Für OGAW-IV-Umsetzungsgesetz (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren, 4. Richtlinie) relevante Informationen von Fonds, die vorab angekündigt wurden, ohne dass ein Termin oder weitere Daten zur Durchführung der entsprechenden Non-Income-Maßnahme bekannt sind, werden MT564 mit dem Processing Status "INFO" für die Terminart 281 versendet.

Für weitere vorab angekündigte Informationen von Fonds zu Maßnahmen, die nicht OGAW IV relevant sind und für die keine Termine genannt werden, wird ebenfalls ein MT564, in der Regel mit dem Processing Status "PREU", "PREC" oder "COMP", erzeugt.

Die betroffenen Umtauschgründe aus dem WM Datenfeld UD008A sowie das Nachrichtenformat des MT564 "For Info Only" sind in der Veröffentlichung "CBF SWIFT & Connectivity Änderungen – November 2013" und in dem "CBF Connectivity Manual Part 3 Pre-issue November 2013" beschrieben.

3.3 MT566 Bestätigungen für manuelle Geldbuchungen

Für Geldbuchungen, die CBF auf Grund einer Kapitalmaßnahme (Income und Non-Income) manuell eingestellt hat, werden zukünftig nach erfolgreicher Geldregulierung über TARGET2 auch MT566 Bestätigungen versendet. Der Versand erfolgt zu den heutigen Zeitpunkten des MT566 Income und in einer zusätzlichen Übertragung um 15:45 Uhr nach der DD3-Geldverrechnung.

Soweit eine direkte Verbindung von der manuellen Geldbuchung zu einem Event nachvollzogen werden kann, enthält die MT566-Bestätigung die Corporate Action Reference ID sowie weitere Details zu dem entsprechenden Event. Das Nachrichtenformat der MT566-Bestätigung kann deshalb folgende Ausprägungen aufweisen:

- MT566 Manuelle Geldbuchung mit einer Verbindung zu einem Income Event
- MT566 Manuelle Geldbuchung mit einer Verbindung zu einem Non Income Event – mandatory oder voluntary
- MT566 Manuelle Geldbuchung ohne nachvollziehbare Verbindung (Default-MT566).

Eine separate Anforderung der MT566 Bestätigung für manuelle Geldbuchungen ist nicht erforderlich. Kunden, die heute schon den MT566 für Income und Non-Income bestellt haben, erhalten hierzu automatisch auch den MT566 für manuelle Geldbuchungen.

Die Nachrichtenformate zu obigen Ausprägungen sind in der Veröffentlichung "CBF SWIFT & Connectivity Änderungen – November 2013" und in dem "CBF Connectivity Manual Part 3 Pre-issue November 2013" beschrieben.

3.4 Anpassungen durch das SWIFT SR 2013 und der Market Practice Groups

Weitere Spezifikationen, die CBF im Rahmen der SWIFT MT564 und MT566 Nachrichten umsetzt, beziehen sich auf die Anforderungen der National Market Practice Groups (NMPGs) und der Securities Market Practice Group (SMPGs). Die Details hierzu sind ebenfalls in der Veröffentlichung "CBF SWIFT & Connectivity Änderungen – November 2013" und in dem "CBF Connectivity Manual Part 3 Pre-issue November 2013" beschrieben.

3.5 Abschaltung des Custody Payments File

Kunden, die den Custody Payments File beziehen, sollten ab 18. November 2013 auf das Reporting im SWIFT-Format MT564/566 umstellen. In diesem Zusammenhang werden Kunden gebeten, sich schnellstmöglich mit dem Customer Service Connectivity in Verbindung zu setzen. Das gilt auch für Kunden, die den Custody Payments File zurzeit noch beziehen, diesen aber nicht mehr benötigen. Ansonsten werden ab 2014 Gebühren fällig, auch dann wenn keine Income-Zahlungen oder Kompensationen für das betroffene Konto getätigt werden.

Für Kunden, die den Bezug des Custody Payment Files nicht ausdrücklich kündigen bzw. die diese technische Umstellung noch nicht vollziehen können, bietet CBF an, den Custody Payments File weiterhin zu versenden. Hierfür fallen jedoch ab Januar 2014 die folgenden zusätzlichen Gebühren an:

- ab 1. Januar 2014: 2.500€ pro Monat und Kontostamm
- ab 1. Juli 2014: 5.000€ pro Monat und Kontostamm
- ab 1. Januar 2015: 10.000€ pro Monat und Kontostamm

3.6 Anpassung der Periode für das Market Claiming auf 20 Tage

Im Zuge der europaweiten Harmonisierung wird CBF mit Einsatz des CBF Release am 18. November 2013 die Market Claim Periode dem international geforderten Standard anpassen. Die bisherige Market Claim Periode wird hierbei von 25 auf 20 Bankarbeitstage angepasst.

Für Maßnahmen mit Stichtag ab 18. November 2013 wird die neue Market Claim Periode von 20 Bankarbeitstagen wirksam. Dies gilt auch für nachträglich eingestellte Maßnahmen, die ab 18. November 2013 verarbeitet werden.

3.7 Anpassung Persönliches Journal (KD111)

Sollten CCP-Geschäfte für US-steuerrelevante Titel dem Market- oder Reverse Claim Prozess der CBF unterliegen, wird mit Einsatz des CBF Release am 18. November 2013 die Eurex Tax Payer ID des Handelsteilnehmers auf dem Persönlichen Journal (KD111) aufgeführt.

Aufgrund dieser Information wird dem Kunden die Zuordnung des US-Steuerstatus zum Handelsteilnehmer erleichtert.

3.7.1 Listenlayout (Deutsch)

CLEARSTREAM BANKING AG
MERGENTHALERALLEE 61
65760 ESCHBORN

TESTBANK

MUSTERSTRASSE 123

DE 99999 BEISPIELSTADT

ESCHBORN, 05.07.2013

TELEPHONE +49-69-211-11177

FAX +49-69-211-13701

PROGRAM-NAME: KD111

ACCOUNT : 7999

DIVIDENDEN

AUF ALLE NACHFOLGEND AUFGEFUEHRTEN CCP GROSS TRADES
WURDE DER FAELLIGE KUPON IM NAMEN DER EUREX CLEARING AG, EQUITY CCP
VERRECHNET, DA DIESE GESCHAEFTE NUR NOCH EX KUPON BELIEFERT WERDEN KOENNEN.

CBF-STICHTAG : 05.07.2013

EX-TAG : 02.07.2013

WKN : US9999999999 DIVIDENDEN : 1,00 USD
ST.PF.BETR : 0,00000000

BPL/GESCH-NR	SCHLUSSTAG	KONTRAHENT	NOMINALE	NETTO-BETRAG USD
096/1234567	18/04/2013	8501	1.000,000	700,00
ORDER-NR: CCPNET9037266		TXP: TEB30		
	STEUER	30 %	300,00	
SUMME PRO WKN			1.000,000	700,00 USD
	STEUER		300,00	
NETTOBETRAG KAUF				700,40 USD
NETTOBETRAG VERKAUF				0,00 USD

VERRECHNEN WIR AM 05.07.2013
GESETZLICH VORGESCHRIEBENE STEUERMELDUNGEN WERDEN VON DER
EUREX CLEARING AG, EQUITY CCP VERANLASST.

3.7.2 Listenlayout (Englisch)

CLEARSTREAM BANKING AG
MERGENTHALERALLEE 61
65760 ESCHBORN

TESTBANK

ANYSTREET 123

DE 99999 NEWCITY

ESCHBORN, 05/07/2013

TELEPHONE +49-69-211-11177

FAX +49-69-211-13701

PROGRAM-NAME: KD111

ACCOUNT : 7999

DIVIDENDS

FOR THE FOLLOWING CCP GROSS TRADES IN COLLECTIVE SAFE CUSTODY SECURITIES;
WE HAVE INITIATED ON BEHALF OF EUREX CLEARING AG, EQUITY CCP
PAYMENT BECAUSE THEY COULD ONLY BE SETTLED EX COUPON.

KEY-DATE : 05/07/2013

EX-DATE : 02/07/2013

SEC.: US9999999999 DIVIDEND : 1,00 USD
TAXABLE DIV.: 0,00000000

MPL/TRANS.NO.	TRADE DAY	COUNTERPART	NOMINAL	NET AMOUNT USD
096/1234567	18/04/2013	8501	1.000,000	700,00
ORDER-NO: CCPNET9037266		TXP: TEB30		
	TAX	30 %	300,00	
TOTAL PER SEC. CODE			1.000,000	700,00 USD
	TAX		300,00	
NET AMOUNT PURCHASES				700,00 USD
NET AMOUNT SALES				0,00 USD

COMPENSATION PAYMENT ON 05/07/2013
LEGAL TAX REPORTING IS INITIATED BY
EUREX CLEARING AG, EQUITY CCP .

3.8 Kundensimulation

Für Kunden, die MT564/566-Nachrichtern per MQ-Series oder SWIFT erhalten, besteht die Möglichkeit, diese Nachrichten ab 21. Oktober 2013 in einem begrenzten zeitlichen und inhaltlichen Rahmen zu simulieren. Bei Interesse wenden Sie sich bitte an den Customer Service Connectivity.

4. GSF Service

4.1 Xemac

4.1.1 Einsatz der neuen Xemac Version 5.5

Mit dem Release am 18. November 2013 setzt CBF die Xemac® Version 5.5 ein. Diese neue Version muss von allen teilnehmenden Instituten bis zu diesem Zeitpunkt installiert sein. Der Zugriff auf Xemac 5.4.1 sowie auf die Vorgängerversionen wird ab diesem Zeitpunkt nicht mehr möglich sein.

Die Software der Xemac Version 5.5 ist ab 1. November 2013 auf der Clearstream Website www.clearstream.com unter folgendem Pfad zum Download verfügbar:

Information Centre / Global Securities Financing / Collateral Management / Xemac / Xemac Technical Specifications

Das "Installation Manual" steht dort ebenfalls zum Download bereit.

Die neue Xemac Version 5.5 wird ausgerollt, um die technische Einführung der neuen Geschäftsprozesse im Bereich von Kapitalmaßnahmen vorzubereiten, welche im Februar 2014 (genauer Termin wird rechtzeitig bekannt gegeben) produktiv eingeführt werden.

4.1.2 Einführung neuer Xemac Bewertungsläufe im November 2013

Hierfür werden neue, abendliche Bewertungsläufe in Xemac für die Wertpapiere eingeführt, die zu Gunsten der Deutschen Bundesbank verpfändet sind:

- Zunächst erfolgt nach Xemac Ende eine Neubewertung aufgrund von neuen Preisen und Zulässigkeitskriterien.
- Danach erfolgt eine weitere Neubewertung, die zusätzlich anstehende Kapitalmaßnahmen berücksichtigt.

Beide Neubewertungen führen, wenn die Untersicherung nicht durch Nachallokation ausgeglichen werden kann, zu einer Zwangsherabsetzung des Forderungsbetrages, die der Deutschen Bundesbank übermittelt wird.

Im Rahmen der Ausweitung der Abwicklungszeiten für Euro GC Pooling (siehe 1.3) werden zukünftig in Xemac Eurex Betragsherabsetzungen sowie automatische Beschaffungen bis 17.25 Uhr möglich sein (heute: 17:15 Uhr).

4.1.3 Einführung neuer Cash-Prozesse im Februar 2014

Weist eine Forderung nach der zweiten Neubewertung w/ Kapitalmaßnahmen eine Untersicherung aus, wird eine Anfrage zur Freigabe der anstehenden Geldzahlungen an die Deutsche Bundesbank ausgelöst:

- Bestätigt die Deutsche Bundesbank die Anfrage, werden die Geldbeträge zum nächstmöglichen Zeitpunkt an den Kunden ausgekehrt.
- Erfolgt keine Freigabe durch die Deutsche Bundesbank, werden die auszuzahlenden Geldbeträge blockiert und am nächsten Morgen an die Deutsche Bundesbank überwiesen.

Im Rahmen der weiterhin stattfindenden Xemac-Neubewertung am Morgen führen auftretende Untersicherungen ab 18. November 2013 nicht mehr zu einer Zwangsherabsetzung der Forderung, sondern zu einer Herabsetzungsanfrage an die Deutsche Bundesbank, die regulär beantwortet wird. Sofern Herabsetzungen aus diesem Bewertungslauf durch die Deutsche Bundesbank abgelehnt werden, werden mit "0" bewertete Papiere des Teilnehmers seitens der CBF in Absprache mit der Deutschen Bundesbank auf Depots der Deutschen Bundesbank übertragen.

Das abendliche Xemac Reporting wird weiterhin auf Basis der Allokationsdaten zum Xemac Ende (17:45 Uhr) erstellt und gegen 19:30 Uhr an Kunden versandt, die den Xemac "Allokierte Sicherheiten" Report im Format MT569 beziehen.

4.1.4 Verbesserung des Xemac Clients: Ansichten

4.1.4.1 Umstellung Vertragsdefinitions-Typs "Dt. Bbk" auf "NCB" / "Clearstream"

Alle existierenden Vertragsdefinitionen mit Vertragsdefinitions-Typ "Dt. Bbk" werden wie folgt umgestellt:

Ist das zuständige Institut 7069, wird auf Vertragsdefinitions-Typ "NCB" umgestellt.

Ansonsten wird auf Vertragsdefinitions-Typ „Clearstream“ umgestellt.

4.1.4.2 Neue Spalte "Ablehnungsgrund" im "Status Nicht Kontrolliert" für Ansicht Forderungen

Eine neue Spalte "Ablehnungsgrund" wird in der Ansicht nach der Spalte "Verarbeitungs-Status" hinzugefügt. Diese wird nur dann gefüllt, wenn sich die Forderung sich im Status "Erfassung kontrolliert" befindet und die Anfrage zur Forderungs-Herabsetzung nicht durch den Sicherheiten-Nehmer akzeptiert wurde.

4.1.4.3 Zusätzliche Informationen in Ansicht Forderungs-Details

Im Bereich "Weitere Informationen" / "Forderungsdetails" wird das Feld "Auftragsreferenz" erweitert, um den Grund für die neue Forderungsversion ("Zwangsherabsetzung der Forderung w/ Zulässigkeit und Preise" oder "Zwangsherabsetzung der Forderung w/ Kapitalmaßnahmen") auszuweisen:

Die Feld-Bezeichnung verändert sich wie folgt:

Von	Auf
Auftragsreferenz	Auftragsreferenz / Event

In Abhängigkeit des Grundes der Zwangsherabsetzung wird das Feld wie folgt gefüllt:

Grund der Zwangsherabsetzung	Auftragsreferenz / Event
Zulässigkeit oder Preise	Neubewertung
Kapitalmaßnahmen	Kapitalmaßnahmen

Forderungsänderungen aus anderen Gründen bleiben unverändert.

Beispiel für die Ansicht:

Eigene Forderungs Nr		Forderungs Nr System	2006000001	Version	8182
Eigene Vertrags Nr	5000013005	Vertrags Nr System	2006000001	Version	4
Xemac-Partner		Forderungsdetails		Bearbeitungsinfo	
Vertragsdaten					
Eigene Vertrags Nr	5000013005	Vertrags Nr System	2006000001	Version Vertrag	4
Vertragsbezeichnung		BANK A B C D			
Forderungsdaten					
Eigene Forderungs Nr		Betrag	3.754.856.817,95	Währung	EUR
Besichern ab	01.10.2013	Besichern bis			
Kommentar		DE00013			
Steuerung			Weitere Informationen		
<input checked="" type="checkbox"/> GCP Reuse			Auftragsreferenz / Event		
<input type="checkbox"/> Automatische Anfrage Forderungsherabsetzung			Kapitalmaßnahmen		
Besicherungszeitpunkt 02.10.2013 07:41:05					
Sicherheitenwert		3.755.015.818,81	EUR	Deckungsgrad	100,00 %
					Schließen

4.2 Wertpapierleihe

Die Wertpapierleihe der CBF wird dahin gehend erweitert, dass Leihegeschäfte auch in Fremdwährung zugelassen sind und umfänglich abgebildet werden können. Dies beinhaltet sowohl Aktien wie auch festverzinsliche Wertpapiere, bei denen grundsätzlich immer auf deren Depotwährung referenziert wird.

Instruktionen können folgendermaßen erteilt werden:

- Aktien in einer der zugelassenen Währungen
- Festverzinsliche Wertpapiere immer in der Depotwährung sofern diese zugelassen ist (hierbei können Geschäfte in KAGplus grundsätzlich weiterhin mit der Depotwährung EUR instruiert werden, da das System automatisch die gültige Depotwährung des Wertpapiers verwendet)

Bei der Ermittlung des Leihewerts wird bei Preisangaben in Fremdwährung ein Wechselkursaufschlag angewendet. Zugelassene Währungen sind neben EUR: AUD, CAD, CHF, DKK, GBP, JPY, KRW, NOK, SEK sowie USD.

Eine detaillierte Darstellung der Änderungen und Erweiterungen im Leihe-Reporting sowie eine Übersicht der Wechselkursaufschläge wurden separat an die Teilnehmer der Wertpapierleihe der CBF versandt, um eine zeitnahe Anpassung der automatisierten Weiterverarbeitung der CSV-Reporte zu ermöglichen.

5. Vaults Services

Für die geplante Konsolidierung verschiedener Tresorkonten auf möglichst wenige CBF interne Nostro-Konten, müssen die bei CBF hinterlegten Urkunden zur späteren Selektion mit einem stückespezifischen Kennzeichen versehen werden. Dazu wird die Tabelle „stückespezifische Besonderheiten“ um bestimmte Kennzeichen erweitert und das Feld „Besonderheiten“ wird unter der CASCADE Transaktion KVEW NV vorbelegt.

Des Weiteren wird in den Erfassungsmasken KVEW, in den Änderungsmasken KVEB, KVAA, in der Kontrollfunktion KVEC sowie in den Informationsdialogen KVEI, KVAI und KPHI das Feld „Serien-WKN“ nicht mehr angezeigt.

5.1 Erweiterung der Tabelle „stückespezifische Besonderheiten“

Die Tabelle wurde um die „grau hinterlegten“ Kennzeichen erweitert

Tabelle Stückespezifische Besonderheiten (Tabelle CKC9T03)

KZ	Erläuterung
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
10	TECHN.GLOBALURK. BISZU
11	ALTE URKUNDEN
12	DAUERGLOBALURKUNDE
13	RAHMENURKUNDE BISZU
14	M + B GETRENNT
15	NUR MANTEL
16	UNIKAT
17	UNITS
18	CF- UND K-STUKKEN
19	CF-STUKKEN

KZ	Erläuterung
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)
34	ZESSION,ABTRETUNG(EN)
35	ZESSION
36	ABTRETUNG(EN)
37	MIT GEWINNANTEILSSCHEIN
38	MÖGLICHER BEZUG VON URKUNDEN
39	KEIN ZINSEN- /DIVIDENTENDIENST
40	KEIN ZINSSCHEIN / TALON
41	NUR TALON
42	GLOBALBOND
43	IGL
44	IGL BIS ZU
45	JUNGSCHHEIN
46	JUNGSCHHEIN BIS ZU
50	NICHT VALUTIERT
97	UMDEUTUNG GU/RU

KZ	Erläuterung
98	UMDEUTUNG WG. 670

5.2 Vorbelegung der Besonderheiten in CASCADE Auftragsart 16

- Bei der Auftragserteilung von Neuzulassungen über die CASCADE Transaktion KVEW NV wird das Feld „Besonderheit“ unter den unten aufgeführten Bedingungen vorbelegt.
Das Feld ist von CBF-Kunden nicht erfassbar und nicht änderbar. Erfolgt die Auftragserteilung für Neuzulassungen/Valutierungen via LIMA (MT540), dürfen keine stückespezifische Besonderheiten im Auftrag ausgewiesen werden. Ist das Feld gefüllt, wird der Auftrag abgelehnt.
- Bei Valutierungen (Einlieferungsart 5) ist das Feld nicht eingebbar und wird auch nicht vorbelegt.
- Globalbonds (KV-Lagerland = 998) werden mit der Besonderheit 42 “Globalbonds” vorbelegt.
- RS-Gattungen werden je Verwahrmöglichkeit wie folgt mit der Besonderheit vorbelegt:
 - VWM 14 Vorbelegung mit Besonderheit 13 “Rahmenurkunde bis zu”
 - VWM 15 Vorbelegung mit Besonderheit 44 “IGL bis zu”
 - VWM 16 Vorbelegung mit Besonderheit 10 “technische Globalurkunde bis zu”
- TEFRA D Anleihen werden mit der Besonderheit 13 “Rahmenurkunde bis zu” vorbelegt.
- Für Lieferungen in der Einlieferungsart 2 gilt folgende Regeln:
 - VWM 1, 2 Vorbelegung mit Besonderheit 45 “Jungschein”
 - VWM 5 Vorbelegung mit Besonderheit 43 “IGL”
 - VWM 9, 16 Es erfolgt keine systemseitige Vorbelegung.
Das Feld Besonderheiten wird durch die CBF Prüfstelle ergänzt.
 - sonstige VWM Vorbelegung mit Besonderheit 12 “Dauerglobalurkunde”
- Lieferungen in der Einlieferungsart 3 und 4 unterliegen folgenden Regeln:
 - VWM 9, 16 Vorbelegung mit Besonderheit 10 “technische Globalurkunde bis zu”
 - VWM 1,2 Vorbelegung mit Besonderheit 46 “Jungschein bis zu”
 - VWM 5, 15 Vorbelegung mit Besonderheit 44 “IGL bis zu”
 - sonstige VWM Vorbelegung mit Besonderheit 13 “Rahmenurkunde bis zu”

5.3 Maskenänderungen wegen Ausbau des Feldes "Serien WKN"

Betroffen sind alle Masken des Wertebereiches unter der Transaktion KVEW auf den jeweiligen Seiten der Stücknummern Erfassung und die entsprechenden Informationsdialoge im CASCADE Erfassungs- und Auftragsbestand, sowie die entsprechenden Masken in CASCADE-PC.

Beispiel CASCADE Online KVEW:TRAN: KVEW FC: EL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG		EINLIEFERUNG / STUECKEERFASSUNG		ERFASSUNGSSTATUS	
		LFD.EINLIEFERUNG			
AUFTNR	: 650111	GES-NOM	:	100	
WKN	: I DE0005483036	ANZ-URK:		SUMME-NOM:	
STCKL	: _____			SCHRITTWEITE:	_____
SERIEN-WKN: I					
KZ	STUECKENUMMERN			MAN	MAN E
				GEL	GEL

-- ID-KZ: 9999999999 -- PW: ----- B999958S -- 26/09/13 -- 10:22:11 --					
EA0005I Verarbeitung der vorherigen Seite durchgeführt					
PF4:Abbruch					

- Das Feld "Serien WKN" wird nicht mehr angezeigt.

Beispiel KVAI:

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 16##7960#I###26.09.2013#

AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / STUECKINFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
                        NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG - SAMMELURKUNDE
AUFTRNR      :      900004      GES-NOM      :      2.500
WKN          : I DE0005137004      SUMME-NOM:      2.500
                        SCHRITTWEITE:

SERIEN-WKN:
KZ  ANZAHL LIT      STUECKELUNG STUECKENUMMERN (VERBRIEFTE URKUNDEN)  E/O

                2500                1      146267789-70288, .<

-- ID-KZ: 9999999999 -- PW:          ----- B999958S -- 26/09/13 -- 12:48:25 --
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

- Das Feld "Serien WKN" wird nicht mehr angezeigt.

Beispiel CASCADE-PC Information Auftragsbestand :

The screenshot shows the 'CASCADE - PC Einlieferung Neuzulassung Valutierung Information' window. It contains several input fields and a table. The fields are: 'Auftragsnummer:' with value '902026', 'Gesamtnominale:' with value '45', 'Wertpapier:' with 'ISIN' dropdown and 'CH0214965946' text, 'Summennominale:' with value '0', 'Serien-Wertpapier:' with an empty dropdown, and 'Schrittweite:' with an empty text field. Below these is a table with columns: 'Anzahl/Literal', 'Stückelung', 'Stücknummern (Verbriefte Urkunden)', and 'Ersatzkunde'. The table is currently empty. At the bottom of the window are buttons for 'Seite zurückblättern', 'Seite vorblättern', and 'Abbruch'. The status bar at the very bottom shows 'Version 7.8a 09.09.2013', '7907000010', 'B KVAI AA', and '26.09.13 12:57:33'.

- Das Feld "Serien WKN" wird nicht mehr angezeigt.

Beispiel KPHI:

```
TRAN: KPHI FC: HE SB: ##I#####26.08.2013#26.09.2013##

CARAD                      EINLIEFERUNG / STUECKINFORMATION          WERTEBEREICH
                          LFD. EINLIEFERUNG
AUFTNR   :      262257          GES-NOM   :              34
WKN      : I DE0005483036    ANZ-URK:      3    SUMME-NOM:      34
STCKL    :              10          SCHRITTWEITE:
SERIEN-WKN:
KZ STUECKENUMMERN                      MAN MAN E
                                          GEL GEL

      8003-5, .<

-- ID-KZ: 9999999999 -- PW:          ----- B999958S -- 26/09/13 -- 13:03:16 --
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

- Das Feld "Serien WKN" wird nicht mehr angezeigt.

Beispiel CASCADE-PC Auftragshistorie

The screenshot shows a software window titled "CASCADE - PC Auftragshistorie Einlieferung Information". The window contains several input fields and a table:

- Seite: 1
- Auftragsnummer: 262257
- Hinterlegungsart: 01 - Girosammelverwahrung
- Wertpapier: ISIN (dropdown) DE0005483036
- Gesamtnominale: 34
- Anzahl Urkunden: 3
- Summennominale: 34
- Stückelung: 10
- Schrittweite: (empty)
- Serien-Wertpapier: (empty)

Stücknummern	Mangel	Mangel	Ersatzstück
8003-5, , <			

Navigation buttons: Vorherige Stücknummern, Abbruch, Nächste Stücknummern.

Footer: Version 7.8a 09.09.2013 7907000010 B KPHI HE 26.09.13 13:18:37

- Das Feld "Serien WKN" wird nicht mehr angezeigt.

6. Vorbereitende Maßnahmen für TARGET2-Securities (T2S)

Als eine erste vorbereitende Maßnahme für die Implementierung von TARGET2-Securities werden die CASCADE Auswahlmasken KVAV/IA „Bank-Information Alpha-Suche“ und KVAV/IB „Bank-Information über Direkteinstieg“ angepasst.

Wie bereits heute ermöglicht die Abfrage einen Zugang zu Kontrahenteninformationen von Clearing Instituten, ICSDs und unterschiedlichen CSDs. Diese werden heute unter dem Sammelbegriff „Internationale Clearingpartner“ (ICP) zusammengefasst. Da die Abkürzung ICP im T2S Kontext bereits für Indirectly Connected Participant belegt ist, wird der Sammelbegriff in CBF auf „Internationale Märkte“ geändert. Im Zuge dessen werden auch die Lang- und Kurznamen der einzelnen Märkte gekürzt.

Zusätzlich werden solche Märkte aus der Liste entfernt, zu denen CBF keinen aktiven Settlement Link unterhält. Es ist zu berücksichtigen, dass sich die Abfrage mit dem Start von T2S auf CBF und sogenannte T2S Out-CSDs (CSDs, die nicht oder noch nicht an T2S teilnehmen, aber auf T2S als Kontrahent unter CBF aufgesetzt sind) beschränken wird.

Nach dem T2S Migrationsplan werden teilnehmende CSDs in vier Wellen nach T2S migrieren. Die Informationen über einen Markt werden so lange in CBF verfügbar sein, bis dieser CSD ein sogenannter T2S In-CSD (ein CSD, der auf T2S migriert ist) wird. Gleichzeitig mit der Migration nach T2S werden die Informationen über diesen CSD unter der Auswahlmaske KVAV/IA nicht mehr zur Verfügung stehen.

6.1 Bank-Information Alpha-Suche

Die bestehende Auswahlmaske KVAV/IA „Bank-Information Alpha-Suche“ wird mit dem CBF Release vom 18. November 2013 auf internationale Märkte mit einem aktiven Settlement Link zu CBF reduziert. Die Transaktionscodes für die Alpha-Suche (TRAN: KVAV, FC: IA) und für die direkte Suche (TRAN: KVAV, FC: IB) bleiben beibehalten.

Beispiel für die Auswahlmaske KVAV/IA

Derzeitige Auswahlmasken:

```
TRAN: KVAV FC: IA SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          BANK-INFORMATION          VEROEFFENTLICHUNGEN
                             ALPHA-SUCHE

INTERNATIONALE CLEARINGPARTNER
01 CP DEUTSCHLAND CBF    CLEARSTREAM BANKING, FRANKFURT
02 CP OESTERR. OEKB     OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG, WIEN
03 CP ESES FR CSD       EUROCLEAR FRANCE - ESES PLATFORM CSD
06 CBL                  CLEARSTREAM BANKING, LUXEMBOURG
07 EUROCLEAR           EUROCLEAR CLEARANCE SYSTEM SOCIETE COOPERATIVE
08 CP JAPAN JSCC       JAPAN SECURITIES CLEARING CORPORATION, TOKIO
10 CP ITALIEN MT.TIT.   MONTE TITOLI S.P.A., MAILAND
11 CP USA DTC          THE DEPOSITORY TRUST COMPANY, NEW YORK
16 CP FINNLAND         CLEARING PARTNER FINNLAND
17 CP ENGLAND CREST    CLEARING PARTNER ENGLAND CREST
18 CP ENGLAND CGO      CLEARING PARTNER ENGLAND CGO
19 CP SCHWEDEN         CLEARING PARTNER SCHWEDEN
20 CP DAENEMARK VP     VP SECURITIES A/S, COPENHAGEN

ICP: __ (A=AUSLAND)     ALPHA VON: _____     BIS: _____
-- ID-KZ: 9999999999 -- PW: ----- B999958S -- 30/09/13 -- 17:12:31 --
KV0014I Bitte Daten eingeben
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF8:Vor
```


Beispiel CASCADE-PC Auswahlmaske

CASCADE - PC Auswahl Bank-Information
Fenster Hilfe

Kontoverbindung internationaler Clearing-Häuser

- Teilnehmer Clearstream Banking, Frankfurt
- Teilnehmer aller Clearing-Häuser (inkl. Clearstream Banking, Frankfurt)
- Teilnehmer aller ausländischen Clearing-Häuser
- Teilnehmer eines bestimmten Clearing-Hauses

01 Clearstream Banking Frankfurt, Deutschland

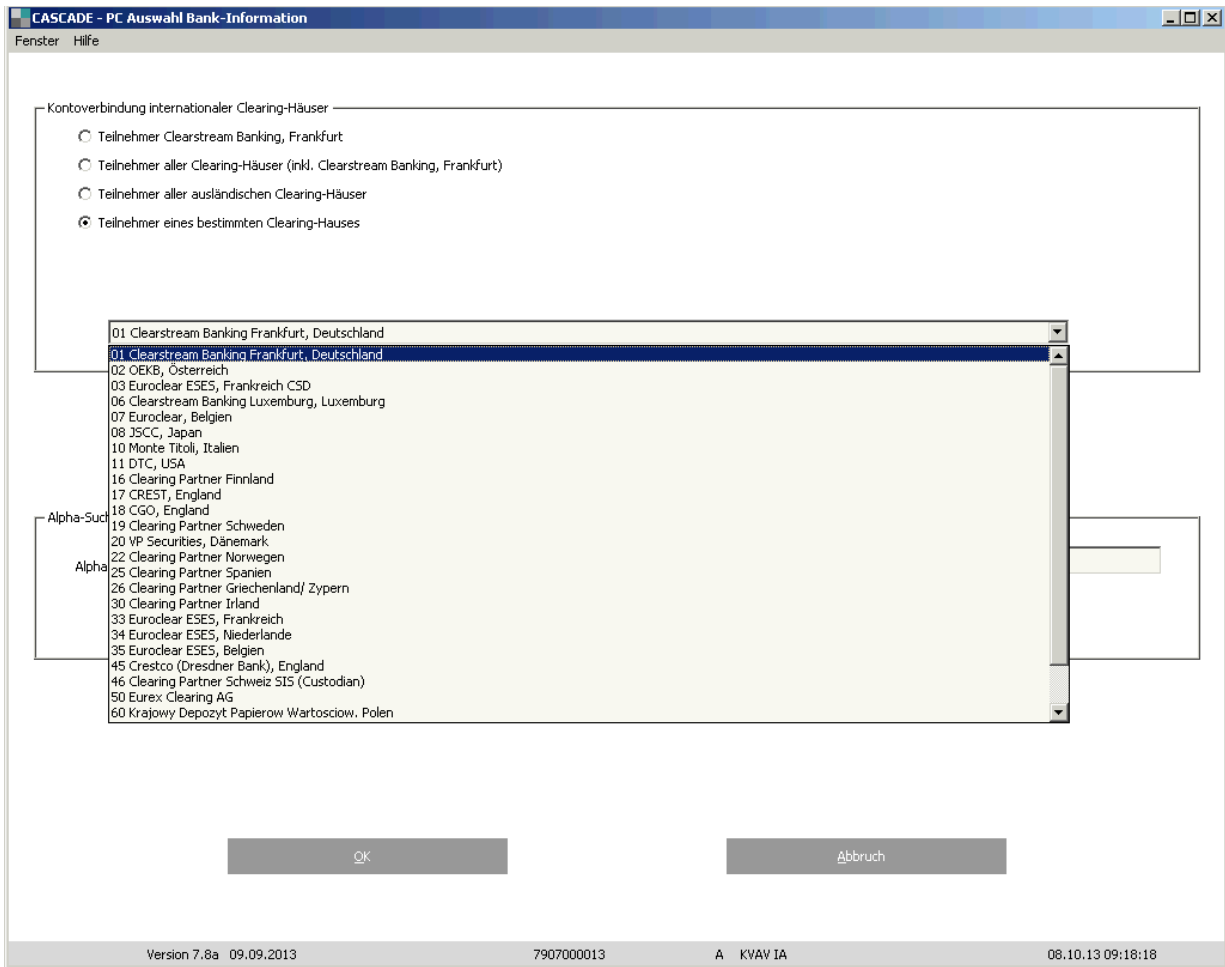
Alpha-Suche Numerische-Suche

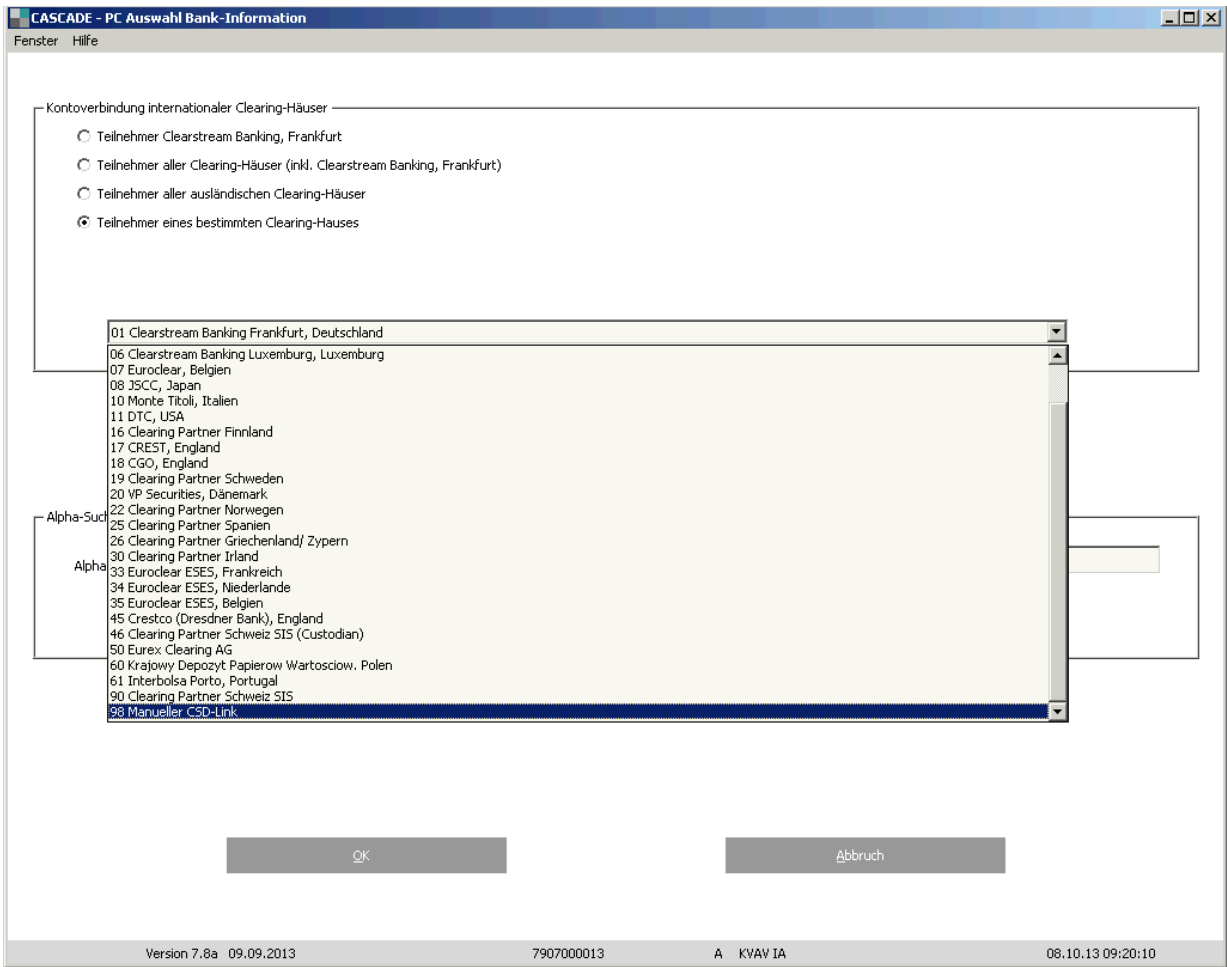
Alpha-Suche

Alpha von: Alpha bis:

OK Abbruch

Version 7.8a 09.09.2013 7907000013 A KVAV IA 08.10.13 09:17:06





Zukünftige Auswahlmasken:

```
TRAN: KQAV FC: IA SB: ###

AUFTRAGSABWICKLUNG          BANK-INFORMATION          VEROEFFENTLICHUNGEN
                              ALPHA-SUCHE

INTERNATIONALE MAERKTE
01 CBF          GERMANY CBF
02 OEKB         AUSTRIA OEKB
03 EFR          ESES FR
06 CBL          CLEARSTREAM CBL
07 EOC          EUROCLEAR
10 MONTE TITOLI ITALY MT.TITOLI
11 DTCC         USA DTCC
16 EFI          FINLAND EFI
20 VP           DENMARK VP
25 IBERCLEAR   SPAIN IBERCLEAR
26 HELEX       GREECE HELEX
33 ESES FR     ESES FR
34 ESES NL     ESES NL

MARKT: __ (A=AUSLAND)  ALPHA VON: _____  BIS: _____
-- ID-KZ: 9999999999 -- PW:  ----- B79073XP -- 31/12/99 -- 00:00:00 --
KV0014I Bitte Daten eingeben
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

```
TRAN: KQAV FC: IA SB: ###

AUFTRAGSABWICKLUNG          BANK-INFORMATION          VEROEFFENTLICHUNGEN
                              ALPHA-SUCHE

INTERNATIONALE MAERKTE
35 ESES BE     ESES BE
46 SIS CUSTODIAN SWISS SIS CUSTODIAN
90 SIS         SWISS SIS

MARKT: __ (A=AUSLAND)  ALPHA VON: _____  BIS: _____
-- ID-KZ: 9999999999 -- PW:  ----- B79073XP -- 31/12/99 -- 00:00:00 --
KV0014I Bitte Daten eingeben
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

Zukünftige CASCADE-PC Auswahlmasken:

CASCADE - PC Auswahl Bank-Information

Fenster Hilfe

Kontoverbindung internationaler Clearing-Häuser

- Teilnehmer Clearstream Banking, Frankfurt
- Teilnehmer aller Märkte (inkl. Clearstream Banking, Frankfurt)
- Teilnehmer aller internationalen Märkte
- Teilnehmer eines bestimmten Marktes

01 Clearstream Banking Frankfurt, Deutschland

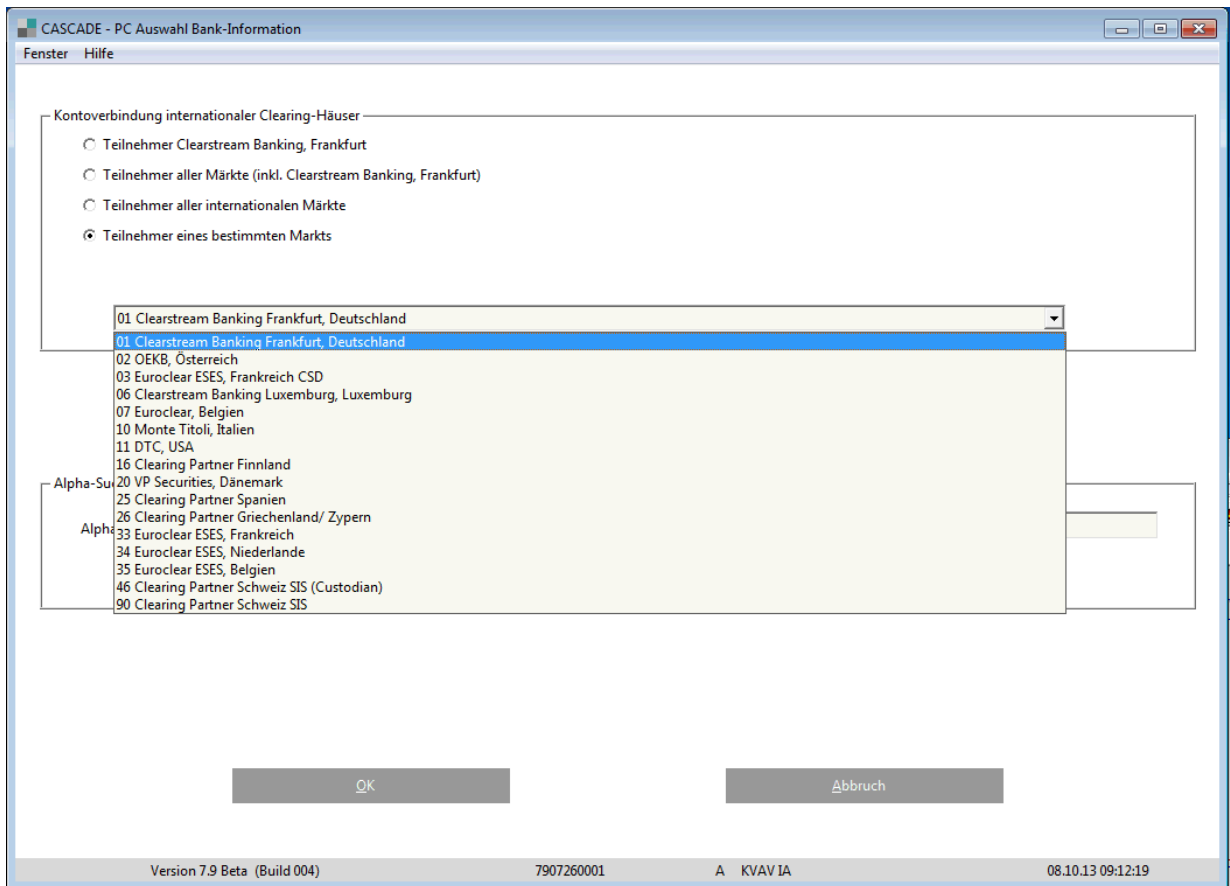
Alpha-Suche Numerische-Suche

Alpha-Suche

Alpha von: Alpha bis:

OK Abbruch

Version 7.9 Beta (Build 004) 7907260001 A KVAV IA 08.10.13 09:12:19



Beispiel für die Anzeige des Ergebnisses der Abfrage KVAV/IA

Derzeitige Auswahlmaske:

```

TRAN: KVAV FC: IA SB: 06#A##

AUFTRAGSABWICKLUNG          BANK-INFORMATION          VEROEFFENTLICHUNGEN
                        ALPHA-SUCHE
ICP: 06      SUCHBEGRIFF VON : A          BIS :          SEITE: 1

KZ BANKNAME /              ORT /
ICP TEILNEHMER-NR          INTERNATIONALER CLEARINGPARTNER
AAGC/FUNDSETTLE            AMSTERDAM
06 24936                   CBL
AAGCS RE FULLY TAX         AMSTERDAM
06 15718                   CBL
_ AAREAL BANK AG           WIESBADEN
06 67065                   CBL
_ AAREAL BANK AG - DUBLIN BRANCH    DUBLIN
06 67146                   CBL
AAREAL BANK AG-TRUSTEE     WIESBADEN
06 69131                   CBL
_ AAREAL BANK AG/DUBLIN BRANCH    WIESBADEN
06 47389                   CBL

-- ID-KZ: 9999999999 -- PW:          ----- B999958S -- 30/09/13 -- 17:17:02 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor

```

Derzeitige CASCADE-PC Auswahlmaske:

CASCADE - PC Bank-Information Clearing-Teilnehmer

Fenster Vollanzeige Hilfe

Auswahl:

Alpha von: Alpha bis:

Bankname	Ort	Teilnehmer	Börsenplatz	Clearing-Partner
AAGC/FUNDSSETTLE	AMSTERDAM	24936		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AAGCS RE FULLY TAX	AMSTERDAM	15718		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AAREAL BANK AG	WIESBADEN	67065		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AAREAL BANK AG - DUBLIN BRANCH	DUBLIN	67146		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AAREAL BANK AG-TRUSTEE	WIESBADEN	69131		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AAREAL BANK AG/DUBLIN BRANCH	WIESBADEN	47389		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AARGAUISCHE KANTONALBANK	AARAU	92304		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AB SEB VILNIAUS BANKAS	VILNIUS	22021		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABBEY NAT. TREASURY SVCS-TRADING	LONDON	80736		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABBEY NTL TREASURY SERV	LONDON	90281		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABC INTERNATIONAL BANK PLC	FRANKFURT AM MAIN	67055		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABC INTERNATIONAL BANK PLC	LONDON	73686		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABC ROMA BANKING LTD	NASSAU	99431		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABC-DUBAI BRANCH	BEIJING	19014		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABCI SEC CO LTD CLIENTS	HONG KONG	18330		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABCI SEC CO LTD HOUSE	HONG KONG	18331		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABERDEEN UNIT TRUST MANAGERS LTD	LONDON	10449		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABN AMRO (GUERNSEY) LTD-CLIENT	ST PETER PORT	85069		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg

Weitere Clearing-Teilnehmer

Version 7.8a 09.09.2013 7907000013 A KVAV IA 08.10.13 12:43:29

Zukünftige Auswahlmaske:

```

TRAN: KVAV FC: IA SB: 06#A#A#

AUFTRAGSABWICKLUNG          BANK-INFORMATION          VEROEFFENTLICHUNGEN
                              ALPHA-SUCHE

MARKT: 06  SUCHBEGRIFF VON : A          BIS : A          SEITE: 1

KZ BANKNAME /                ORT /
MARKT TEILNEHMER-NR          INTERNATIONALER MARKT
_ A.G. EDWARDS & SONS INC.    NEW YORK
  06  92536                   CBL
AAGC/FUNDSETTLE             AMSTERDAM
  06  24936                   CBL
_ AAREAL BANK AG            WIESBADEN
  06  67065                   CBL
_ AAREAL BANK AG - DUBLIN BRANCH  DUBLIN
  06  67146                   CBL
AAREAL BANK AG-TRUSTEE      WIESBADEN
  06  69131                   CBL
AAREAL BANK AG/DUBLIN BRANCH  WIESBADEN
  06  47389                   CBL

-- ID-KZ: 9999999999 -- PW:          ----- B79073XP -- 31/12/99 -- 00:00:00 --

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor
    
```

Zukünftige CASCADE-PC Auswahlmaske:

Auswahl:

Alpha von: Alpha bis:

Bankname	Ort	Teilnehmer	Börsenplatz	Markt
AAGC/FUNDSETTLE	AMSTERDAM	24936		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AAGCS RE FULLY TAX	AMSTERDAM	15718		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AAREAL BANK AG	WIESBADEN	67065		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AAREAL BANK AG - DUBLIN BRANCH	DUBLIN	67146		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AAREAL BANK AG-TRUSTEE	WIESBADEN	69131		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AAREAL BANK AG/DUBLIN BRANCH	WIESBADEN	47389		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AARGAUISCHE KANTONALBANK	AARAU	92304		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
AB SEB VILNIAUS BANKAS	VILNIUS	22021		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABBEY NAT. TREASURY SVCES-TRADING	LONDON	80736		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABBEY NTL TREASURY SERV	LONDON	90281		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABC INTERNATIONAL BANK PLC	FRANKFURT AM MAIN	67055		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABC INTERNATIONAL BANK PLC	LONDON	73686		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABC ROMA BANKING LTD	NASSAU	99431		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABC-DUBAI BRANCH	BEIJING	19014		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABCI SEC CO LTD CLIENTS	HONG KONG	18330		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABCI SEC CO LTD HOUSE	HONG KONG	18331		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABERDEEN UNIT TRUST MANAGERS LTD	LONDON	10449		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg
ABN AMRO (GUERNSEY) LTD-CLIENT	ST PETER PORT	85069		06 Clearstream Banking Luxemburg, Luxemburg

Weitere Märkte

Information... Abbruch

Version 7.9 Beta (Build 004) 7907260001 A KVAV IA 08.10.13 09:14:44

6.2 KUSTA-Datenträger und KUSTA Internetdatei

Der Satzaufbau des KUSTA-Datenträgers und der KUSTA Internetdatei (im Excel-Format XLSX) ändert sich nicht.

Um den technischen Umstellungsaufwand möglichst gering zu halten, enthalten die Dateien auch weiterhin die Teilnehmerdaten für folgende Märkte:

02	AUSTRIA OEKB
03	ESES FR
06	CLEARSTREAM CBL
07	EUROCLEAR
08	JAPAN
10	ITALY MT.TITOLI
11	USA DTCC
16	FINLAND EFI
20	DENMARK VP
22	NORWAY
25	SPAIN IBERCLEAR
26	GREECE HELEX
33	ESES FR
34	ESES NL
35	ESES BE
45	CREST
46	SWISS SIS CUSTODIAN
50	ECAG
90	SWISS SIS

In späteren Releases wird CBF in den Dateien auch diejenigen Teilnehmerdaten löschen, zu denen CBF keinen aktiven Link unterhält, und diese somit inhaltlich an die CASCADE Auswahlmasken (KVAV) anpassen. Nach der CBF Migration auf T2S werden zusätzlich die Teilnehmerdaten aller T2S In-CSDs gelöscht, da die Kontrahenten bei Cross-Border Geschäften in T2S nicht mehr über proprietäre Teilnehmernummern angesprochen werden.

In der KUSTA Internetdatei ändert sich die Überschriftenzeile:

Derzeitige Überschriftenzeile:

ICP-Nr.	Teilnehmernr.	Name	Ort	KTS
---------	---------------	------	-----	-----

Zukünftige Überschriftenzeile:

Markt-Nr.	Teilnehmernr.	Name	Ort	KTS
-----------	---------------	------	-----	-----

Leerseite

Kontakt

www.clearstream.com

Veröffentlicht von

Clearstream Banking Frankfurt

Eingetragene Adresse

Clearstream Banking AG

Mergenthalerallee 61

65760 Eschborn

Deutschland

Postanschrift

Clearstream Banking AG

60485 Frankfurt /Main

Deutschland
