

# CBF Release

## Informationen zum Release

17. November 2014

**CBF Release**  
**Informationen zum Release**  
**17. November 2014**

Oktober 2014  
Dokumentnummer: F-CMG35

Dieses Dokument ist Eigentum von Clearstream Banking AG, Frankfurt („Clearstream Banking“ oder „CBF“) 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 (2014). Alle Rechte vorbehalten.

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

## Vorwort

In Ergänzung zu der Publikation „[CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen](#)“ vom Mai 2014 (Update im Juni) stellt Ihnen die vorliegende Information umfassend und detailliert die Neuerungen vor, die am Montag, 17. November 2014 in folgenden Bereichen eingeführt werden:

- Börsengeschäftsabwicklung
- Cash Reporting
- Asset Services
- Xemac®
- TEFRA D
- CBF SWIFT Release
- TARGET2-Securities
- Kundensimulation CBF Release
- Selbstbesicherung
- Vaults Services

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 Client Services.

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 Client Services, der Treasury Dealing Room und das Back Office. Die betreffenden Telefonleitungen unterliegen einer stetigen Wartung, um einen einwandfreien Betrieb sicherzustellen.

Leerseite

## Inhalt

1.	Börsengeschäftsabwicklung .....	7
2.	Cash Reporting .....	8
3.	Asset Services .....	9
4.	Xemac® .....	10
4.1	Einsatz der neuen Xemac® Version 5.6 .....	10
4.2	Automatisierung der Kundenschnittstelle .....	10
4.3	Anforderung zur Anpassung des Forderungsbetrags .....	11
4.4	Exposure Management .....	18
4.5	Collateral Management .....	36
4.6	Verschiedene Änderungen im Bereich Forderungen .....	45
5.	TEFRA D Freigaben per SWIFT, WebSphere MQ oder File Transfer .....	46
6.	CBF SWIFT Release .....	47
7.	Vorbereitende Maßnahmen für TARGET2-Securities (T2S) .....	48
7.1	Erweiterung von Settlement Party Informationen .....	48
7.2	Aktivitäten am Migrationswochenende .....	54
7.3	Nutzung des Kennzeichen „MSC“ .....	54
7.4	Prüfung gegen das BIC-Directory .....	54
7.5	Änderung in der Nutzung der „Dispo-Priorität“ .....	55
7.6	TEFRA D - Abschaffung der Funktionalität „Freigabe an Dritte“ .....	55
7.7	Mögliche weitere Sequenz in Settlement Nachrichten für GC-Pooling Aufträge .....	56
7.8	Änderungen bei CASCADE Online-Masken .....	56
7.8.1	Hintergrund der Änderungen .....	56
7.8.2	Details zu neuen und geänderten Feldern .....	56
7.8.3	Beispiele der geänderten Masken .....	59
7.8.4	Änderungen beim Reporting .....	69
7.9	CASCADE-PC – Neue Version 8.0: Erweiterung der CASCADE-PC online Masken .....	71
8.	Kundensimulation CBF Release im November 2014 .....	75
8.1	Simulation des Migrationswochenendes in der CASCADE Simulationsumgebung .....	75
8.2	Simulation von TEFRA D Freigaben .....	76
9.	Selbstbesicherung: Erweiterung der zulässigen Wertpapiere .....	77
10.	Vaults Services .....	78
10.1	Erstbelieferung .....	78
10.2	Tresorkonten in der Girosammelverwahrung (GS) .....	78
10.3	AA16/18: Anpassung der Behandlung von Aufträgen mit Zukunftsvaluta und nach RTS-Ende eingestellten Aufträgen zur Vorbereitung auf T2S Business Day .....	78

Leerseite

# 1. Börsengeschäftsabwicklung

---

Die Änderungen in der Börsengeschäftsabwicklung wurden bereits in der [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) (Kapitel 1) detailliert beschrieben und beziehen sich auf:

- Die Änderung des Dispo-Status für abgelehnte Börsengeschäfte (siehe [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) Kapitel 1.1)
- Vereinheitlichung der Abwicklungsfristen (T+3 auf T+2) in Europa (siehe [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) Kapitel 1.2)  
Die Verkürzung der Abwicklungsfristen für Transaktionen in AKV-verwahrten festverzinslichen Wertpapieren wird im deutschen Markt bereits zum 6. Oktober 2014 umgesetzt.

## 2. Cash Reporting

---

Im Cash Reporting treten ab 17. November 2014 folgende Änderungen in Kraft:

- Abschaffung des Geldtagesauszugs im alten Format (siehe [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) Kapitel 2.1)
- Erweiterung der Geldinformationen per MT950 und MT942 (siehe [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) Kapitel 2.2)



### 3. Asset Services

---

Die Änderungen im Bereich Asset Services, wurden bereits in den CBF-Dokumenten [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#), [„SWIFT & Connectivity: Änderungen im November 2014“](#) und [„Transformation offener Geschäfte in Geld und Wertpapieren“](#) veröffentlicht und beziehen sich auf folgende Bereiche:

- Erweiterung des Lieferumfangs von MT564 REPE Nachrichten für Income Events (siehe [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) Kapitel 3.2.1)
- Neuer Prozess zur Transformation/Reorganisation offener Geschäfte  
Aufgrund der komplexen Prozesse und der daraus entstehenden Anpassungen im Reporting wurde hierzu ein gesondertes funktionales Konzept im September 2014 veröffentlicht (CBF Dokument [„Transformation offener Geschäfte in Geld und Wertpapieren“](#)), in dem alle Details ausführlich beschrieben wurden.
- Anpassungen im Rahmen des SWIFT Release im November 2014 (siehe CBF Dokument [„SWIFT & Connectivity: Änderungen im November 2014“](#))

## 4. Xemac®

### 4.1 Einsatz der neuen Xemac® Version 5.6

Mit dem Release am 17. November 2014 setzt Clearstream Banking die Xemac® Version 5.6 ein. Diese neue Version muss von allen teilnehmenden Instituten bis zu diesem Zeitpunkt installiert sein. Der Zugriff auf Xemac® 5.5, 5.5.1 sowie auf die Vorgängerversionen wird ab diesem Zeitpunkt nicht mehr möglich sein.

Die Software der Xemac® Version 5.6 wird per 27. Oktober 2014 auf der Clearstream Website [www.clearstream.com](http://www.clearstream.com) unter folgendem Pfad für Premium-Nutzer zum Download bereitgestellt:

<https://www.clearstream.com/clearstream-en/products-and-services/global-securities-financing/xemac-technical-specifications/9738>

Das "Installation Manual" für Xemac® Version 5.6 steht dort ebenfalls zur Verfügung.

Die Xemac® Version 5.6 stellt die technische Implementierung der Automatisierung der Kundenschnittstelle sicher, die im Rahmen des OAF Release am 17. November 2014 eingeführt wird.

### 4.2 Automatisierung der Kundenschnittstelle

Mit dem November Release wird Clearstream Banking Xemac® Kunden die Möglichkeit bieten, Anpassungen des Forderungsbetrages durch MT527 SWIFT Nachrichten über die CBF Schnittstellen zu senden. Dies wird zusätzlich zu der bestehenden Möglichkeit angeboten, Forderungen über das Xemac® GUI anzupassen.

Zusätzlich bietet Clearstream Banking Xemac® Kunden zwei neue Produkte "Exposure Management" und "Collateral Management" an. Dies bietet Kunden die Möglichkeit, Reporting über Xemac® Forderungsanpassungen und Stückerbewegungen über MT558 Nachrichten zu erhalten. Kunden haben die Möglichkeit, die MT558 "Processing Advice" Nachrichten aus drei Optionen innerhalb des Produkts "Exposure Management" unter UMFANG zu wählen:

- Alle (A = All)
- Fehler (F = Failure)
- Keine (N = None).

Beide neuen Produkte werden über die Schnittstellen SWIFT sowie WebSphere MQ angeboten. Die entsprechenden Bestellformulare werden mit dem November 2014 Release auf der Website verfügbar sein.

### 4.3 Anforderung zur Anpassung des Forderungsbetrags

Über die neue Kundenschnittstelle haben Kunden die Möglichkeit, den Forderungsbetrag mit dem Senden von SWIFT MT527 Nachrichten anzupassen.

#### 4.3.1 Überblick

Im Folgenden wird ein Überblick über die erforderlichen Felder für die SWIFT-Nachricht "Claim Adjustment Request" im Format MT527 gegeben:

Tag	Status	Field Name	Format
-----	--------	------------	--------

#### Mandatory Sequence A General Information

16R	M	Start of Block	GENL
28E	M	Page Number / Continuation Indicator	5n/4!c
20C	M	Sender's Reference	:SEME//16x
20C	O	Client's Collateral Instruction Reference	:CLCI//16x
20C	O	Sender's Collateral Transaction Reference	:SCTR//16x
23G	M	Function of the Message	NEWM
98A	M	Execution Requested Date	:EXRQ//8!n
22H	M	Instruction Type Indicator	:CINT//4!c
22H	M	Exposure Type Indicator	:COLA//4!c
22H	M	Client Indicator	:REPR//4!c

#### Mandatory Repetitive Subsequence A1 Collateral Parties

16R	M	Start of Block	COLLPTY
95R	M	Party A	:PTYA/DAKV/34x
16S	M	End of Block	COLLPTY
16R	M	Start of Block	COLLPTY
95R	M	Party B	:PTYB/DAKV/34x
16S	M	End of Block	COLLPTY

#### End of Subsequence A1 Collateral Parties

70E	O	Collateral Instruction Narrative	:CINS//10*35x
-----	---	----------------------------------	---------------

#### Optional Repetitive Subsequence A2 Linkages

16R	M	Start of Block	LINK
20C	M	Previous Reference	:PREV//16x
16S	M	End of Block	LINK

#### End of Subsequence A2 Linkages

16S	M	End of Block	GENL
-----	---	--------------	------

#### End of Sequence A General Information

#### Optional Sequence B Deal Transaction Details

16R	M	Start of Block	DEALTRAN
98B	M	Closing Date	:TERM/[8c]/4!c
19A	0	Transaction Amount	:TRAA//[N]3!a15d
16S	M	End of Block	DEALTRAN

End of Sequence B Deal Transaction Details

#### 4.3.2 Beispiel

Beispiel: MT527 "Claim Adjustment Request" – Erhöhung des Forderungsbetrags ohne Kundenreferenz

```

:16R: GENL
:28E: 1/ONLY
:20C::SEME//MSGP002
:20C::CLCI//INSTR002
:20C::SCTR//2012003601
:23G: NEWM
:98A::EXRQ//20141022
:22H::CINT//PADJ
:22H::COLA//SLOA
:22H::REPR//PROV
:16R: COLLPTY
:95R::PTYA/DAKV/XXXXMSC-NONREFMSC-NONREF
:16S: COLLPTY
:16R: COLLPTY
:95R::PTYB/DAKV/YYYYMSC-NONREFMSC-NONREF
:16S: COLLPTY
:70E::CINS//Adjustment reason
:16R: LINK
:20C::PREV//MSGP002
:16S: LINK
:16S: GENL
:16R: DEALTRAN
:98B::TERM//OPEN
:19A::TRAA//EUR2000000,00
:16S: DEALTRAN

```

### 4.3.3 Felddbeschreibung

#### Field 28E – Page Number / Continuation Indicator

SWIFT

Definition: Provides the page number of the message (within a statement) and a continuation indicator to indicate the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: ONLY Only page of the statement.

MORE Intermediate page of a statement which contains additional pages.

LAST Last page of a statement with more than one page.

Syntax: 5n/4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier ONLY is always used, i.e. 1/ONLY.

#### Field 20C – Sender's Reference

SWIFT

Definition: Reference assigned by the Sender to unambiguously identify the message.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :SEME// The field must contain the customer's unique reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: Used analogously to SWIFT.

#### Field 20C – Client's Collateral Instruction Reference

SWIFT

Definition: Reference assigned to the instruction by the client.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :CLCI// Client's Collateral Instruction Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: This is a mandatory field and is the reference assigned to the instruction by the Collateral Provider.

### Field 20C – Sender's Collateral Transaction Reference

SWIFT

Definition: Unique reference identifying the collateral management transaction from the client's point of view.  
Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :SCTR// Sender's Collateral Transaction Reference.  
Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: The field must contain the Xemac® System Claim Number (10 digits numerical) of the Claim to be adjusted. It must match with the System Claim Number of an actual claim in Xemac® for which the Xemac® Collateral Provider equals PARTY A and the Collateral Taker equals PARTY B. The claim must not be based on Contract Definition Types "Euro GC Pooling" and "CMSI".

### Field 23G – Function of the Message

SWIFT

Definition: This field identifies the function of the message.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: NEWM New message.  
Syntax: 4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier NEWM is always used.

### Field 98A – Execution Requested Date

SWIFT

Definition: Date at which the instructing party requests the instruction to be executed.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :EXRQ// Execution Requested Date.  
Syntax: :4!c//8!n

CBF USAGE

Special note: The field must contain the current Xemac® Business Date. The SWIFT MT527 must be sent during the Xemac® opening hours.

### Field 22H – Instruction Type Indicator

SWIFT

Definition: Specifies the type of collateral instruction.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :CINT//PADJ Principal/Exposure Adjustment.  
Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier PADJ is always used.

## Field 22H – Exposure Type Indicator

SWIFT

Definition: Exposure Type Indicator – specifies the underlying business area/type of trade causing the exposure.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :COLA//SLOA Secured Loan  
Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier SLOA is always used.

## Field 22H – Client Indicator

SWIFT

Definition: Client Indicator – specifies whether the client is the collateral giver or taker.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :REPR//PROV Instructing party is the collateral giver.  
Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier PROV is always used: the Collateral Provider is the only party authorised to adjust claims.

## Field 95R – Party A

SWIFT

Definition: Instructing party sending the collateral instruction.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Subsequence A1 Collateral Parties.  
Qualifier: :PTYA/DAKV/ Party A.  
Syntax: :4!c/8c/34x

CBF USAGE

Special note: The PARTY A must be identical to the Xemac® Collateral Provider for the System Claim Number to be adjusted.

The field contains the CBF account number of the instructing party as well as the Xemac® Client Reference.

- In case the Xemac® Client Reference is empty, the following entry is required: DAKV/xxxxMSC-NONREFMSC-NONREF (xxxx representing the CBF account number)
- In case a Client Reference has been assigned by the instructing party for the claim to be adjusted, the following entry is required:  
DAKV/xxxxaaa12345678901bbb1234567890123  
xxxx → the CBF account number  
aaa → Institute Type saved in the Xemac® Client Reference  
12345678901 → Institute Reference saved in the Xemac® Client Reference  
bbb → Custody Account Type saved in the Xemac® Client Reference  
1234567890123 → Custody Account Reference saved in the Xemac® Client Reference

## Field 95R – Party B

SWIFT

Definition: Counterparty of party A.

Sequence: Mandatory in Mandatory Subsequence A1 Collateral Parties.

Qualifier: :PTYB/DAKV Party B.

Syntax: :4!c/8c/34x

CBF USAGE

Special note: The PARTY B must be identical to the Xemac® Collateral Taker for the System Claim Number to be adjusted.

The field contains the CBF account number of the counterparty as well as the Xemac® Client Reference.

- In case the Xemac® Client Reference is empty, the following entry is required: DAKV/yyyyMSC-NONREFMSC-NONREF (yyyy representing the CBF account number)
- In case a Client Reference has been assigned by the counterparty for the claim to be adjusted, the following entry is required:  
DAKV/yyyyccc12345678901ddd1234567890123  
yyyy → the CBF account number  
ccc → Institute Type saved in the Xemac® Client Reference  
12345678901 → Institute Reference saved in the Xemac® Client Reference  
ddd → Custody Account Type saved in the Xemac® Client Reference  
1234567890123 → Custody Account Reference saved in the Xemac® Client Reference

## Field 70E – Collateral Instruction Narrative

SWIFT

Definition: Provides additional information on the collateral instruction.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :CINS// Collateral Instruction Narrative.

Syntax: :4!c//10\*35x

CBF USAGE

Special note: Qualifier CINS is always used. The field can contain the reason for claim adjustment. The value of the field "Collateral Instruction Narrative" (CINS) will be copied in the Xemac® claim comment but will be truncated to 50 characters.

## Field 20C – Previous Reference

SWIFT

Definition: Message reference of the linked message which was previously sent.

Sequence: Mandatory in Optional Subsequence A2 Linkages.

Qualifier: :PREV// Previous Message Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: The field must contain the value of the SEME.



## Field 98B – Closing Date

SWIFT

Definition: Closing date/maturity date.

Sequence: Mandatory in Optional Sequence B Deal Transaction Details.

Qualifier: :TERM//OPEN There is no termination date defined.

Syntax: :4!c/[8c]/4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier OPEN is always used.

## Field 19A – Transaction Amount

SWIFT

Definition: Amount of the transaction.

Sequence: Optional in Optional Sequence B Deal Transaction Details.

Qualifier: :TRAA// Transaction amount.

Syntax: :4!c//[N]3!a15d

CBF USAGE

Special note: The field must contain:

- The new Xemac® Exposure / Claim Amount and not the amount by which the Claim is adjusted.
- The Xemac® Claim Currency.

### 4.3.4 Allgemeine Plausibilitäts-Prüfungen

Zusätzlich zu den im Kapitel [4.3.3](#) erläuterten Plausibilitäts-Prüfungen wurden die folgenden allgemeinen Plausibilitäts-Prüfungen implementiert:

- Alle MT527 Claim Adjustment Requests Nachrichten müssen Clearstream Banking innerhalb der Xemac® Öffnungszeiten erreichen (zwischen 07:00 und 17:45 Uhr).
- Die Felder "Response Status" (REST) sowie "Triparty's Collateral Instruction Reference" (TRCI) müssen leer sein.
- Der neue Forderungsbetrag im Feld "Transaction Amount" (TRAA) muss vom aktuellen Forderungsbetrag in Xemac® abweichen.

Wenn die o. a. Plausibilitäts-Prüfungen erfolgreich verlaufen sind, wird ein positiver "Processing Advice" an den instruierenden Kunden gesendet<sup>1</sup> und der "Claim Adjustment Request" wird weiter verarbeitet.

Wenn mindestens eine der o. a. Prüfungen nicht erfolgreich verläuft, wird ein negativer "Processing Advice" an den instruierenden Kunden gesendet<sup>1</sup>, der sowohl die Kundenreferenz als auch den Ablehnungsgrund enthält. Der "Claim Adjustment Request" wird nicht weiter verarbeitet.

---

<sup>1</sup> Wenn das Produkt "EXPOMA" mit UMFANG = "A" für den jeweiligen Kunden aufgesetzt ist. Für weitere Details, siehe Kapitel 4.4.

## 4.4 Exposure Management

Das Produkt "Exposure Management" beinhaltet die folgenden Informationen:

- MT558 "Processing Advice" Nachricht als Antwort auf eine MT527 "Claim Adjustment Request" Nachricht;
- MT558 "Claim Notification" Nachricht als Bestätigung auf eine MT527 "Claim Adjustment Request" Nachricht oder aufgrund von manuellen Forderungsanpassungen im Xemac® GUI;
- MT558 "Claim Notification" Nachricht als Resultat von Neubewertungen, Verarbeitung von "General Collateral" (GC) Geschäften oder CMSI (Collateral Management Secured Instruments) Geschäft.

### 4.4.1 Überblick MT558 Processing Advice Nachricht

Im Folgenden wird ein Überblick über die Felder der SWIFT-Nachricht MT558 "Processing Advice" gegeben:

Tag	Status	Field Name	Format
-----	--------	------------	--------

Mandatory Sequence A General Information

16R	M	Start of Block	GENL
28E	M	Page Number / Continuation Indicator	5n/4!c
20C	M	Sender's Reference	:SEME//16x
20C	O	Client's Collateral Instruction Reference	:CLCI//16x
20C	O	Client's Collateral Transaction Reference	:CLTR//16x
23G	M	Function of the Message	INST
98A	M	Execution Requested Date	:EXRQ//8!n
22H	M	Instruction Type Indicator	:CINT//4!c
22H	M	Exposure Type Indicator	:COLA//4!c
22H	M	Client Indicator	:REPR//4!c

Mandatory Repetitive Subsequence A1 Collateral Parties

16R	M	Start of Block	COLLPTY
95R	M	Party A	:PTYA/DAKV/34x
16S	M	End of Block	COLLPTY
16R	M	Start of Block	COLLPTY
95R	M	Party B	:PTYB/DAKV/34x
16S	M	End of Block	COLLPTY

End of Subsequence A1 Collateral Parties

Optional Repetitive Subsequence A2 Status

16R	M	Start of Block	STAT
25D	M	Instruction Processing Status	:IPRC/[8c]/4!c
16S	M	End of Block	STAT

End of Subsequence A2 Status

70D	O	Reason Narrative	:REAS//6*35x
70E	O	Collateral Instruction Narrative	:CINS//10*35x

Optional Repetitive Subsequence A3 Linkages

16R	M	Start of Block	LINK
20C	M	Related Reference	:RELA//16x
20C	M	Previous Reference	:PREV//16x
16S	M	End of Block	LINK

End of Subsequence A3 Linkages

16S	M	End of Block	GENL
-----	---	--------------	------

End of Sequence A General Information

Mandatory Sequence B Deal Transaction Details

16R	M	Start of Block	DEALTRAN
98B	M	Closing Date	:TERM/[8c]/4!c
19A	O	Transaction Amount	:TRAA//[N]3!a15d
16S	M	End of Block	DEALTRAN

End of Sequence B Deal Transaction Details

#### 4.4.2 Beispiel

Beispiel: MT558 Negative "Processing Advice" Nachricht

```
:16R: GENL
:28E: 1/ONLY
:20C::SEME//0000000000023161
:20C::CLCI//INSTR002
:20C::CLTR//2012003601
:23G: INST
:98A::EXRQ//20141022
:22H::CINT//PADJ
:22H::COLA//SLOA
:22H::REPR//PROV
:16R: COLLPTY
:95R::PTYA/DAKV/XXXXMSC-NONREFMSC-NONREF
:16S: COLLPTY
:16R: COLLPTY
:95R::PTYB/DAKV/YYYYMSC-NONREFMSC-NONREF
:16S: COLLPTY
:16R: STAT
:25D::IPRC//REJT
:16S: STAT
:70D::REAS//Access only possible during online period
:70E::CINS//Adjustment reason
:16R: LINK
:20C::RELA//MSGP002
:20C::PREV//0000000000023161
:16S: LINK
:16S: GENL
:16R: DEALTRAN
:98B::TERM//OPEN
:19A::TRAA//EUR2000000,00
:16S: DEALTRAN
```

#### 4.4.3 Felddbeschreibung

##### Field 28E – Page Number / Continuation Indicator

SWIFT

Definition: Provides the page number of the message (within a statement) and a continuation indicator to indicate the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: ONLY Only page of the statement.  
MORE Intermediate page of a statement which contains additional pages.

Syntax: LAST Last page of a statement with more than one page.  
5n/4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier ONLY is always used, i.e. 1/ONLY.

##### Field 20C – Sender's Reference

SWIFT

Definition: Reference assigned by the Sender to unambiguously identify the message.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :SEME// Sender's Message Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: The qualifier SEME is used with a structured technical reference, which is unique for at least one year. The reference is composed of 16 alphanumeric characters.

##### Field 20C – Client's Collateral Instruction Reference

SWIFT

Definition: Reference assigned to the instruction by the client..

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :CLCI// Client's Collateral Instruction Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: This field contains the information as received in the MT527.

## Field 20C – Client's Collateral Transaction Reference

SWIFT

Definition: Unique reference identifying the triparty collateral management transaction from the client's point of view.  
Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :CLTR// Client's Collateral Transaction Reference.  
Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: This field contains the information as received in the MT527 in field :20C::SCTR.

## Field 23G – Function of the Message

SWIFT

Definition: This field identifies the function of the message.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: INST Message reporting on an instruction status.  
Syntax: 4!c[/4!c]

CBF USAGE

Special note: Qualifier INST is always used.

## Field 98A – Execution Requested Date

SWIFT

Definition: Date at which the instructing party requested the instruction to be executed.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information..  
Qualifier: :EXRQ// Execution Requested Date.  
Syntax: :4!c/8!n

CBF USAGE

Special note: The field contains the information as received in the MT527.

## Field 22H – Instruction Type Indicator

SWIFT

Definition: Specifies the type of collateral instruction.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :CINT//  
Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: This field contains the information as received in the MT527.

### Field 22H – Exposure Type Indicator

SWIFT

Definition: Exposure Type Indicator – specifies the underlying business area/type of trade causing the exposure.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :COLA//  
Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: This field contains the information as received in the MT527.

### Field 22H – Client Indicator

SWIFT

Definition: Client Indicator – specifies whether the client is the collateral taker or giver.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :REPR//  
Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: This field contains the information as received in the MT527.

### Field 95R – Party A

SWIFT

Definition: Instructing party sending the collateral instruction.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Subsequence A1 Collateral Parties.  
Qualifier: :PTYA/DAKV/ Party A.  
Syntax: :4!c/8c/34x

CBF USAGE

Special note: This field contains the information as received in the MT527.

### Field 95R – Party B

SWIFT

Definition: Counterparty of party A.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Subsequence A1 Collateral Parties.  
Qualifier: :PTYB/DAKV/ Party B.  
Syntax: :4!c/8c/34x

CBF USAGE

Special note: This field contains the information as received in the MT527.

## Field 25D – Instruction Processing Status

SWIFT

Definition: Provides the status of an instruction.

Sequence: Mandatory in Optional Subsequence A2 Status.

Qualifier: :IPRC//PACK Instruction has been acknowledged by the account servicer.

:IPRC//REJT Instruction has been rejected for further processing.

Syntax: :4!c/[8c]/4!c

CBF USAGE

Special note: The field is filled with:

- PACK – in case of positive acknowledgement.
- REJT – in case of negative acknowledgement.

## Field 70D – Reason Narrative

SWIFT

Definition: Provides additional reason information.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :REAS// Reason Narrative.

Syntax: :4!c//6\*35x

CBF USAGE

Special note: The field is filled with the rejection reason in case of negative acknowledgement.

## Field 70E – Collateral Instruction Narrative

SWIFT

Definition: Provides additional information on the collateral instruction.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information

Qualifier: :CINS// Collateral Instruction Narrative.

Syntax: :4!c//10\*35x

CBF USAGE

Special note: This field contains the information as received in the MT527 but will be truncated to 50 characters.

## Field 20C – Related Reference

SWIFT

Definition: Message reference assigned by the client to the message to which this message is the reply.

Sequence: Mandatory in Optional Subsequence A3 Linkages.

Qualifier: :RELA// Related Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: For Claim Confirmation, the field contains the information as received in the MT527 in the field :20C::SEME.



### Field 20C – Previous Reference

SWIFT

Definition: Message reference of the linked message which was previously sent.

Sequence: Mandatory in Optional Subsequence A3 Linkages.

Qualifier: :PREV// Previous Message Reference

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: The field contains the value of the SEME.

### Field 98B – Closing Date

SWIFT

Definition: Closing date/maturity date.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence B Deal Transaction Details.

Qualifier: :TERM//OPEN There is no termination date defined.

Syntax: :4!c//[8c]/4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier OPEN is always used.

### Field 19A – Transaction Amount

SWIFT

Definition: Amount of the transaction.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence B Deal Transaction Details.

Qualifier: :TRAA// Transaction amount.

Syntax: :4!c//[N]3!a15d

CBF USAGE

Special note: This field contains the absolute value of the amount received in the MT527.

#### 4.4.4 Überblick MT558 Claim Confirmation / Notification Nachricht

Im Folgenden wird ein Überblick über die Felder der SWIFT-Nachricht MT558 "Claim Confirmation" / "Claim Notification" gegeben:

Tag	Status	Field Name	Format
-----	--------	------------	--------

##### Mandatory Sequence A General Information

16R	M	Start of Block	GENL
28E	M	Page Number / Continuation Indicator	5n/4!c
20C	M	Sender's Reference	:SEME//16x
20C	O	Client's Collateral Instruction Reference	:CLCI//16x
20C	O	Triparty's Collateral Instruction Reference	:TRCI//16x
20C	O	Client's Collateral Transaction Reference	:CLTR//16x
23G	M	Function of the Message	INST[/4!c] INST/COPY for Collateral Taker
98A	M	Execution Requested Date	:EXRQ//8!n
22H	M	Instruction Type Indicator	:CINT//4!c
22H	M	Exposure Type Indicator	:COLA//4!c
22H	M	Client Indicator	:REPR//4!c
13B	O	Eligibility Set Profile Number	:ELIG/[8c]/30x

##### Mandatory Repetitive Subsequence A1 Collateral Parties

16R	M	Start of Block	COLLPRTY
95R	M	Party A	:PTYA/DAKV/34x
16S	M	End of Block	COLLPRTY
16R	M	Start of Block	COLLPRTY
95R	M	Party B	:PTYB/DAKV/34x
16S	M	End of Block	COLLPRTY

##### End of Subsequence A1 Collateral Parties

##### Optional Repetitive Subsequence A2 Status

16R	M	Start of Block	STAT
25D	M	Instruction Processing Status	:IPRC/[8c]/4!c
16S	M	End of Block	STAT
16R	M	Start of Block	STAT
25D	M	Settlement Status	:SETT/[8c]/4!c
16S	M	End of Block	STAT

##### End of Subsequence A2 Status

19A	0	Collateralised Amount	:ALAM//[N]3!a15d
19A	0	Settled Amount	:ESTT//[N]3!a15d
70E	0	Collateral Instruction Narrative	:CINS//10*35x

Optional Repetitive Subsequence A3 Linkages

16R	M	Start of Block	LINK
20C	M	Related Reference	:RELA//16x
20C	M	Previous Reference	:PREV//16x
16S	M	End of Block	LINK

End of Subsequence A3 Linkages

16S	M	End of Block	GENL
-----	---	--------------	------

End of Sequence A General Information

Mandatory Sequence B Deal Transaction Details

16R	M	Start of Block	DEALTRAN
98B	M	Closing Date	:TERM/[8c]/4!c
19A	0	Transaction Amount	:TRAA//[N]3!a15d
16S	M	End of Block	DEALTRAN

#### 4.4.5 Beispiel

Beispiel: MT558 "Claim Confirmation" Nachricht

```
:16R: GENL
:28E: 1/ONLY
:20C::SEME//X48409343216F1AO
:20C::CLCI//INSTR002
:20C::TRCI//2012003601000006
:20C::CLTR//2012003601
:23G: INST
:98A::EXRQ//20141022
:22H::CINT/PADJ
:22H::COLA//SLOA
:22H::REPR//PROV
:16R: COLLPTY
:95R::PTYA/DAKV/XXXXMSC-NONREFMSC-NONREF
:16S: COLLPTY
:16R: COLLPTY
:95R::PTYB/DAKV/YYYYMSC-NONREFMSC-NONREF
:16S: COLLPTY
:16R: STAT
:25D::IPRC//TREA
:16S: STAT
:16R: STAT
:25D::SETT//SETT
:16S: STAT
:19A::ALAM//EUR000002000000,00
:19A::ESTT//EUR000002000000,10
:70E::CINS//Adjustment reason
:16R: LINK
:20C::RELA//MSGP002
:20C::PREV//X48409343216F1AO
:16S: LINK
:16S: GENL
:16R: DEALTRAN
:98B::TERM//OPEN
:19A::TRAA//EUR000002000000,00
:16S: DEALTRAN
```

#### 4.4.6 Felddbeschreibung

##### Field 28E – Page Number / Continuation Indicator

SWIFT

Definition: Provides the page number of the message (within a statement) and a continuation indicator to indicate the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: ONLY Only page of the statement.  
MORE Intermediate page of a statement which contains additional pages.  
LAST Last page of a statement with more than one page.

Syntax: 5n/4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier ONLY is always used, i.e. 1/ONLY.

##### Field 20C – Sender's Reference

SWIFT

Definition: Reference assigned by the Sender to unambiguously identify the message.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :SEME// Sender's Message Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: The qualifier SEME is used with a structured technical reference, which is unique for at least one year. The reference is composed of 16 alphanumeric characters.

##### Field 20C – Client's Collateral Instruction Reference

SWIFT

Definition: Reference assigned to the instruction by the client.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :CLC// Client's Collateral Instruction Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: This field is provided in MT558 Claim Confirmation messages to Collateral Provider and contains the information as received in the MT527 in field :20C::SCTR or as manually entered via the Xemac® GUI.

## Field 20C – Triparty's Collateral Instruction Reference

SWIFT

Definition: Reference assigned to the instruction by the triparty agent.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :TRCI// Triparty's Collateral Instruction Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: Reference assigned to the instruction by Xemac®. This field contains the combination of the Xemac® System Claim Number and the Version Number. It is recommended that customers consider this (ascending Version Number) in order to ensure a correct synchronisation between the customer's backend and Xemac®, independent of message arrival sequence.  
This field is not delivered if a requested claim adjustment could not be processed (:SETT//USET).

## Field 20C – Client's Collateral Transaction Reference

SWIFT

Definition: Unique reference identifying the triparty collateral management transaction from the client's point of view.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :CLTR// Client's Collateral Transaction Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: The field contains the Xemac® System Claim Number (10 digits numerical) of the Claim.

## Field 23G – Function of the Message

SWIFT

Definition: This field identifies the function of the message.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: INST Message reporting on an instruction status.  
INST/COPY Message is a copy to a party other than the account owner/account servicer, for information purposes.

Syntax: 4!c[/4!c]

CBF USAGE

Special note: Qualifier INST for Collateral Provider or INST/COPY for Collateral Taker is always used.

### Field 98A – Execution Requested Date

SWIFT

Definition: Date at which the instructing party requested the instruction to be executed.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :EXRQ// Execution Requested Date.

Syntax: :4!c/8!n

CBF USAGE

Special note: The field contains the Xemac® Business Date on which the transaction was processed.

### Field 22H – Instruction Type Indicator

SWIFT

Definition: Specifies the type of collateral instruction.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :CINT//PADJ Principal Exposure Adjustment.

Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier PADJ is always used.

### Field 22H – Exposure Type Indicator

SWIFT

Definition: Exposure Type Indicator – specifies the underlying business area/type of trade causing the exposure.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :COLA//SLOA Secured Loan

Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier SLOA is always used.

### Field 22H – Client Indicator

SWIFT

Definition: Client Indicator – specifies whether the client is the collateral taker or giver.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :REPR//PROV Instructing party is the collateral giver.

Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier PROV is always used.

### Field 13B – Eligibility Set Profile Number

SWIFT

Definition: Number identifying the collateral eligibility set profile of the counterparty.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :ELIG// Eligibility Set Profile Number.

Syntax: :4!c/[8c]/30x

CBF USAGE

Special note:

If a basket can be reported, the field will include:

- REUSE = Eurex Margining Exclusive Reuse
- CLASSIC = Eurex Margining Classic
- The respective GCP Basket.

### Field 95R – Party A

SWIFT

Definition: Instructing party sending the collateral instruction.

Sequence: Mandatory in Mandatory Subsequence A1 Collateral Parties.

Qualifier: :PTYA/DAKV/ Party A.

Syntax: :4!c/8c/34x

CBF USAGE

Special note:

The field contains the CBF account number of the instructing party as well as the Xemac® Client Reference. The PARTY A is identical to the Xemac® Collateral Provider for the System Claim Number.

### Field 95R – Party B

SWIFT

Definition: Counterparty of party A.

Sequence: Mandatory in Mandatory Subsequence A1 Collateral Parties.

Qualifier: :PTYB/DAKV/ Party B.

Syntax: :4!c/8c/34x

CBF USAGE

Special note:

The field contains the CBF account number of the counterparty as well as the Xemac® Client Reference. The PARTY B is identical to the Xemac® Collateral Taker for the System Claim Number.



## Field 25D – Instruction Processing Status

SWIFT

Definition:	Provides the status of an instruction.	
Sequence:	Mandatory in Optional Subsequence A2 Status.	
Qualifier:	:IPRC//PACK	Instruction has been acknowledged by the account servicer.
	:IPRC//REJT	Instruction has been rejected for further processing.
	:IPRC//TREA	Transaction has been treated.
Syntax:	:4!c/[8c]/4!c	
CBF USAGE		
Special note:	Qualifier TREA is always used.	

## Field 25D – Settlement Status

SWIFT

Definition:	Provides the settlement status of an instruction.	
Sequence:	Mandatory in Optional Subsequence A2 Status.	
Qualifier:	:SETT//SETT	Full settlement.
	:SETT//PAIN	Part of the instruction remains unsettled.
	:SETT//USET	Instruction is unsettled.
Syntax:	:4!c/[8c]/4!c	
CBF USAGE		
Special note:	The field is filled with: SETT: New claim amount ALAM equals requested claim amount TRAA. PAIN: New claim amount ALAM is less than requested claim amount TRAA. USET: Requested claim adjustment could not be processed.	

## Field 19A – Collateralised Amount

SWIFT

Definition:	Amount which is collateralised.	
Sequence:	Optional in Mandatory Sequence A General Information.	
Qualifier:	:ALAM//	Collateralised Amount.
Syntax:	:4!c//[N]3!a15d	
CBF USAGE		
Special note:	The field contains: <ul style="list-style-type: none"><li>• The Xemac® Claim Currency</li><li>• The new Xemac® Exposure / Claim Amount</li></ul> but is not delivered for Settlement Status USET.	

### Field 19A – Settled Amount

SWIFT

Definition: Amount effectively settled and which will be credited to/debited from the account owner's position.  
Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :ESTT// Settled Amount.  
Syntax: :4!c//[N]3!a15d

CBF USAGE

Special note: The field contains:

- The Xemac® Claim Currency
- The collateral value of the new Xemac® Exposure / Claim Amount but is not delivered for Settlement Status USET.

### Field 70E – Collateral Instruction Narrative

SWIFT

Definition: Provides additional information on the collateral instruction.  
Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information  
Qualifier: :CINS// Collateral Instruction Narrative.  
Syntax: :4!c//10\*35x

CBF USAGE

Special note: Claim adjustment comment, e.g. as received in MT527, entered via Xemac® GUI or provided by Xemac® System.

### Field 20C – Related Reference

SWIFT

Definition: Message reference assigned by the client to the message to which this message is the reply.  
Sequence: Mandatory in Optional Subsequence A3 Linkages.  
Qualifier: :RELA// Related Reference.  
Syntax: :4!c//16c

CBF USAGE

Special note: The field contains for Claim Confirmation the information as received in the MT527 in the field :20C::SEME.

### Field 20C – Previous Reference

SWIFT

Definition: Message reference of the linked message which was previously sent.

Sequence: Mandatory in Optional Subsequence A3 Linkages.

Qualifier: :PREV// Previous Message Reference

Syntax: :4!c//16c

CBF USAGE

Special note: The field contains the value of the SEME.

### Field 98B – Closing Date

SWIFT

Definition: Closing date/maturity date.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence B Deal Transaction Details.

Qualifier: :TERM//OPEN There is no termination date defined.

Syntax: :4!c/[8c]/4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier OPEN is always used.

### Field 19A – Transaction Amount

SWIFT

Definition: Amount of the transaction.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence B Deal Transaction Details.

Qualifier: :TRAA// Transaction amount.

Syntax: :4!c//[N]3!a15d

CBF USAGE

Special note: The field contains the absolute value of the amount received via MT527, Xemac® GUI or Xemac® System.

## 4.5 Collateral Management

Das Produkt "Collateral Management" beinhaltet die folgenden Informationen:

- MT558 "Collateral Notification" Nachrichten werden für Stückebewegungen produziert, die aus folgenden Gründen resultieren: Forderungsanpassungen, andere Prozesse mit automatischer Generierung von Allokations-Instruktionen (z. B. Neubewertung, Substitutionen) oder manuelle Allokationen, die über das Xemac® GUI eingegeben wurden.

### 4.5.1 Überblick

Im Folgenden wird ein Überblick über die Felder der SWIFT-Nachricht MT558 "Collateral Notification" gegeben:

Tag	Status	Field Name	Format
-----	--------	------------	--------

#### Mandatory Sequence A General Information

16R	M	Start of Block	GENL
28E	M	Page Number / Continuation Indicator	5n/4!c
20C	M	Sender's Reference	:SEME//16x
20C	O	Triparty's Collateral Instruction Reference	:TRCI//16x
20C	O	Client's Collateral Transaction Reference	:CLTR//16x
23G	M	Function of the Message	INST[/4!c] INST/COPY for Collateral Taker
98A	M	Execution Requested Date	:EXRQ//8!n
22H	M	Instruction Type Indicator	:CINT//4!c
22H	M	Exposure Type Indicator	:COLA//4!c
22H	M	Client Indicator	:REPR//4!c

#### Mandatory Repetitive Subsequence A1 Collateral Parties

16R	M	Start of Block	COLLPTY
95R	M	Party A	:PTYA/DAKV/34x
16S	M	End of Block	COLLPTY
16R	M	Start of Block	COLLPTY
95R	M	Party B	:PTYB/DAKV/34x
16S	M	End of Block	COLLPTY

#### End of Subsequence A1 Collateral Parties

#### Optional Repetitive Subsequence A2 Status

16R	M	Start of Block	STAT
25D	M	Instruction Processing Status	:IPRC/[8c]/4!c
16S	M	End of Block	STAT
16R	M	Start of Block	STAT
25D	M	Allocation Status	:ALOC/[8c]/4!c

16S	M	End of Block	STAT
16R	M	Start of Block	STAT
25D	M	Settlement Status	:SETT/[8c]/4!c
16S	M	End of Block	STAT

End of Subsequence A2 Status

17B	O	Collateral Approved Flag	:CAPP//1a!
-----	---	--------------------------	------------

Optional Repetitive Subsequence A3 Linkages

16R	M	Start of Block	LINK
20C	M	Previous Reference	:PREV//16x
16S	M	End of Block	LINK

End of Subsequence A3 linkages

16S	M	End of Block	GENL
-----	---	--------------	------

End of Sequence A General Information

Mandatory Sequence B Deal Transaction Details

16R	M	Start of Block	DEALTRAN
98B	M	Closing Date	:TERM/[8c]/4!c
19A	O	Transaction Amount	:TRAA//[N]3!a15d
16S	M	End of Block	DEALTRAN

End of Sequence B Deal Transaction Details

Optional Repetitive Sequence C Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE
22H	M	In/Out Indicator	:INOU//4!c
35B	M	Identification of Security Description of Security	[ISIN1!e12c] [4*35x]
36B	M	Quantity of Financial Instrument	:QSEC//4!c/15d
17B	M	Collateral Flag	:COLL//1!a
16S	M	End of Block	SECMOVE

End of Sequence C Securities Movement

## 4.5.2 Beispiel

Beispiel: MT558 "Collateral Management" Nachricht

```
:16R: GENL
:28E: 1/ONLY
:20C::SEME//X484075315239200
:20C::TRCI//7999/0000000229S
:20C::CLTR//2013000032
:23G: INST
:98A::EXRQ//20140804
:22H::CINT//CADJ
:22H::COLA//SLOA
:22H::REPR//PROV
:16R: COLLPTY
:95R::PTYA/DAKV/XXXXMSC-NONREFMSC-NONREF
:16S: COLLPTY
:16R: COLLPTY
:95R::PTYB/DAKV/YYYYMSC-NONREFMSC-NONREF
:16S: COLLPTY
:16R: STAT
:25D::IPRC//TREA
:16S: STAT
:16R: STAT
:25D::ALOC//AOLF
:16S: STAT
:16R: STAT
:25D::SETT//SETT
:16S: STAT
:17B::CAPP//Y
:16R: LINK
:20C::PREV//X484075315239200
:16S: LINK
:16S: GENL
:16R: DEALTRAN
:98B::TERM//OPEN
:19A::TRAA//EUR0,
:16S: DEALTRAN
:16R: SECMOVE
:22H::INOU//COLO
:35B: ISIN XS0099228735
      /DEP/CBL
:36B::QSEC//FAMT/0061000000,0000
:17B::COLL//Y
:16S: SECMOVE
```

```

:16R: SECMOVE
:22H: : INOU//COLI
:35B: ISIN DE0008232125
      /DEP/CBF
:36B: :QSEC//UNIT/0000040299,0000
:17B: :COLL//Y
:16S: SECMOVE
:16R: SECMOVE
:22H: : INOU//COLI
:35B: ISIN XS0581062675
      /DEP/CBL
:36B: :QSEC//FAMT/0010000000,0000
:17B: :COLL//Y
:16S: SECMOVE

```

### 4.5.3 Felddbeschreibung

#### Field 28E – Page Number / Continuation Indicator

SWIFT

Definition: Provides the page number of the message (within a statement) and a continuation indicator to indicate the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: ONLY Only page of the statement.  
 MORE Intermediate page of a statement which contains additional pages.

Syntax: LAST Last page of a statement with more than one page.  
 5n/4!c

CBF USAGE

Special note: Used analogously to SWIFT.

#### Field 20C – Sender's Reference

SWIFT

Definition: Reference assigned by the Sender to unambiguously identify the message.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :SEME// Sender's Message Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: The qualifier SEME is used with a structured technical reference, which is unique for at least one year. The reference is composed of 16 alphanumeric characters.

## Field 20C – Triparty's Collateral Instruction Reference

SWIFT

Definition: Reference assigned to the instruction by the triparty agent.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :TRCI// Triparty's Collateral Instruction Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: Reference assigned to the instruction by Xemac®.

## Field 20C – Client's Collateral Transaction Reference

SWIFT

Definition: Unique reference identifying the triparty collateral management transaction from the client's point of view.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :CLTR// Client's Collateral Transaction Reference.

Syntax: :4!c//16x

CBF USAGE

Special note: The field contains the Xemac® System Claim Number (10 digits numerical) of the Claim for which the securities movement(s) took place.

## Field 23G – Function of the Message

SWIFT

Definition: This field identifies the function of the message.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: INST Message reporting on an instruction status.  
INST/COPY Message is a copy to a party other than the account owner/account servicer, for information purposes.

Syntax: 4!c[/4!c]

CBF USAGE

Special note: Qualifier INST for Collateral Provider or INST/COPY for Collateral Taker is always used.

## Field 98A – Execution Requested Date

SWIFT

Definition: Date at which the instructing party requested the instruction to be executed.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :EXRQ// Execution Requested Date.

Syntax: :4!c//8!n

CBF USAGE

Special note: The field contains the Xemac® Business Date on which the securities movement(s) took place.



## Field 22H – Instruction Type Indicator

SWIFT

Definition: Specifies the type of collateral instruction.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :CINT//CADJ Collateral Adjustment  
Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier CADJ is always used.

## Field 22H – Exposure Type Indicator

SWIFT

Definition: Exposure Type Indicator – specifies the underlying business area/type of trade causing the exposure.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :COLA//SLOA Secured Loan  
Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier SLOA is always used.

## Field 22H – Client Indicator

SWIFT

Definition: Client Indicator – specifies whether the client is the collateral taker or giver.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence A General Information.  
Qualifier: :REPR//PROV Instructing party is the collateral giver.  
Syntax: :4!c//4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier PROV is always used.

## Field 95R – Party A

SWIFT

Definition: Instructing party sending the collateral instruction.  
Sequence: Mandatory in Mandatory Subsequence A1 Collateral Parties.  
Qualifier: :PTYA//DAKV/ Party A.  
Syntax: :4!c/:8c/34x

CBF USAGE

Special note: The field contains the CBF account number of the instructing party as well as the Xemac® Client Reference. The PARTY A is identical to the Xemac® Collateral Provider for the System Claim Number for which the securities movements have taken place.

## Field 95R – Party B

SWIFT

Definition: Counterparty of party A.

Sequence: Mandatory in Mandatory Subsequence A1 Collateral Parties.

Qualifier: :PTYB/DAKV/ Party B.

Syntax: :4!c/:8c/34x

CBF USAGE

Special note: The field contains the CBF account number of the counterparty as well as the Xemac® Client Reference. The PARTY B is identical to the Xemac® Collateral Taker for the System Claim Number for which the securities movements have taken place.

## Field 25D – Instruction Processing Status

SWIFT

Definition: Provides the status of an instruction.

Sequence: Mandatory in Optional Subsequence A2 Status.

Qualifier: :IPRC//PACK Instruction has been acknowledged by the account servicer.

:IPRC//REJT Instruction has been rejected for further processing.

:IPRC//TREA Transaction has been treated.

Syntax: :4!c/[8c]/4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier TREA is always used.

## Field 25D – Allocation Status

SWIFT

Definition: Provides the allocation status of an instruction.

Sequence: Mandatory in Optional Subsequence A2 Status.

Qualifier: :ALOC//AOLF Instruction has been fully covered by collateral.

:ALOC//AOLP Instruction has been partially covered by collateral.

Syntax: :4!c/[8c]/4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier AOLF is always used.

## Field 25D – Settlement Status

SWIFT

Definition: Provides the settlement status of an instruction.

Sequence: Mandatory in Optional Subsequence A2 Status.

Qualifier: :SETT//SETT Full settlement.

:SETT//PAIN Part of the instruction remains unsettled.

:SETT//USET Instruction is unsettled.

Syntax: :4!c/[8c]/4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier SETT is always used.

### Field 17B – Collateral Approved Flag

SWIFT

Definition: Indicates whether the proposed collateral movements can be accepted.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence A General Information.

Qualifier: :CAPP// Collateral Approved  
:CAPP//Y The proposed collateral movements are OK.  
:CAPP//N The proposed collateral movements are not OK.

Syntax: :4!c//1!a

CBF USAGE

Special note: Qualifier code Y is always used.

### Field 20C – Previous Reference

SWIFT

Definition: Message reference of the linked message which was previously sent.

Sequence: Mandatory in Optional Subsequence A3 Linkages

Qualifier: :PREV// Previous Message Reference

Syntax: :4!c//16c

CBF USAGE

Special note: The field contains the value of the SEME of the first message and this for all messages.

### Field 98B – Closing Date

SWIFT

Definition: Closing date/maturity date.

Sequence: Mandatory in Mandatory Sequence B Deal Transaction Details

Qualifier: :TERM//OPEN There is no termination date defined.

Syntax: :4!c/[8c]/4!c

CBF USAGE

Special note: Qualifier OPEN is always used.

### Field 19A – Transaction Amount

SWIFT

Definition: Amount of the transaction.

Sequence: Optional in Mandatory Sequence B Deal Transaction Details

Qualifier: :TRAA// Transaction amount.

Syntax: :4!c//[N]3!a15d

CBF USAGE

Special note: The field contains the claim currency followed by “0,”.

## Field 22H – In / Out Indicator

SWIFT

Definition: Specifies whether the quantity of financial instrument is to be delivered or received.

Sequence: Mandatory in Optional Repetitive Sequence C Securities Movement.

Qualifier: :INOU//COLI Financial Instruments are to be delivered out of Party A's safekeeping account.

:INOU//COLO Financial Instruments are to be received in Party A's safekeeping account.

Syntax: :4 !c//4!c

CBF USAGE

Special note: The field contains:

- COLI = Collaterals IN, i.e. Allocation
- COLO = Collaterals OUT, i.e. Release

## Field 35B – Identification of Security / Description of Security

SWIFT

Definition: The field identifies the financial instrument.

Sequence: Mandatory in Optional Repetitive Sequence C Securities Movement.

Qualifier: Identification of Security.

Syntax: [ISIN1!e12!c]  
[4\*35x]

CBF USAGE

Special note: This field contains the ISIN as well as the Settlement Location (DEP/CBF or DEP/CBL).

## Field 36B – Quantity of Financial Instrument

SWIFT

Definition: Quantity of financial instrument.

Sequence: Mandatory in Optional Repetitive Sequence C Securities Movement.

Qualifier: :QSEC//FAMT Quantity expressed as an amount representing the face amount, that is, the principal, of a debt instrument.

:QSEC//UNIT Quantity expressed as a number, for example, a number of shares.

Syntax: :4 !c//4!c/15d

CBF USAGE

Special note: Qualifier FAMT or UNIT is always used.

## Field 17B – Collateral Flag

SWIFT

Definition:	Indicates whether the cash amount is delivered/received as part of collateral.	
Sequence:	Mandatory in Optional Repetitive Sequence C Securities Movement.	
Qualifier:	:COLL//Y	Amount of money is part of the collateral.
	:COLL//N	Amount of money is not part of the collateral; it is part of the deal transaction.
Syntax:	:4 !c//1!a	

CBF USAGE

Special note: Qualifier code Y is always used.

## 4.6 Verschiedene Änderungen im Bereich Forderungen

### 4.6.1 Spalte “GCP Reuse Basket” (in tabellarischer Ansicht / Report – Forderungsbetrag)

Die folgenden Änderungen werden vorgenommen:

1. Spalte wird umbenannt in “GCP Basket”;
2. In der Spalte wird der entsprechende Basket (EGCP, EGCPX, etc.) der GC Pooling Forderung angezeigt. Dies ergänzt die aktuelle Funktionalität, die den GC Pooling Basket lediglich beim Re-use anzeigt.

### 4.6.2 Feld - Kommentar

Die Verwendung des Feldes wird sich in den folgenden Fällen ändern:

- Für den Sicherheitengeber, wenn eine neue Forderungs-Version durch Xemac® generiert wird durch
  - automatische Prozesse, z. B. Neubewertung, wird das Feld initialisiert, d. h. es wird als leer in der neuen Forderungsversion angezeigt; oder
  - durch MT527 “Claim Adjustment Request” wird der Inhalt des Feldes “Collateral Instruction Narrative” (CINS) in das Feld „Kommentar“ kopiert.
- Für den Sicherheitennehmer wird, wenn eine neue Forderungsversion generiert wird, das Feld „Kommentar“ des Sicherheitennehmers initialisiert und
  - wenn eine MT527 Bestätigungs-Nachricht des Sicherheitennehmers verarbeitet wird, das Feld “Collateral Instruction Narrative” (CINS) kopiert.
  - wenn eine Forderungsanpassung manuell bestätigt wird, hat der Sicherheitennehmer die Möglichkeit, einen Kommentar einzugeben.

Wenn CINS kopiert wird, wird der Wert des Felds “Collateral Instruction Narrative” (CINS) ggf. auf 50 Stellen gekürzt.

### 4.6.3 Feld – Transaktionsreferenz in Detail-Ansicht “Forderung”, Reiter “Bearbeitungsinfo”

Wenn der Sicherheitengeber eine Forderungs-Anpassung eingibt, kann er optional eine Referenz in diesem Feld eingeben. Ist das Produkt „EXPOMA“ für den Kunden aufgesetzt, wird der Wert dieses Feldes in der MT558 “Claim Confirmation” Nachricht im Feld 20C - Client’s Collateral Instruction Reference (CLCI) übernommen.

### 4.6.4 Verarbeitung von Forderungsanpassung

Anforderungen zur Herabsetzung eines Forderungsbetrags, die um 18.00 Uhr noch auf Bestätigung/Ablehnung des Sicherheitennehmers warten, werden automatisch abgelehnt.

## 5. TEFRA D Freigaben per SWIFT, WebSphere MQ oder File Transfer

---

Ab 17. November 2014 können TEFRA D Freigaben nicht nur online, sondern auch mit einer MT542 Nachricht (Lieferung frei von Zahlung) per SWIFT, WebSphere MQ oder File Transfer instruiert werden. Details hierzu wurden bereits in der Vorankündigung zum CBF Release in Kapitel 5 beschrieben. Die Möglichkeit kann optional genutzt werden, die entsprechenden Prozesse auf Kundenseite können – so gewünscht – auch zu einem späteren Zeitpunkt eingeführt werden.

Zur Simulation von TEFRA D Freigaben in der CASCADE Testumgebung IMS23 beachten Sie bitte auch die Ausführungen im Kapitel [8.2](#).

Zusätzlich finden Sie weitere Ausführungen unter Kapitel [7.6](#) TEFRA D – Abschaffung der Funktionalität „Freigabe an Dritte“.

## 6. CBF SWIFT Release

---

Die erforderlichen Anpassungen für das SWIFT Release im November 2014 beziehen sich auf das Custody Reporting (MT564, MT566) und wurden bereits ausführlich in der Mitteilung „[CBF SWIFT und Connectivity Änderungen November 2014](#)“ erläutert, die im August 2014 veröffentlicht wurde.

## 7. Vorbereitende Maßnahmen für TARGET2-Securities (T2S)

In der [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) (veröffentlicht am 30. Mai 2014) hat CBF bereits mitgeteilt, dass inhaltliche und strukturelle Maßnahmen in Vorbereitung auf die Migration auf T2S implementiert werden. Zusätzlich zu den bereits veröffentlichten Maßnahmen werden im Folgenden weitere Erläuterungen gegeben.

### 7.1 Erweiterung von Settlement Party Informationen

Die Erweiterung der Settlement Party Informationen wurde bereits in der [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) im Detail erläutert (Kapitel 7.1.1). Wenn eine OTC-Instruktion im heute gültigen Format übermittelt wird, wird sie auch nach Release-Einsatz nicht abgelehnt. Allerdings werden einige Angaben (z. B. Angaben zum Endbegünstigten) anders abgelegt und daher auch anders im Reporting von CBF dargestellt.

Die beschriebene Änderung betrifft nur OTC-Transaktionen (CASCADE Auftragsarten AA01 und AA02). Die existierenden Prozesse zur Instruktionerteilung und -verarbeitung für CASCADE-RS (MT500/501/510/519) und Vaults (AA16/18) sind davon nicht betroffen.

Für die Cross-Border-OTC-Instruktionen werden die bisherigen Formate aus den Market Guides weiterhin akzeptiert.

#### **Ursprünglicher und in der Vorankündigung zum CBF Release 2014 kommunizierter Ansatz**

Bei OTC-Instruktionen wird zukünftig auch auf der Ebene BUYR/SELL (Endbegünstigter / Original-Auftraggeber) nur noch eine Information abgelegt. Das war in der Vergangenheit bei allen anderen Ebenen bereits der Fall, nun wird diese standardgemäße Verarbeitung auch auf BUYR/SELL ausgeweitet. Sobald eine Instruktion das Feld 97A (Kontoinformation) enthält, wird dieses abgelegt. Ist nur das Feld 95Q/P/R ohne 97A gesendet worden, wird die Information aus 95Q/P/R in den Datenbestand aufgenommen (bis zu 70 Zeichen).

#### **Erweiterter und mit deutschen Marktteilnehmern<sup>2</sup> abgestimmter Ansatz**

CBF wird durch ein entsprechendes Mapping auf der eigenen Nachrichten-Eingangsseite sicherstellen, dass alle relevanten Informationen aus der Endbegünstigten- bzw. Original-Auftraggeber-Ebene (BUYR/SELL Sequenz) auch in den CBF Auftrags-Datenbestand (CASCADE) übernommen werden. Voraussetzung dafür ist, dass die Party-Ebenen REI1/DEI1 und REI2/DEI2 nicht bereits in der vom Kunden gesendeten Eingangsnachricht genutzt wurden.

Dementsprechend kann der CBF-Teilnehmer weiterhin zusätzliche Textinformationen in den ISO<sup>o</sup> 15022-Feldern BUYR und SELL senden wie bisher. Diese werden dann entsprechend der neuen Logik auf die zusätzlichen Party-Ebenen verteilt. Ein möglicher Effekt für den Sender der Nachricht ist, dass er mehr Party-Ebenen in der CBF-Ausgangsnachricht zurückbekommt, als er ursprünglich gesendet hatte.

Aus diesem Grund gab es im CBF-Workshop eine Abstimmung der anwesenden Marktteilnehmer bzgl. der zukünftigen Instruierungsmethodik, die sich in der folgenden Handlungsempfehlung widerspiegelt:

Um die Auswirkungen der neuen Settlement Party Logik auf die automatisierte Verarbeitung von insbesondere Retail-Geschäften zu reduzieren, sollten die Marktteilnehmer nach Möglichkeit darauf achten, dass die Endbegünstigten-Informationen (z. B. Name und Adresse) 70 Zeichen nicht überschreiten. Falls in Ausnahmefällen mehr als 70 Zeichen benötigt werden, so kann dies ebenfalls durch die CBF-Implementierung, wie im Folgenden erläutert, verarbeitet werden. Details zur Instruierung, insbesondere bzgl. Endbegünstigten-Informationen, sollten dann über bilaterale Absprachen zwischen den Marktteilnehmern festgehalten werden.

Die weitere Detailbetrachtung erfolgt anhand der Empfängerseite (BUYR) in einem Domestic-Geschäft. Die gleiche Logik gilt auch für die Lieferseite (SELL). Analog gilt die Mapping-Logik auch für Cross-Border-Geschäfte.

---

<sup>2</sup> CBF-Workshop zur zukünftigen Settlement Party -Verarbeitung am 6. Oktober 2014



### Implementierungsübersicht ohne Angabe einer Niederlassung

Ist das Feld BUYR 95Q mit max. 70 Zeichen (ungleich UNKNOWN) gefüllt und 97A vorhanden, erfolgt ein Mapping in Party-Level 2-3 entsprechend der folgenden Tabelle:

Customer Outbound	CBF Outbound / Customer Inbound		
Incoming Information	Current result	Announced implementation result	Enhanced implementation result
BUYR – 97A	RECU – 97A*	BUYR – 97A	RECU – 97A*
BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q UNKNOWN	BUYR – 95Q Part 1

\* Feld 95Q mit Inhalt UNKNOWN wird per Default Mapping aufgebaut

Ist das Feld BUYR 95Q mit bis zu 140 Zeichen gefüllt und 97A vorhanden, erfolgt ein Mapping in Party-Level 2-4 entsprechend der folgenden Tabelle:

Customer Outbound	CBF Outbound / Customer Inbound		
Incoming Information	Current result	Announced implementation result	Enhanced implementation result
BUYR – 97A	RECU – 97A*	BUYR – 97A	REI1 – 97A*
BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q UNKNOWN	RECU – 95Q Part 1
BUYR – 95Q Part 2	BUYR – 95Q Part 2		BUYR – 95Q Part 2

\* Feld 95Q mit Inhalt UNKNOWN wird per Default Mapping aufgebaut

### Implementierungsübersicht zur Implementierung mit Angabe einer Niederlassung

Ist das Feld BUYR 95Q mit max. 70 Zeichen (ungleich UNKNOWN) gefüllt und 97A vorhanden, erfolgt ein Mapping in Party-Level 2-4 entsprechend der folgenden Tabelle:

Customer Outbound	CBF Outbound / Customer Inbound		
Incoming Information	Current result	Announced implementation result	Enhanced implementation result
RECU – 95R DEBL	RECU – 97A BLZ*	RECU – 97A BLZ*	REI1 – 97A BLZ*
BUYR – 97A	BUYR – 97A	BUYR – 97A	RECU – 97A
BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q UNKNOWN	BUYR – 95Q Part 1

\* Feld 95Q mit Inhalt UNKNOWN wird per Default Mapping aufgebaut

Ist das Feld BUYR 95Q mit bis zu 140 Zeichen gefüllt und 97A vorhanden, erfolgt ein Mapping in Party-Level 2-5 entsprechend der folgenden Tabelle:

Customer Outbound	CBF Outbound / Customer Inbound		
Incoming Information at CBF	Current result	Announced implementation result	Enhanced implementation result
RECU – 95R DEBL	RECU – 97A BLZ*	RECU – 97A BLZ*	REI1 – 97A BLZ*
BUYR – 97A	BUYR – 97A	BUYR – 97A	REI2 – 97A*
BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q UNKNOWN	RECU – 95Q Part 1
BUYR – 95Q Part 2	BUYR – 95Q Part 2		BUYR – 95Q Part 2

\* Feld 95Q mit Inhalt UNKNOWN wird per Default Mapping aufgebaut

#### Verarbeitung der Endbegünstigten-Information bei Anlieferung von ausschließlich Textinformationen

Wird das Feld BUYR 95Q ohne 97A gesendet, werden wie ursprünglich angekündigt, nur max. 70 Zeichen im passenden Level P2 bis 5 abgelegt.

Customer Outbound	CBF Outbound / Customer Inbound		
Incoming Information	Current result	Announced implementation result	Enhanced implementation result
BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q Part 1	BUYR – 95Q Part 1
BUYR – 95Q Part 2	BUYR – 95Q Part 2		

#### Verarbeitung der Endbegünstigten-Information bei Anlieferung von 95Q BUYR UNKNOWN und 97A

Ist das Feld BUYR 95Q mit UNKNOWN gefüllt, wird nur die Information aus 97A im passenden Level P2 bis 5 abgelegt.

Customer Outbound	CBF Outbound / Customer Inbound		
Incoming Information	Current result	Announced implementation result	Enhanced implementation result
BUYR – 97A	RECU – 97A*	BUYR – 97A	BUYR – 97A
BUYR – 95Q UNKNOWN	BUYR – 95Q UNKNOWN	BUYR – 95Q UNKNOWN	BUYR – 95Q UNKNOWN

\* Feld 95Q mit Inhalt UNKNOWN wird per Default Mapping aufgebaut

Das Vorgehen, welches in den obigen Tabellen unter „Enhanced Implementation Result“ beschrieben ist, wird entsprechend während des CBF Release-Wechsels im November 2014 (Migration von schwebenden Transaktionen) zur Anwendung kommen.

In Abstimmung mit dem Kontrahenten können im STP Modus prinzipiell bis zu 140 Zeichen in Namen und Adresse verwendet werden<sup>3</sup>; diese werden gemäß der vorgestellten Zuordnung auf den entsprechenden Party-Levels verteilt. Die Party-Levels 2-5 stehen zur Verfügung. Die Angaben BLZ, Konto, Name und Adresse sollen, entsprechend dieser Reihenfolge, zugeordnet werden. Für die online-Eingabe ergibt sich hieraus die folgende Belegung:

```
01  TRAN: KVEE FC: WE SB:
02
03  AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / SETTL.PTY-ERFASSUNG  ERFASSUNGSSTATUS
04
05          PRIMANOTE: &&&&  AUFTNR: &&&&&&&&&&  WKN: I&&&&&&&&&&&&&&&&&
06
07  SETTL PARTY - LIEFERER
08  P1: _____
09  P2: _____
10  P3: _____
11  P4: _____
12  P5: _____
13
14  SETTL PARTY - EMPFAENGER
15  P1: _____
16  P2: BLZ 50050010
17  P3: KTO 45678
18  P4: TXT Max Mustermann
19  P5: TXT Musterstrasse 12345 Musterstadt
20
21
22  -- ID-KZ: 9999260001 -- PW:      ----- B12345AB -- 06/10/14 -- 10:21:07 --
23
24  PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Neu PF7:Zurück
```

← REI1 – 97A BLZ  
← REI2 – 97A  
← RECU – 95Q Part1  
← BUYR – 95Q Part2

Anhand der Darstellung ist ebenfalls ersichtlich, wie die Informationen den ISO<sup>°</sup> 15022 - Partys zugeordnet werden.

Für die Online-Eingaben im Domestic-Fall gilt generell, dass die Party-Informationen in folgender Reihenfolge – soweit vorhanden – in P2-P5 (beginnend mit P2) einzugeben sind:

- Intermediär 1
- Intermediär 2
- Depotbank
- Endbegünstigter / Original-Auftraggeber

Es dürfen keine Lücken innerhalb der Party-Ebenen entstehen. Daher ist keine feste Zuordnung der Settlement Partys mehr möglich und somit sind die vorhandenen Informationen entsprechend der obigen Reihenfolge direkt nacheinander zu erfassen. Dies bedeutet, dass z. B. für den Fall, dass nur eine Party bekannt ist, diese in P2 zu erfassen ist. Im Fall von Cross-Border-Geschäften gilt diese Logik entsprechend für die Party-Ebenen P1-P5.

<sup>3</sup> CBF verweist an dieser Stelle nochmals auf die Handlungsempfehlung, welche auf S.46 beschrieben ist

Beispiel einer ISO<sup>®</sup> 15022-Nachricht:

Party-Sequenz der CBF-Kunden-Nachricht

```
:16R: SETPRTY  
:95Q: :BUYR//MAX MUSTERMANN ++ Musterstr.13 ++ 99  
      999 Musterstadt  
:97A: :SAFE//KTO-89898  
:16S: SETPRTY  
:16R: SETPRTY  
:95Q: :RECU//FREIER TEXT  
:97A: :SAFE//KTO-12344  
:16S: SETPRTY
```

CBF-Ausgangsnachricht vor der Implementierung (aktuell):

```
:16R: SETPRTY  
:95Q: :RECU//UNKNOWN  
:97A: :SAFE//12344  
:16S: SETPRTY  
:16R: SETPRTY  
:95Q: :BUYR//MAX MUSTERMANN ++ Musterstr.13 ++ 99  
      999 Musterstadt  
:97A: :SAFE//89898  
:16S: SETPRTY
```

CBF-Ausgangsnachricht ursprünglicher/kommunizierter Ansatz mit dem November-Release:

```
:16R: SETPRTY  
:95Q: :RECU//UNKNOWN  
:97A: :SAFE//12344  
:16S: SETPRTY  
:16R: SETPRTY  
:95Q: :BUYR//UNKNOWN  
:97A: :SAFE//89898  
:16S: SETPRTY
```

CBF-Ausgangsnachricht erweiterter Vorschlag für das November-Release (Endbegünstigten-Informationen mit bis zu 70 Zeichen):

```
:16R: SETPRTY
:95Q: :REI1//UNKNOWN
:97A: :SAFE//12344
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95Q: :RECU//UNKNOWN
:97A: :SAFE//89898
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95Q: :BUYR//MAX MUSTERMANN ++ Musterstr.13 ++ 99
      999 Musterstadt
:16S: SETPRTY
```

CBF-Ausgangsnachricht erweiterter Vorschlag für das November-Release (Endbegünstigten-Informationen mit über 70 Zeichen):

```
:16R: SETPRTY
:95Q: :REI1//UNKNOWN
:97A: :SAFE//12344
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95Q: :REI2//UNKNOWN
:97A: :SAFE//89898
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95Q: :RECU// MAX MUSTERMANN-BEISPIELNAME +++ MUSTERSTRASSE.13 ++ 99
      999 MUSTERSTADT-
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95Q: :BUYR//BEISPIELSTADT AM BEISPIELFLUSS
:16S: SETPRTY
```

Generell hat die Änderung der Settlement Party Verarbeitung zur Folge, dass die Kunden für ihre interne Verarbeitung ggf. alle Settlement Party-Felder auswerten müssen, um die für sie relevanten Informationen zu erhalten. Außerdem kann es notwendig werden, die Informationen aus mehreren Party-Feldern zusammenzuführen.

Um sicherzustellen, dass die relevanten Informationen aus den ISO<sup>®</sup> 15022 Settlement Partys in den CBF-Auftrag übernommen werden, wird empfohlen, dass der Wert MSC-NONREF nicht mehr über das ISO<sup>®</sup> 15022-Feld :97A: angeliefert wird. Dies gilt auch für Cross-Border-Geschäfte. Die entsprechenden Market Coverage-Seiten auf der Clearstream Website werden zeitnah angepasst.

## 7.2 Aktivitäten am Migrationswochenende

Einhergehend mit den zuvor beschriebenen Anpassungen erfolgt mit der Implementierung am Samstag, 15.° November 2014 eine systemseitige Anpassung der schwebenden OTC-Transaktionen gemäß der nachstehenden Tabelle (hier: ein Szenario, bei dem alle Party Level gefüllt sind). CBF wird ab dem Umstellungszeitpunkt in seinem Nachrichtenausgang die Informationen ausschließlich in der neuen Party Level Struktur versenden. Die Informationen, die derzeit ggf. als „Name/Adresse“ mit max. 140 Stellen übermittelt wurden, werden in den weiteren Party Levels bereitgestellt. Das bedeutet, dass die Information in maximal zwei nachfolgenden Party Levels mit jeweils 70 Stellen zur Anzeige kommt.

In einigen wenigen Fällen bei Domestic Instruktionen kann die Information aus Name/Adresse mit maximal 70 Stellen übernommen werden. Das ist nur dann zutreffend, wenn alle bestehenden Party Level bereits mit Informationen belegt sind.

Die Änderungen im CASCADE Instruktionsmanagement können Auswirkungen auf die bei den Kunden derzeit hinterlegten Kontrahentendaten („Standing Instructions“) haben. Daher empfehlen wir, mit den jeweiligen Kontrahenten die vereinbarten Informationen der Party- und Textfelder anzugleichen.

Zusätzlich bitten wir Sie, rechtzeitig organisatorische Maßnahmen bzgl. des Instruktionsmanagements in Ihrem Hause abzustimmen.

**Tabelle zur Überleitung von CASCADE-Party Informationen**

Aktuelles CASCADE Feld	Zukünftiges CASCADE Feld Domestic Instruktion	Zukünftiges CASCADE Feld Cross-Border Instruktion
BEGUENSTIGTER DEPOTBANK	EMPFAENGER P(arty)2	EMPFAENGER P(arty)1
BEGUENSTIGTER INTERMED.	EMPFAENGER P(arty)3	EMPFAENGER P(arty)2
BEGUENSTIGTER ENDBEG.	EMPFAENGER P(arty)4	EMPFAENGER P(arty)3
BEGUENSTIGTER NAME/ADRESSE	EMPFAENGER P(arty)5	EMPFAENGER P(arty)4

Die Kunden, die die Settlement Party-Ebenen nach der neuen Logik bestücken, sollten dies entsprechend ab dem 17. November 2014 tun.

## 7.3 Nutzung des Kennzeichen „MSC“

In der [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) wurde bereits in Kapitel 7.1.5 erläutert, dass das Kennzeichen „MSC“ nicht mehr als Identifier in Liefer- und Erhalt-Instruktionen (Auftragsart AA01 und AA02) genutzt werden kann. Das Kennzeichen kann weiterhin gesendet werden. Es gibt jedoch keine gesonderte Verarbeitung mehr in CASCADE, sondern es wird als Kontoinformation abgelegt.

Für die beiden CASCADE Auftragsarten (physische) Einlieferung (AA 16) und (physische) Auslieferung (AA18) ist die Verwendung des Kennzeichens „MSC“ weiterhin innerhalb der Kundenreferenz „MSC-NONREF“ möglich. Dies gilt auch für CASCADE-RS Instruktionen.

## 7.4 Prüfung gegen das BIC-Directory

In Zukunft werden alle angelieferten BICs (DFÜ und online) gegen das aktuelle SWIFT BIC Directory geprüft. Ungültige BICs führen zur Ablehnung der Aufträge. Dies gilt für OTC-Transaktionen (CASCADE Auftragsarten AA01 und AA02), nicht jedoch für CASCADE-RS (MT500/501/510/519) und Vaults (AA16/18) Aufträge.

## 7.5 Änderung in der Nutzung der „Dispo-Priorität“

Die Nutzung der bestehenden CASCADE Dispo-Prioritäten 1 bis 5 wird dahingehend eingeschränkt, dass ab dem 17. November 2014 die Dispo-Priorität 5 („gering“) von Kunden nicht mehr genutzt werden kann. Die Dispo-Prioritäten 1 bis 4 können weiterhin in der bestehenden Form vergeben werden. Die Eingabe einer Dispo-Priorität größer als 4 wird abgelehnt mit der Fehlermeldung „Eingegebener Wert ist nicht zulässig“.

In diesem Zusammenhang wird in den Nachrichtenformaten per SWIFT, MQ Series und File Transfer das **Feld 22F – Priority Indicator** ohne das Data Source Scheme (DSS) „DAKV“ gesendet, da SWIFT mittlerweile den Indikator „PRIR“ fix eingeführt hat.

### Field 22F - Priority Indicator

SWIFT	
Definition:	Execution priority of the instruction
Sequence:	B, Trade Details
Syntax:	:PRIR/ <del>DAKV</del> /4!c (indicator)
CBF USAGE	
Field name:	Priority
Definition:	Indicates the priority given to the instruction in the settlement batch.
Syntax:	4!x
Special note:	<p>The "Priority" field can have the following contents and meanings:</p> <p>'0001' = very high</p> <p>'0002' = high</p> <p>'0003' = medium</p> <p>'0004' = standard</p> <p><del>'0005'</del> = <del>low priority within one priority group</del></p> <p>Default: '0004'</p>

Die Änderung des Prioritäten Indicators gilt auch für die Datenformate anderer Settlement Nachrichten.

## 7.6 TEFRA D - Abschaffung der Funktionalität „Freigabe an Dritte“

Wie bereits in den T2S Task Force Unterlagen vom 27. August 2014 beschrieben, wird der Service zur Freigabe an Dritte von TEFRA D Geschäften abgeschafft. Somit können die Freigabe-Instruktionen nur noch „Free of Payment“ (FoP) gesendet werden und GUT-KTO sowie LAST-KTO müssen dem gleichen Kontostamm angehören (Bsp.: 9999 000 an 9999 671).

## 7.7 Mögliche weitere Sequenz in Settlement Nachrichten für GC-Pooling Aufträge

Bei GC-Pooling Aufträgen wird heute von CASCADE

- die Institution Reference und
- die Depot Reference

per Default in den Feldern Party 2 und Party 3 gesetzt.

Fehlt eine dieser Referenzen, kann sich eine Lücke in den „Settlement Parties“ ergeben, was laut aktuellem SWIFT-Standard nicht mehr zulässig ist. Deshalb muss ab dem CBF Release November 2014 bei GC-Pooling Aufträgen in Fällen bei denen die Drittbank nicht mitgegeben wurde, eine weitere Party-Ebene eingefügt werden. Je nachdem, auf welcher Seite (DECU/RECU) der Kunde steht, füllt CASCADE diese Party-Ebene wie im folgenden Beispiel erläutert (hier für die DECU- Seite) in den Settlement Confirmation Nachrichten und im Clearing&Settlement (C&S) Statement (MT536) auf.

<b>:16R: SETPRTY</b>
<b>:95Q: :DECU//UNKNOWN</b>
<b>:97A: :SAFE//MSC-NONREF</b>
<b>:16S: SETPRTY</b>

## 7.8 Änderungen bei CASCADE Online-Masken

### 7.8.1 Hintergrund der Änderungen

In der [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) wurden bereits in Kapitel 7.2 umfangreiche Erweiterungen in den CASCADE Online-Masken erläutert.

Die Änderungen betreffen eine Reihe von Masken und sind durch die Anpassung bestehender Felder bzw. durch Hinzufügen neuer Felder innerhalb der T2S-Vorgaben bedingt. Im Einzelnen lassen sich folgende Fälle unterscheiden:

- Felder werden zwar angezeigt, können aber nicht gefüllt werden.  
Dabei handelt es sich um Felder, die erst mit der Migration von CBF auf T2S relevant werden, beispielsweise den Indikator für „Partial Settlement“.  
Es sind alle Masken betroffen, in denen Auftragsdaten eingegeben, geändert oder angezeigt werden.
- An prominenter Stelle ist die BIC den Anzeigen von Last- und Gut-Konto hinzugefügt. Allerdings ist das Feld bis zur Migration auf T2S nicht eingebbar, wird aber angezeigt. Last- und Gut-Konto werden nur noch mit „LAST“ und „GUT“ beschrieben, ohne die bisher folgenden Buchstaben „KTO“.  
Es sind alle Masken betroffen, in denen die vom Auftrag betroffenen CASCADE-Konten angezeigt werden.
- Eingabe und Verarbeitung von Feldern ändern sich ab dem 17. November 2014. Das gilt nur für die fünf Party Level Felder, deren Handhabung detailliert im Kapitel [7.1](#) dieses Dokuments beschrieben wird.  
Es sind alle Masken betroffen, in denen Endbegünstigten-Daten angezeigt werden.

### 7.8.2 Details zu neuen und geänderten Feldern

Die Transaktion KVEE – Erfassungsstatus – spiegelt die durch T2S-induzierten Änderungen fast vollständig wider. Daher werden in der folgenden Tabelle die Änderungen auf dieser Maske unterhalb der verschiedenen Funktions-Codes im Detail beschrieben.



Feld Name	Maske	Beschreibung
LAST	Alle	Der BIC kann nicht eingegeben werden, nur das CASCADE-Konto. Wenn das CASCADE-Konto 4-stellig eingegeben wird, wird mit "000" ergänzt. Der BIC wird angezeigt, wenn er in CASCADE abgelegt ist. Eingabe wird durch CBF in 2015 erfolgen. Cross Border Instruktionen müssen weiterhin mit Spiegel- oder Omnibuskonten eingegeben werden.
GUT	Alle	Der BIC kann nicht eingegeben werden, nur das CASCADE-Konto. Wenn das CASCADE-Konto 4-stellig eingegeben wird, wird mit "000" ergänzt. Der BIC wird angezeigt, wenn er in CASCADE abgelegt ist. Eingabe wird durch CBF in 2015 erfolgen. Cross Border Instruktionen müssen weiterhin mit Spiegel- oder Omnibuskonten eingegeben werden.
DISPO-PRIORITÄT	KVEE/WE - Einzelerfassung KVEE/MI – Match- Instruktion	Gültige Werts sind '1' to '4' in Übereinstimmung mit den T2S-Vorgaben, siehe auch Kapitel <a href="#">7.4</a> dieses Dokuments
DCA/CSA	KVEE/WE KVEE/MI	Nur Anzeige, keine Eingabe möglich
BATM/ADEA	KVEE/WE KVEE/MI	Nur Anzeige, keine Eingabe möglich
OPT-OUT	KVEE/WE KVEE/MI	Nur Anzeige, keine Eingabe möglich
AUFTRAGS REFERENZ	KVEE/WE KVEE/MI	Nur Anzeige, keine Eingabe möglich
ALREADY MATCHED	KVEE/WE KVEE/MI	Nur Anzeige, keine Eingabe möglich
PARTIAL SETTL INDICATOR	KVEE/WE KVEE/MI	Nur Anzeige, keine Eingabe möglich
ISO TRANSACTION CODE	KVEE/WE KVEE/MI	Nur Anzeige, keine Eingabe möglich
P1	KVEE/WE KVEE/MI	<u>Innerdeutsches Geschäft:</u> Das SAC wird angezeigt, wenn es in CASCADE hinterlegt ist. Ist das nicht der Fall, bleibt das Feld leer. <u>Cross border-Geschäft:</u> Beide Felder können, nur eines sollte gefüllt werden, siehe auch Kapitel <a href="#">7.1</a> .

Feld Name	Maske	Beschreibung
P2-P3	KVEE/WE KVEE/MI	<u>Innerdeutsches Geschäft:</u> Eingabe ist immer optional. Alle derzeit genutzten Identifikationsfelder (KTO, BIC, und BLZ) sind weiterhin gültig. <u>Cross border –Geschäft:</u> Kann- oder Muss-Feld, abhängig vom betroffenen Markt (Die Prüfungsprozesse der Identifikationsfelder (KTO; BIC, BLZ) bleiben unverändert.)
P4-P5	KVEE/WE KVEE/MI	Eingabe immer optional. Alle derzeit genutzten Identifikationsfelder (KTO, BIC und BLZ) sind weiterhin gültig.

Die in der obigen Tabelle angegebenen Änderungen gelten auch für die anderen Ausprägungen von KVEE:

- KVEE/BV – Bestandsübertrag
- KVEE/DV - Depotübertrag
- KVEE/LE/BE – LSV/BSV-Übertrag
- KVEE/WM - Mehrfacherfassung
- KVEE/TD – TEFRA D Übertrag
- KVEE/UT- Umtausch
- KVEE/RT - Rücktausch
- KVEE/OT -Optionsschein-Trennung
- KVEE/OZ- Optionsschein-Zusammenführung
- KVEE/SA – Bondstripping-Aufteilung
- KVEE/SZ – Bondstripping-Zusammenführung

Die folgenden Masken zum Bearbeiten und Beauskunften von Auftragsdaten sind ebenfalls entsprechend der obigen Tabelle betroffen, das gilt für alle Funktions-Codes:

- KVEA – Änderung/Löschung - alle Funktions-Codes
- KVEI – Information - alle Funktions-Codes
- KVEK – Kontrolle Girobereich - alle Funktions-Codes

Die geänderte Darstellung von Aufträgen wirkt sich ebenso auf die Maske KVAI – Auftragsstatus – aus. Ein Beispiel zu dieser Maske wird im folgenden Kapitel [7.3](#) gegeben.

Die folgenden, verwandten Masken sind entsprechend KVAI betroffen. Die Änderungen sind relevant für alle Funktions-Codes.

- KVAS - Auftragsabwicklung: Settlement-Dienst
- KVAA – Änderung/Löschung

Bei der Anzeige gebuchter Geschäfte auf KVDU – Umsatzanzeige - werden die oben dargestellten Änderungen ebenfalls reflektiert, wiederum gilt das für alle Funktions-Codes. Ein Beispiel für KVDU wird im folgenden Kapitel gegeben.

## 7.8.3 Beispiele der geänderten Masken

### 7.8.3.1 KVEE/WE -Erfassungsstatus Einzelerfassung

In den folgenden drei Masken wird die Eingabe eines Übertrages gegen EUR dargestellt.

```
01 TRAN: KVEE FC: WE SB:
02
03 AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
04
05 PRAMANOTE: _____ AUFTNR: 666668____ VWA: GS      TR: _
06
07 LAST      : 1234000_____ /
08 GUT       : 5678000_____ /
09 WKN      : w 840400_____
10
11 NOMINALE : 1 _____ EINHEIT:      DISPO-PRIORITAET: 4 MST
12 GEGENWERT: _____ WRG      : EUR      PARTY-HOLD (J/N): N
13 DCA/REF  : _____ EMISS-EINF (J/N): N
14
15 SET-DAY  : 25.09.2014    EX-TRD  : _      BATM/ADEA (J/N): N
16 BOERSENPL: _____ OPT-OUT:  _      RTS-DVP   (J/N): N
17
18 SCHLUSSTAG: 24.09_____ REFERENZ-NR      : _____
19 KURS / WRG: _____ AUFTRAGS-REFERENZ: _____
20                                     GEGEN-AUFTNR    : _____
21
22 -- ID-KZ: 7930260001 -- PW:      ----- B79304KV -- 25/09/14 -- 09:53:23 --
23
24 PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Neu
```

```
01 TRAN: KVEE FC: WE SB:
02
03 AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG-2      ERFASSUNGSSTATUS
04
05 PRAMANOTE: _____ AUFTNR: 666668      WKN: I DE0008404005
06
07 UEB-GRUND : _____
08
09 EXT SET-DAY: _____ RUECKUEBERTRAG (J/N) : N
10 ALREADY MATCHED (J/ ) : _____ PARTIAL SETTL.INDICATOR: _____
11 ISO TRANSACTION CODE : _____
12
13 BELEGSCHAFT-SP: N      SP-DATUM: _____
14 KUPONINFO/RECORD-DATE: _____
15
16
17
18
19 TEXT: _____
20
21
22 -- ID-KZ: 7930260001 -- PW:      ----- B79304KV -- 25/09/14 -- 09:53:23 --
23
24 PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Neu PF7:Zurück PF8:Vor
```

```
01 TRAN: KVEE FC: WE SB:
02
03 AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / SETTL.PTY-ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
04
05          PRIMANOTE:          AUFTNR:      666668      WKN: I DE0008404005
06
07 SETTL-PARTY - LIEFERER
08 P1: _____
09 P2: _____
10 P3: _____
11 P4: _____
12 P5: _____
13
14 SETTL-PARTY - EMPFAENGER
15 P1: _____
16 P2: _____
17 P3: _____
18 P4: _____
19 P5: _____
20
21
22 -- ID-KZ: 7903060001 -- PW:          ----- B79304KV -- 25/09/14 -- 09:53:23 --
23
24 PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück
```

### 7.8.3.2 KVAI - Auftragsstatus

Die folgenden Masken zeigen das im vorherigen Kapitel eingegebene Geschäft in der Widergabe in KVAI.

```

01  TRAN: KVAI FC: AA SB: 01##1234#I###25.09.2014#
02
03  AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / INFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
04
05  AUFTNR      :      666668
06
07  LAST       : 1234 000      TEST BANK AG      /
08  GUT        : 5678 000      BANK AG          /
09  WKN         : I DE0008404005 ALLIANZ SE VNA O.N.
10
11  NOMINALE   :              1      EINHEIT: EO      DISPO-PRIORITAET: 4 MST
12  GEGENWERT :              WRG      :      VWA          : GS  SVG
13  DCA/REF    :
14  SET-DAY    : 25.09.2014      EX-TRD      :      BATM/ADEA : N
15  BOERSENPL :              OPT-OUT:      RTS-DVP      : N
16
17  MATCH-STATUS : 01 MATCHING OFFEN; KEINEN GEGENAUFTRAG GEFUNDEN
18  PRYHLD-STATUS: 0 AUFTRAG ZUR DISPOSITION FREIGEgeben
19  DISPO-STATUS : 4 ABGELEHNT; GEGENSEITE FEHLT
20
21
22  -- ID-KZ: 7930260002 -- PW:      ----- B79304K8 -- 25/09/14 -- 09:55:00 --
23
24  PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF8:Vor

```

Feldname	Beschreibung
LAST	LAST-KTO umbenannt zu LAST
GUT	GUT-KTO umbenannt zu GUT
DCA/REF	Neue Felder, keine Eingabe und keine Anzeige von Daten
BATM/ADEA	
PRYHLD-STATUS	SET-STATUS umbenannt zu PRYHLD-STATUS. Die folgenden Ausprägungen sind möglich: 0 FREIGEgeben 1 GESPERRT AUFTRAGGEBER 2 GESPERRT EMPFAENGER 3 GESPERRT BEIDE SEITEN
PF5:Info	Neue Funktionstaste, führt direkt zur Maske Status Information

## KVAI/AA – Folgemaske

```

-- TRAN: KVAI FC: AA SB: 01##1234#I####
02
03 AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / INFORMATION-2      AUFTRAGSSTATUS
04
05 AUFTNR:      666668      WKN: I DE0008404005
06
07 T2S ACTOR BIC:          T2S ACTOR REF      :
08 ALREADY MATCHED      :          MITI REF      :
09 REFERENZ-NR      :          AUFTRAGS-REFERENZ:
10 ALREADY MATCHED      :          PARTIAL SETTL IND:
11 ISO TRANSACTION CODE :          REASON CODE      :
12
13 SCHLUSSTAG      : 24.09.2014      KURS / WRG      :
14 EXT SET-DAY      :          GEGEN-AUFTNR      :
15 UEB-GRUND      :
16 URSPR-NOM      :          RUECKUEBERTRAG      : N      TR:
17 BELEGSCHAFTS-SP: N          SP-DATUM      :
18 KUPONINFO/RECORD-DATE:
19
20
21 TEXT:
22 -- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ----- B79304K8 -- 25/09/14 -- 09:55:00 --
23
24 PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück  PF8:Vor

```

### Neue Felder

Feldname	Beschreibung
T2S ACTOR BIC	Neue Felder, keine Eingabe und keine Anzeige von Daten
T2S ACTOR REF	
MITI REF	
ALREADY MATCHED	
PARTIAL SETTL IND	
ISO TRANSACTION CODE	
REASON CODE	

### KVAI/AA – Settlement Party Information – Maske 3

```
01 TRAN: KVAI FC: AA SB: 01##1234#I####
02
03 AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / SETL.PTY-INFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
04
05 AUFTNR:      666668      WKN: I DE0008404005
06
07 SETTLE-PARTY - LIEFERER
08 P1:
09 P2:
10 P3:
11 P4:
12 P5:
13
14 SETTLE-PARTY - EMPFAENGER
15 P1:
16 P2:
17 P3:
18 P4:
19 P5:
20
21
22 -- ID-KZ: 7930260002 -- PW:      ----- B79304K8 -- 25/09/14 -- 09:55:00 --
23
24 PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück
```

Betätigen von PF5 verzweigt zur folgenden Maske KVAI/AA – Status Information. Das ist eine neue Maske.

```

01  TRAN: KVAI FC: AA SB: 01##1234#I###
02
03  AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / STATUS INFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
04
05  AUFTNR:      666668      WKN: I DE0008404005
06
07  STATUSART      AKT.      BESCHREIBUNG      BEANTR  BEARBEITUNGS
08                STATUS      STATUS      STATUS      STATUS
09  PARTY HOLD-STATUS : 0      FREIGEGEREN
10  LOESCH-STATUS   : 0      KEINE LOESCHANFRAGE
11  DISPO-PRIORITAET : 4      NORMALE PRIORITAET
12  PARTIAL SETTL IND :
13
14
15  CSD HOLD-STATUS : 0      FREIGEGEREN
16  CSD VALHOLD-STATUS: 0      FREIGEGEREN
17      RULE-ID :
18  CoSD HOLD-STATUS : 0      FREIGEGEREN
19      RULE-ID1:
20      RULE-ID2:
21
22  -- ID-KZ: 7930260002 -- PW:      ----- B79304K8 -- 25/09/14 -- 09:55:00 --
23
24  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch

```

Diese Maske liefert Informationen zu Status von Änderungen und Löschungen auf der T2S-Plattform, sie wird also erst im September 2016 vollständig genutzt werden. Ab dem 17. November 2014 wird die Maske wie folgt genutzt:

Feldname	Beschreibung
AKT.STATUS	Zeigt den gegenwärtigen Wert/Status
BESCHREIBUNG	Kurze Beschreibung des gegenwärtigen Wertes/Status
BEANTR STATUS & BEARBEITUNGS STATUS	Neue Felder, keine Eingabe und Anzeige von Daten
PARTY HOLD-STATUS	Identische mit dem Status in Maske 1
LOESCH-STATUS	Für innerdeutsche Geschäfte wird "0 KEINE LOESCHANFRAGE" angezeigt
DISPO-PRIORITAET	Identische mit der Priorität in Maske 1
PARTIAL SETTL IND	Neues Feld, keine Eingabe und Anzeige von Daten
CSD HOLD-STATUS	Neues Feld, nur eine Standardanzeige: " 0 FREIGEGEREN ")
CSD VALHOLD-STATUS	
CoSD HOLD-STATUS	
RULE-ID RULE-ID1 RULE-ID2	Neue Felder, keine Eingabe und Anzeige von Daten



Die folgende Maske zeigt eine Match-Instruktion. Es werden die gleichen Änderungen wie oben dargestellt wirksam; zusätzlich wird das Feld Dispo-Status angezeigt, das in der heutigen Maske nicht existiert.

```
01  TRAN: KVAI FC: AA SB: 02###W#840400#5678#25.09.2014#
02
03  AUFTRAGSABWICKLUNG  MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION          AUFTRAGSSTATUS
04
05  AUFTNR      :      666669
06
07  LAST       : 1234 000          TEST BANK AG                /
08  GUT        : 5678 000          BANK AG                /
09  WKN        : I DE0008404005 ALLIANZ SE VNA O.N.
10
11  NOMINALE   :                  1          EINHEIT: ST          DISPO-PRIORITAET: 4 MST
12  GEGENWERT :                  WRG      :          VWA          : GS  GS,
13  DCA/REF    :                  EMISS-EINF: N
14  SET-DAY    : 25.09.2014          EX-TRD  :          BATM/ADEA : N
15  BOERSENPL :                  OPT-OUT :          RTS-DVP   : N
16
17  MATCH-STATUS : 01 MATCHING OFFEN; KEINEN GEGENAUFTRAG GEFUNDEN
18  PRTYHLD-STATUS: 0 AUFTRAG ZUR DISPOSITION FREIGEgeben
19  DISPO-STATUS : 4 ABGELEHNT, GEGENSEITE FEHLT
20
21
22  -- ID-KZ: 7930260002 -- PW:          ----- B79304K8 -- 25/09/14 -- 14:10:02 --
23
24  PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF8:Vor
```

### 7.8.3.3 KVDU - Umsatzanzeige

```

01  TRAN: KVDU FC: ID SB: 25.09.2014#####W#840400#####L#1234#####
02
03  UMSATZANZEIGE                DEPOTUMSAETZE - VOLLANZEIGE
04
05  Auftr-Art: 01  WP-UEBERTRAG                Umsatzart: Last
06
07
08  Eingeber   :      7907          Buchung  C2F1          am 25.09.2014 um 10:28:10 Uhr
09  Auftr-Nr   :      666668
10
11  Konto     : 1234 000          TEST BANK AG          /
12  Wg Ndl    :
13  DCA/REF   :
14  Kontrah   : 5678 000          BANK AG                /
15  Wg Ndl    :
16  DCA/REF   :
17  WKN/ISIN  : I DE0008404005 ALLIANZ SE VNA O.N.
18
19  Nominale  :                  1-          Einheit : ST          Verwahrart: GS
20  Gegenwert:                  Waehrung:          Set-Day   : 25.09.2014
21  MITI Ref1:                  MITI Ref2:
22  -- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ----- B79304KV -- 25/09/14 -- 10:41:10 --
23
24  PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF9:Auftrag

```

Feldname	Beschreibung
DCA/REF	Neue Felder, keine Eingabe und Anzeige von Daten
DCA/REF	
MITI Ref1	
MITI Ref2	

```

01 TRAN: KVDU FC: ID SB: 25.09.2014#####W#840400#####L#1234#####
02
03 UMSATZANZEIGE                WP-UEBERTRAG                AUFTRAGSVOLLANZEIGE
04
05 Auftnr      :      666668
06
07 Last       : 1234 000      TEST BANK AG                /
08 Gut        : 5678 000      BANK AG                    /
09 WKN/ISIN   : I DE0008404005 ALLIANZ SE VNA O.N.
10
11 Nominale   :                1      Einheit   : ST      Dispo-Prioritaet: 4 MST
12 Gegenwert :                WRG      :                VWA      : GS GS,
13 Set-Day    : 25.09.2014      Emiss-Einf   : N
14 Boersenpl :                EX-TRD   :      BATM/ADEA   : N
15 ISO Transaction Code:      OPT-OUT   :      RTS-DVP    : N
16
17
18
19
20
21
22 -- ID-KZ: 7930260001 -- PW:                ----- B79304KV -- 25/09/14 -- 10:42:16 --
23
24 PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF8:Vor PF9:Umsatz

```

Feldname	Beschreibung
ISO Transaction code	Neue Felder, keine Eingabe und Anzeige von Daten
OPT-OUT	
BATM/ADEA	

```

01  TRAN: KVDU FC: ID SB: 25.09.2014#####W#840400#####L#1234#####
02
03  UMSATZANZEIGE                WP-UEBERTRAG                FOLGEINFORMATION
04
05  Auftnr:      666668          WKN: I DE0008404005
06
07  T2S Actor BIC:                T2S Actor Ref      :
08  MITI REF      :
09  Referenz-Nr:                Auftrags-Referenz:
10  Already matched(J/N) :      Partial Settl Indicator:
11
12  Schlusstag : 24.09.2014      Kurs / Wrg :
13  Ext Set-Day:
14  Ueb-Grund  :
15  Urspr-Nom  :                Rueckuebertrag: N      Tr:
16  Belegschafts-Sp: N          Sp-Datum:
17  Kuponinfo/Record-Date:
18
19
20
21  TEXT      :
22  -- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ----- B79304KV -- 25/09/14 -- 10:42:34 --
23
24  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor  PF9:Umsatz

```

Feldname	Beschreibung
T2S Actor BIC	Neue Felder, keine Eingabe und Anzeige von Daten
T2S Actor Ref	
MITI Ref	
Already matched	
Partial Settl Indicator	

```

01 TRAN: KVDU FC: ID SB: 25.09.2014#####W#840400#####L#1234#####
02
03 UMSATZANZEIGE                WP-UEBERTRAG                SETTLEMENT PARTY
04
05 Auftnr:      666668          WKN: I DE0008404005
06
07 SETTTL-PARTY - Lieferer
08 P1:
09 P2:
10 P3:
11 P4:
12 P5:
13
14 SETTTL-PARTY - Empfaenger
15 P1:
16 P2:
17 P3:
18 P4:
19 P5:
20
21
22 -- ID-KZ: 7930260001 -- PW:          ----- B79304KV -- 25/09/14 -- 10:42:52 --
23
24 PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor  PF9:Umsatz

```

## 7.8.4 Änderungen beim Reporting

Die folgenden Reports werden aus Masken-Daten erzeugt, daher ändert sich das Erscheinungsbild dieser Druckdateien entsprechend der oben dargestellten Neuerungen.

- Von CBF Gelöschte Aufträge Löschung wegen Fristablauf (KVEE)
- Liste der Aufträge, die nach 40 Tagen gelöscht wurden (KVAI)
- Vom Eingabe gelöschte Aufträge (KVAI)
- Depotbestandliste (KVAB)
- Änderungshistorie Aufträge Auftragsstatus (KVAI AA & HA)

Die oben und im Kapitel [7.1](#) dargestellten Änderungen beim Speichern und Ausweisen von Settlement Parties wirken sich auf die folgenden Reports aus, die ansonsten unverändert bleiben:

- Bisher ohne Freigabe an Clearstream Bank, Frankfurt
- An CBF Gültig erteilte Aufträge
- An CBF Gültig erteilte Aufträge Hist.
- Vom CBF zum ersten/zweiten Mal gewarnte Aufträge Löschung erfolgt am XX.XX.XXXX abends

Zurzeit werden auf diesen Reports die Felder „BEGUENST. DEPOTBANK“, „ENDBEGUENSTIGTER“, „AUFTRAGG. DEPOTBANK“, „ORIG-AUFTRAGGEBER“ angezeigt. Ab dem Release-Einsatz werden die Felder „BEGUENSTIGTER“ und „AUFTRAGGEBER“ entsprechend der Änderungen in den CASCADE-Masken in „Delivering and Receiving Settlement Parties“ (Lieferer und Empfänger) umbenannt.

Im folgenden Beispiel sind diese Änderungen dargestellt.

„Bisher ohne Freigabe an Clearstream Banking, Frankfurt“ - Neues Format

1 2 3 4 5 6 7 8  
12345678901234567890123456789012345678901234567890123456789012345678901234567890

BISHER OHNE FREIGABE AN CLEARSTREAM BANKING, FRANKFURT 27.11.2014 SEITE : 5  
LOESCHUNG ERFOLOGT AM 28.11.2014 ABENDS

AUFTRAGSART 01 WP-UEBERTRAG  
PNOTE AUFTR-NR LAST-KTO GUT-KTO WKN NOMINALE GEGENWERT WRG  
R-DVP USER-ID USER-ID UHRZT SP-DATUM REFERENZ-NR SET-DAY AA  
ERFASSER KONTROLLE KONTR  
SET.PTY-LIEFERER P1 SET.PTY-LIEFERER P2 SET.PTY-EMPFAENG P1 SET.PTY-EMPFAENG P2

888 2070011 1234 000 5678 000 DE0006283302 1000000.000 12345.678.901,23 EUR  
N 1234260003 REFERENZNUMMER 8 26.11.14 W  
KTO 1234000 BLZ 90090900 KTO 5678000 BLZ 80080800

SUMMEN WP-UEBERTRAG  
ANZAHL 1 NOMINALE 1.000.000.000 GEGENWERT 12345.678.901,23  
SUMMEN ALLER AUFTRAGSARTEN  
ANZAHL 1 NOMINALE 1.000.000.000 GEGENWERT 12345.678.901,23

Die neue Darstellung der Settlement Parties wird ebenfalls in diesem Beispiel deutlich:

„Avis zu WP-Übertrag“ – Neues Format

1 2 3 4 5 6 7 8 9  
12345678901234567890123456789012345678901234567890123456789012345678

»  
CLEARSTREAM BANKING AG VALUTA : 28.11.2014  
AVIS ZU WP-UEBERTRAG AUFTR-NR: 110322  
WIR HABEN VERANLASST, DASS IHREM SAMMELBESTAND HEUTE FOLGENDE WERTPAPIERE  
GUTGESCHRIEBEN WERDEN:  
GUT-KTO: 1234 TESTBANK AG /  
WKN: I DE000A0M6TQ3 UBS (D) PORTFOLIO I (EUR)  
EINHEIT: ST NOMINALE: 100  
WRG: EUR GEGENWERT: 11.123,98  
SCHLUSSTAG: 27.11.2014 MI-NR: 46666  
SETTL PARTY LIEFERER  
P1:  
P2:KTO 445566  
P3:  
SETTL PARTY EMFAENGER  
P1:  
P2:KTO 556677  
P3:  
LAST-KTO: 5678 BANK AG /  
»

## 7.9 CASCADE-PC – Neue Version 8.0: Erweiterung der CASCADE-PC online Masken

Mit dem Release am 17. November 2014 setzt Clearstream Banking die CASCADE-PC Version 8.0 ein. Diese neue Version muss von allen teilnehmenden Instituten ab diesem Zeitpunkt installiert sein.

**Hinweis:** Bis einschließlich 14. November 2014 ist noch die Version 7.9 zu benutzen.

Die Software der CASCADE-PC Version 8.0 wird ab dem 3. November 2014 auf der Clearstream Website unter folgendem Pfad für registrierte Nutzer zum Download bereitgestellt:

CASCADE-PC Software Download, Benutzer- und Installationshandbücher:

- [http://www.clearstream.com/Clearstream/ Products and Services / Connectivity / CASCADE / CASCADE Online](http://www.clearstream.com/Clearstream/Products%20and%20Services/Connectivity/CASCADE/CASCADE%20Online)
- Oder direkt via <http://www.clearstream.com/cascadepc>

Aufgrund der Einführung der Party Level Felder für Kontrahentenangaben in OTC-Instruktionen und anderer T2S-relevanter Felder, die bereits jetzt in Vorbereitung auf TARGET2-Securities (T2S) eingesetzt werden, werden auch die entsprechenden Eingabe- und Informationsmasken in CASCADE-PC angepasst.

In den folgenden Beispielmasken sind jene Felder rot markiert, die zwar in das Masken-Layout aufgenommen wurden, aber bis zur Migration von CBF auf T2S nicht aktiviert sind. Die Felder, die bereits ab dem 17. November 2014 genutzt werden können (Party Level Felder), sind in grün markiert:

### Beispiel: Erfassung KVEE-WE (Seite 1):

The screenshot displays the 'CASCADE - PC Wertpapierübertrag Erfassung' window. The form includes the following fields and controls:

- Yellow highlights (Active):** Auftragsnummer, Primarnote, ISIN, Nominale, Einheit, Gegenwert, Settlement-Day, Börsenplatz, Ex-Trade, Schlusstag, and the Party-Hold checkbox.
- Red highlights (Not Active):** Last, Gut, DCA/REF, BATH/ADEA, Opt-Out, and RTS-DvP.

Buttons at the bottom: Verarbeitung, Prüfen, Abbruch.

Status bar: Version 8.0 Beta, 7999260001, A KVEE WE, 10.09.14 12:54:22

## Beispiel: Erfassung KVEE-WE (Seite 2):

**CASCADE - PC Wertpapierübertrag Erfassung: Weitere Daten**

Fenster Hilfe

Auftragsnummer:  Primarnote:

Verwahrt:

Referenznummer:   Emissionseinführung

Kurs:

Disponibilität:

Ext. Settlement Day:   Rückübertrag

Already Matched:  Partial Settlement Indicator:

ISO Transaction Code:

Auftragsreferenz:  Teilrechte:

Kupon-Information/Record-Date:  Gegen-Auftragsnummer:

Grund Übertrag:

WKN des Rechts:

Ex-Tag/Beginn:  KE-Datum:

Belegschaftssperre Sperr-Datum:

Text:

Version 8.0 Beta 7999260001 A KVEE WE 10.09.14 12:54:22



### Beispiel: Erfassung KVEE-WE (Seite 3):

The screenshot shows a software window titled "CASCADE - PC Wertpapierübertrag Erfassung: Settlement-Party". At the top, there are two input fields: "Auftragsnummer:" and "Primernote:". Below these are two main sections, each enclosed in a light green border. The first section is titled "Settlement-Party - Lieferer" and contains five rows labeled P1 through P5. Each row has a dropdown menu and a text input field. The second section is titled "Settlement-Party - Empfänger" and also contains five rows labeled P1 through P5, each with a dropdown menu and a text input field. At the bottom of the window are two buttons: "OK" and "Abbruch". The status bar at the very bottom displays "Version 8.0 Beta", "7999260001", "A KVEE WE", and "10.09.14 12:54:22".

Außerdem wurde auf dem Auswahlschirm zur Änderung von Instruktionen eine neue Funktion aufgenommen, die jedoch erst nach der Migration auf T2S genutzt werden kann.

## Beispiel: Erfassung KVAA-AA:

CASCADE - PC Auswahl Auftragsbestand Änderung / Löschung

Fenster Hilfe

Auswahl

- Markierung zur Änderung
- Markierung zur Löschung
- Markierung zur Änderung eines Auftrags für Partial Settlement Indicator und Dispo-Priorität

Auftragsnummer:

OK Abbruch

Version 8.0 Beta 7999260001 A KVAA AA 10.09.14 15:07:21

Detaillierte Informationen darüber, wie die jeweiligen Felder zu füllen sind bzw. welche Inhalte aus SWIFT und File Transfer Instruktionen in diese Felder übernommen werden, wurden bereits in den Vorabinformationen veröffentlicht.

## 8. Kundensimulation CBF Release im November 2014

Die CBF Simulationsumgebung im IMS23 steht den Kunden kontinuierlich zur Verfügung. Detailinformationen zur Nutzung der Testumgebung finden sich im [CASCADE Testing and Simulation Guide](#) auf der Clearstream Website.

Generell können ab dem 20. Oktober 2014 auch die T2S relevanten Änderungen in der CASCADE Simulationsumgebung IMS23 mit der neuen Release Version November 2014 getestet werden. Dabei sind hinsichtlich der beiden Themen „Migration von schwebenden CASCADE OTC-Instruktionen“ und „TEFRA D Freigaben“ noch wichtige Details zu beachten, die in den beiden folgenden Kapiteln erläutert werden.

Für weitere Informationen oder Fragen zur CASCADE Simulationsumgebung IMS23 kontaktieren Sie bitte das Test Team:

E-Mail: [cascade-testing@clearstream.com](mailto:cascade-testing@clearstream.com)

Telefon: +49 (0)69 211 11188

Fax: +49 (0)69 2116 11188

Bitte beachten Sie auch, dass die CASCADE Simulationsumgebung generell mit oder ohne Unterstützung des Clearstream Test Teams genutzt werden kann.

Kunden, die über mindestens zwei CBF-Hauptkonten verfügen, können eigenständig durch Eingabe der relevanten Instruktionen für diese Konten sowohl die Liefer- als auch die Erhaltseite simulieren. Es besteht auch die Möglichkeit, zusammen mit anderen Kunden in der CASCADE Simulationsumgebung selbständig zu testen.

Das CASCADE Test Team unterstützt Kunden auch gerne beispielsweise bei der Eingabe der Instruktionen für den Kontrahenten (Liefer-/Erhaltinstruktion) oder bei der Erstellung von Beständen in bestimmten Gattungen. Dabei ist die Anzahl der einzugebenden Instruktionen für den Kontrahenten durch das Test Team pro Kunde auf maximal 10 begrenzt. Die gleiche Anzahl gilt pro Kunde auch für die zu erstellenden Bestände für eine ISIN. Mit dieser Vorgehensweise soll ein permanenter und adäquater Service Level sichergestellt werden.

### 8.1 Simulation des Migrationswochenendes in der CASCADE Simulationsumgebung

In Kapitel 7.2 „Aktivitäten am Migrationswochenende“ des Dokuments [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#) wurde bereits über die Anpassung von schwebenden CASCADE Wertpapierüberträgen während des produktiven Migrationswochenendes informiert. Diese Anpassung wird notwendig aufgrund der Änderungen insbesondere in den Settlement Party Informationen im Rahmen des Instruktionsmanagements (siehe auch [„CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen“](#), Kapitel 7.1).

In der CASCADE Simulationsumgebung IMS23 haben Kunden einmalig die Möglichkeit, diese Migration von schwebenden CASCADE Wertpapierüberträgen wie folgt zu testen:

- Bis zum 15. Oktober 2014 können Instruktionen in die CASCADE Simulationsumgebung eingegeben bzw. gesendet werden analog der heutigen CASCADE Produktionsumgebung
- Zwischen dem 16. und 19. Oktober 2014 wird die neue Release Version November 2014 in die CASCADE Testumgebung IMS23 übernommen. Offene CASCADE Instruktionen in der Testumgebung IMS23 werden dabei ebenfalls automatisch in die neue Release Version migriert. Die Simulationsumgebung ist am 16. und 17. Oktober 2014 nicht verfügbar.
- Ab dem 20. Oktober 2014 können Kunden die CASCADE Simulationsumgebung in der neuen Release Version von November 2014 nutzen und dabei auch mit den automatisch umgestellten offenen CASCADE Wertpapierüberträge (weiter-)testen.

## 8.2 Simulation von TEFRA D Freigaben

Für die Simulation der spezifischen Änderungen bei TEFRA D Freigaben in der CASCADE Simulationsumgebung werden ab dem 20. Oktober 2014 folgende drei Wertpapiergattungen zur Verfügung stehen:

- DE000SK00818
  - TEFRA D-Frist vom 13. September bis 22. Oktober 2014
- DE000HSH4SX8
  - TEFRA D-Frist vom 20. September bis 29. Oktober 2014
- DE000HSH4RK7
  - TEFRA D-Frist vom 26. September bis 5. November 2014

Alle Kunden, die TEFRA D Freigaben testen möchten, setzen sich bitte vorher mit dem Test Team in Verbindung, damit sichergestellt wird, dass auf den betroffenen Konten Wertpapierbestände in den oben genannten Gattungen zur Verfügung stehen.

Kunden, die das flexible TEFRA D Verfahren gewählt haben, beachten bitte auch das jeweilige TEFRA D Fristende für die drei Gattungen. Analog der Vorgehensweise in der Produktion werden an diesem Tag die TEFRA D Bestände vom Hauptkonto auf das Unterkonto 671 umgebucht. Ab diesem Tag können die Bestände von dort drei Tage lang auf das Hauptkonto im Rahmen der TEFRA D Freigabe umgebucht werden.

## 9. Selbstbesicherung: Erweiterung der zulässigen Wertpapiere

Für die Refinanzierung der Wertpapierabwicklung via Selbstbesicherung (SB) sind girosammelverwahrfähige (GS-fähige) Wertpapiere aus der einheitlichen Liste der notenbankfähigen Wertpapiere der EZB (Eligible Asset Database (EAD)) zugelassen, für die keine Close-Link Prüfung zwischen dem SB-Teilnehmer und dem Emittenten des Wertpapiers notwendig ist.

Ab dem 17. November 2014 werden nun alle Wertpapiere der EAD Issuer Group 8 (Agency - credit institution) ohne Einschränkung für die Selbstbesicherung zugelassen.

Gemäß den nachfolgenden Kriterien ist der Umfang der zugelassenen SB-Wertpapiere wie folgt technisch zu prüfen:

Alle (auf der Internetseite der EZB publizierten) girosammelverwahrfähigen Wertpapiere der EAD, die keiner Close-Link Prüfung unterliegen, das heißt, Gattungen sind ausgeschlossen,

- wenn EAD-Feld Issuer Group gleich '3' oder '7' oder '9' ist, oder
- wenn EAD-Feld Issuer Group gleich '4' ist und das EAD-Feld CRD or Equivalent gleich 'NO' oder gleich 'N/A' oder 'leer' ist.

## 10. Vaults Services

---

### 10.1 Erstbelieferung

Bei online erfassten oder elektronisch übermittelten Einlieferungsaufträgen (AA16) entfällt der Einlieferungsgrund „6 – ERSTBELIEFERUNG“, da dieser funktional bei Neuzulassungen nicht mehr benötigt wird.

### 10.2 Tresorkonten in der Girosammelverwahrung (GS)

In Vorbereitung auf TARGET2-Securities wird die Vielzahl der CBF-Tresorkonten für GS-Wertpapiere auf einige wenige Konten konsolidiert. In Abhängigkeit von der Verwahrung und der Art des Wertpapiers wird bei der Einstellung des Auftrages in CASCADE das korrekte Tresorkonto automatisch ermittelt.

### 10.3 AA16/18: Anpassung der Behandlung von Aufträgen mit Zukunftsvaluta und nach RTS-Ende eingestellten Aufträgen zur Vorbereitung auf T2S Business Day

Die Aufträge erhalten eine Settlement-Sperre und werden automatisch entweder kurz vor 19:00 oder nach Abschluss der Vaults-Tagesendeverarbeitung neu validiert. Bei fehlerfreier Validierung werden sie automatisch freigegeben für Settlement. Bei fehlerhafter Validierung werden automatische Re-/Valutierungen gelöscht, andere Auftragsvarianten bleiben gesperrt stehen.

**Hinweis:** Dadurch werden z.B. Aufträge, die erst nach dem automatischen Freigabelauf (ca. nach 18:45 Uhr) eingestellt werden, nicht (mehr) in der STD-Buchung, sondern erst im RT-STD gebucht.



---

**Kontakt**

[www.clearstream.com](http://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

---