

SWIFT & Connectivity: Änderungen im November 2014

Clearstream Banking Frankfurt¹ stellt in dieser Kundeninformation die geplanten Änderungen im Zusammenhang mit dem SWIFT Standard Release 2014 vor. Diese geplanten Änderungen werden mit Wirkung zum 16. November 2014 eingeführt.

Die im vorliegenden Dokument zusammengefassten Änderungen beziehen sich auf folgende Bereiche:

- SWIFT Standard Release
- CBF Connectivity
- Implementierungen im Rahmen der Securities Markets Practice Groups (SMPG)
- Vereinheitlichung der verschiedenen Nachrichtentypen.

Jedes Jahr veröffentlicht SWIFT Spezifikationen für die verschiedenen ISO 15022 Nachrichtentypen. Diese geänderten bzw. erweiterten Spezifikationen beziehen sich auf die Anforderungen der National Market Practice Groups (NMPGs) und der SMPGs.

CBF wird in der Upgrade Information den fachlichen Hintergrund zu den verschiedenen Änderungen/ Anpassungen erläutern.

Grundsätzlich sind alle Anforderungen bindend und müssen von allen SWIFT-Nutzern übernommen werden. Die optionalen Änderungen können übernommen werden.

Im Rahmen des SWIFT Release im November 2014 werden die nachfolgend beschriebenen Änderungen von CBF umgesetzt.

Diese Änderungen gelten für Nachrichten im ISO^o 15022 Format, die über das SWIFT Netzwerk, über IBM WebSphere MQ sowie über die File Transfer Schnittstelle empfangen bzw. versendet werden.

Nachfolgend werden die entsprechenden Änderungen für CBF dargestellt. Die von SWIFT geänderten „Network Validation Rules“ werden nicht im Einzelnen dargestellt.

Die Informationen sind in folgende Abschnitte gegliedert:

- Clearing und Settlement Services
- Custody Services

Bei Fragen zu dieser Release Information steht der Customer Service Connectivity unter der Telefonnummer +49-(0) 69-2 11-11590 gerne zur Verfügung.

¹ Diese Kundenmitteilung wurde herausgegeben von Clearstream Banking AG (CBF) mit Gesellschaftssitz Mergenthalerallee 61, 65760 Eschborn, Deutschland, eingetragen im Handelsregister des Amtsgerichts Frankfurt am Main, Deutschland, unter der Nummer HRB 7500.

1. Clearing und Settlement Services

Aufgrund des SWIFT Standard Release 2014 wird es keine Änderungen geben. Jedoch werden Anpassungen auf Grund vorbereitender Maßnahmen für TARGET2-Securities (diese wurden bereits in der Kundeninformation [CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen](#) im Mai 2014 veröffentlicht) und auf Grund der neu einzuführenden Prüfung eingehender Transaktionen notwendig und sind im Nachfolgenden detailliert beschrieben.

1.1 Compliance-Prüfung von eingehenden Instruktionen

CBF wird alle eingehenden Kundeninstruktionen einer Compliance Prüfung unterziehen. Um die Kunden über den Status ihrer Instruktionen zu informieren, wird der vorläufige Status IPRC//PPRC in den MT548 Nachrichten für jene Kunden ausgewiesen, die MT548 BVF (Business Validation Feedback) Nachrichten für CASCADE Instruktionen abonniert haben.

Beispiel:

Sequence A – General Information

Subsequence A2 – Status

25D::IPRC//PPRC

Subsequence A2a – Reason

24B::PPRC//NARR

70D::REAS//YOUR INSTRUCTION IS AWAITING VALIDATION

Nach erfolgreich durchgeführter Compliance-Prüfung erfolgt für die Instruktionen das übliche Lifecycle Standard-Reporting. Für Kunden, die keine MT548 BVF Nachrichten beziehen, wird diese Benachrichtigung nicht zur Verfügung gestellt.

1.2 Instruktionsmanagement – Anpassungen für TARGET2-Securities (T2S)

Für eine reibungslose Migration auf T2S werden im November Release 2014 erste Maßnahmen umgesetzt. Bezüglich der Verarbeitung von Wertpapieraufträgen wird CBF die nachstehenden Veränderungen im Rahmen der Connectivity vornehmen:

- Erweiterung von Settlement Party Informationen:
Mit dem Einsatz wird CBF das Party Level 5 (Deliverer's Intermediary 2 (DIE2) / Receiver's Intermediary 2 (REI2)) in seinen Prozessen etablieren und für alle Kunden einführen.
- Party Informationen werden auf demselben Level zurückgemeldet, in dem sie gesendet werden:
CBF wird alle Party Level Informationen, die in den CASCADE Auftragsbestand übernommen werden, auf demselben Level zurückmelden, auf dem sie ursprünglich gesendet wurden. Außerdem erfolgt eine Reorganisation des Party Level 1 (BIC und SAC Nummer).

Hinweis: Zukünftig werden für die Party Levels 2-5 max. bis zu 70 Zeichen von CASCADE übernommen.

Dies bedeutet ebenso, dass bei der online Eingabe über CASCADE die zusätzliche Eingabe eines Textfeldes für „Endbegünstigter“ und „Original-Auftraggeber“ nicht mehr möglich ist.

- Herausnahme des Kennzeichens „MSC“:
Alle Funktionalitäten, die derzeit im CASCADE-Abwicklungssystem für standardmäßige OTC Instruktionen (Auftragsarten AA01/02) und Aufträge für RS Emissioneneinführungen (AA01 E) mit dem Kennzeichen „MSC“ verbunden sind, werden herausgenommen. Sollte ein Kunde beim Nachrichtenaustausch im Feld „97A“ (Safekeeping Account) den Wert „MSC-NONREF“ an CBF senden, wird dies im CASCADE Auftragsbestand als Party Level Information betrachtet und entsprechend in der Verarbeitung berücksichtigt.

Eine umfassende Beschreibung bezüglich der T2S relevanten Systemänderungen finden Sie in der Kundeninformation [CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen](#).

2. Custody Services

In diesem Kapitel sind die Änderungen für den CBF Custody Service, die ab dem 16. November 2014 eingeführt werden, zusammengefasst. Die SWIFT-Nachrichten MT564/566/568 sind optionale Services und können durch den Kunden über die [Bestellformulare Nr. 83A/B](#) beantragt werden.

2.1 SWIFT Standard Release 2014

2.1.1 MT564 Corporate Action Notification

Sequenz A General Information

:22F::CAEV//MCAL

Zukünftig wird der Corporate Action Event Indikator MCAL für vorzeitige Rückzahlungen bzw. Tilgungen verwendet. Der Event Indikator tritt bei den nachfolgenden Terminarten im Zusammenhang mit folgenden Rückzahlungsarten (WM-Feld VD005) auf:

- TA130 - Gesamtrückzahlung
- TA131 - Rückzahlung Genussrecht
- TA132 - Rückzahlung Zertifikat
- TA134 / TA231 - Barausgleich bei Tilgung in Wertpapieren

VD005	Beschreibung
07	Gesamtkündigung
28	Gesamttilgung vorzeitig erfolgt
29	Gesamttilgung vorzeitig erfolgt wegen Credit Event
33	Gesamttilgung vorzeitig erfolgt ohne Einlösungsbetrag/-kurs
34	Gesamttilgung vorzeitig erfolgt wegen Credit Event ohne Einlösungsbetrag/-kurs

Sequenz A General Information

:25D::PROC//INFO

Der Processing Status INFO ist nicht mehr zulässig und wird durch PREU ersetzt. Dies betrifft die "For Info only" Nachrichten für OGAW relevante Informationen von Fonds, die vorab angekündigt wurden, ohne dass ein Termin oder weitere Daten zur Durchführung der entsprechenden Non-Income-Maßnahme bekannt sind, sowie die "For Info only" Nachrichten zu Fondsverschmelzungen.

Sequenz D Corporate Action Details

:98A::XDTE

Im Falle von Reorganisation-Events wird der Ex-Tag nicht mehr angezeigt. Dies betrifft die folgenden Terminarten:

- [TA122 - Auszahlung Optionsschein](#)
- TA123 - Auszahlung Squeeze out
- TA124 - Abfindung/Rückkauf von Aktien
- [TA222 - Ausbuchen wertloser Wertpapiere](#)
- TA231 - Tilgung in Wertpapieren
- [TA232 - Umtauschangebote](#)

In den Teilsequenzen E1 bzw. E2 wird unverändert der Zahlbarkeitstag in 98A::PAYD angezeigt.

Teilsequenz E1 Securities Movements

:92D::NEWO

Heute wird bei der Terminart TA232 (Reorganisation Events) das Umtauschverhältnis "Neue Gattung : Alte Gattung" in der E1-debit-Teilsequenz angezeigt, die die Ausbuchung der alten Gattung (ISIN-Underlying des Events) abbildet. Zukünftig wird das Umtauschverhältnis in der E1-credit-Teilsequenz angezeigt, die die Einbuchung der neuen Gattung darstellt.

Teilsequenz E2 Cash Movements

:92J::GRSS//TXBL und 92J::GRSS//TXFR

Bei der Ausschüttung von Erträgen und Steuerliquidität auf Basis deutscher Wertpapiere werden die beiden Felder "Taxable portion (rate)" und "Tax free portion (rate)" ergänzend angezeigt. Dies betrifft die folgenden Terminarten:

- TA110 - Zinsen
- TA120 – Dividenden aus Aktien
- TA121 – Ausschüttung Fonds
- TA125 – Ausschüttung wegen Corporate Action
- TA126 – Ausschüttung Genussrechte
- TA127 – Steuerliquidität für thesaurierende Fonds

Das Feld 92J::GRSS//TXBL enthält die *anteilige* Ausschüttungsrate, die der Besteuerung unterliegt (Summe der Bemessungsgrundlagen), und das Feld 92J::GRSS//TXFR enthält die anteilige Ausschüttungsrate, die frei von einer Besteuerung ist (Bruttoausschüttungsrate minus den Bemessungsgrundlagen). Die Anzeige der Felder erfolgt unabhängig vom Steuerstatus des Kunden und nur für positive Beträge ungleich Null.

Thesaurierende Fonds

Die folgenden Änderungen und Erweiterungen beziehen sich auf die Terminart TA127 (Steuerliquidität für thesaurierende Fonds).

Sequenz F Additional Information

:70E::TAXE

Das Freitextfeld wird heute genutzt, um den inländischen und ausländischen Dividendenanteil (ohne REIT) sowie den inländischen REIT-Anteil anzuzeigen. Zukünftig wird zu dem inländischen und ausländischen Dividendenanteil (ohne REIT) der inländische und ausländische REIT-Anteil angezeigt.

SWIFT-Feld	Beschreibung
Sequenz F Additional Information	
:70E: :TAXE//DIV/	Inländischer und ausländischer Dividendenanteil (ohne REIT)
REIT/	Inländischer und ausländischer REIT-Anteil
EXCHANGE RATE/	Währung 1 / Währung 2 / Umrechnungskurs, falls die Währung der Bemessungsgrundlagen von der Ausschüttungswährung abweicht.

2.1.2 MT566 Corporate Action Confirmation

Sequenz A General Information

:22F::CAEV//MCAL

Zukünftig wird der Corporate Action Event Indikator MCAL für vorzeitige Rückzahlungen bzw. Tilgungen verwendet. Der Event Indikator tritt bei den nachfolgenden Terminarten im Zusammenhang mit folgenden Rückzahlungsarten (WM-Feld VD005) auf:

- TA130 - Gesamtrückzahlung
- TA131 - Rückzahlung Genussrecht
- TA132 - Rückzahlung Zertifikat
- TA134 / TA231 - Barausgleich bei Tilgung in Wertpapieren

VD005	Beschreibung
07	Gesamtkündigung
28	Gesamttilgung vorzeitig erfolgt
29	Gesamttilgung vorzeitig erfolgt wegen Credit Event
33	Gesamttilgung vorzeitig erfolgt ohne Einlösungsbetrag/-kurs
34	Gesamttilgung vorzeitig erfolgt wegen Credit Event ohne Einlösungsbetrag/-kurs

Sequenz B Underlying Securities

:35B: Identification of the Financial Instrument

Die Buchungsbestätigung zu einem FoP Claim zeigt heute in der Sequenz B die ISIN des FoP Claims an, z. B. die ISIN des Bezugsrechts. Zukünftig wird in der Sequenz B die ISIN des zugrundeliegenden Events angezeigt, z. B. die ISIN der Stammaktie. In der Sequenz D1 erfolgt unverändert die Anzeige des Umsatzes zusammen mit der ISIN aus dem FoP Claim. Diese Änderung betrifft:

- MT566 Bestätigungen zu FoP Claims aufgrund von Reverse- oder Market Claiming auf Basis von OTC oder LION-Stock Exchange Transaktionen
- MT566 Bestätigungen auf Basis gebuchter OTC oder LION-Stock Exchange Transaktionen, die am Stichtag des Events durch Änderung der ISIN modifiziert wurden.

Sequenz C Corporate Action Details

:98A::XDTE

Im Falle von Reorganisation-Events wird der Ex-Tag nicht mehr angezeigt. Dies betrifft die folgenden Terminarten:

- TA122 - Auszahlung Optionsschein
- TA123 - Auszahlung Squeeze out
- TA124 - Abfindung/Rückkauf von Aktien
- TA222 - Ausbuchen wertloser Wertpapiere
- TA231 - Tilgung in Wertpapieren
- TA232 - Umtauschangebote

In den Teilsequenzen D1 bzw. D2 wird unverändert der Zahlbarkeitstag in 98A::PAYD angezeigt bzw. neu aufgenommen.

Teilsequenz D2 Cash Movements

:92J::GRSS//TXBL und 92J::GRSS//TXFR

Bei der Ausschüttung von Erträgen und Steuerliquidität auf Basis deutscher Wertpapiere werden die beiden Felder "Taxable portion (rate)" und "Tax free portion (rate)" ergänzend angezeigt. Dies betrifft die folgenden Terminarten:

- TA110 - Zinsen
- TA120 – Dividenden aus Aktien
- TA121 – Ausschüttung Fonds
- TA125 – Ausschüttung wegen Corporate Action
- TA126 – Ausschüttung Genussrechte
- TA127 – Steuerliquidität für thesaurierende Fonds.

Das Feld 92J::GRSS//TXBL enthält die anteilige Ausschüttungsrate, die der Besteuerung unterliegt (Summe der Bemessungsgrundlagen), und das Feld 92J::GRSS//TXFR enthält die anteilige Ausschüttungsrate, die frei von einer Besteuerung ist (Bruttoausschüttungsrate minus den Bemessungsgrundlagen). Die Anzeige der Felder erfolgt unabhängig vom Steuerstatus des Kunden und nur für positive Beträge ungleich Null.

Thesaurierende Fonds

Die folgenden Änderungen und Erweiterungen beziehen sich auf die KADI-Terminart TA127 (Steuerliquidität für thesaurierende Fonds).

Sequenz E Additional Information

:70E::TAXE

Das Freitextfeld wird heute genutzt, um den inländischen und ausländischen Dividendenanteil (ohne REIT) sowie den inländischen REIT-Anteil anzuzeigen. Zukünftig wird zu dem inländischen und ausländischen Dividendenanteil (ohne REIT) der inländische und ausländische REIT-Anteil angezeigt.

SWIFT-Feld	Beschreibung
Sequenz F Additional Information	
:70E: :TAXE//DIV/	Inländischer und ausländischer Dividendenanteil (ohne REIT)
REIT/	Inländischer und ausländischer REIT-Anteil
EXCHANGE RATE/	Währung 1 / Währung 2 / Umrechnungskurs, falls die Währung der Bemessungsgrundlagen von der Ausschüttungswährung abweicht.

Versandzeitpunkt MT566 nach DD2-Geldbuchungen

MT566 Nachrichten zur Bestätigung von DD2-Geldbuchungen aus dem Custody-Geschäft werden heute in der Regel gegen 15:00 Uhr an die Kunden versendet. Zukünftig wird der 15:00 Uhr-Übertragungslauf auf ca. 14:15 Uhr vorgezogen. Dadurch kann der MT566 zu den DD2-Geldbuchungen früher an die Kunden versendet werden. MT564 Vorabinformationen, die heute um 15:00 Uhr per File Transfer versendet werden, werden dann zukünftig erst mit dem nächsten Übertragungslauf um 15:45 Uhr übermittelt.

2.2 Transformation offener OTC- und Börsengeschäfte in Geld

Mit dem November Release 2014 werden bei Transformationen offener OTC- und Börsengeschäfte in Geld zusätzliche obligatorische Reorganisations-Events wie z. B. Rückzahlungen für den Transformationsprozess herangezogen. Details hierzu sind in der Kundeninformation [CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen](#) beschrieben.

Das SWIFT Reporting folgt dem Standard Reporting für Transformationen. Ein MT564 REPE mit 22F::ADDB//ATXF wird am Stichtag für alle offenen Geschäfte erzeugt. Die Bestätigung über die Buchung erfolgt per MT566 mit 22F::ADDB//ATXF.

2.3 MT564 REPE für Income Events

Mit dem November Release 2014 wird der Umfang der MT564 REPE Nachrichten erweitert. Die neuen Nachrichten sind an den ISO15022 Standards ausgerichtet und haben nur geringe Auswirkungen auf die bestehenden MT564 Nachrichtenformate. Die Erweiterungen komplettieren den Umfang der MT564 REPE Nachrichten für Income Events, so dass für jede von KADI automatisch generierte Abrechnung eine Nachricht zur Verfügung gestellt wird.

Eine vollständige Auflistung aller CBF MT564 REPE Nachrichten für Income Events ist in der Kundeninformation [CBF Release im November 2014: Vorankündigung der Änderungen](#) beschrieben.