

CBF Release

Informationen zum Release

19. November 2012

CBF Release

Informationen zum Release

19. November 2012

August 2012

Dokumentnummer: F-CON31

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

© Copyright Clearstream Banking AG, Frankfurt (2012). Alle Rechte vorbehalten.

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

Vorwort

Die vorliegende Information stellt Ihnen umfassend und detailliert die Neuerungen vor, die am 19. November 2012 für folgende Servicebereiche eingeführt werden:

- Clearing und Settlement Services
- Custody Services
- Connectivity Services
- Global Securities Financing Services
- Wertpapierstammdaten

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

Ansprechpartner

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

Clearstream Banking Frankfurt

Customer Service Domestic	Tel:	+49 – (0) 69 – 211 - 1 11 77
(Allgemeine Anfragen)	Fax:	+49 – (0) 69 - 211 – 61 11 77
	E-Mail:	csdomestic@clearstream.com

Customer Service Connectivity	Tel:	+49 – (0) 69 – 211 - 1 15 90
(Connectivity Services)	Fax:	+49 – (0) 69 - 211 – 61 15 90
	E-Mail:	connectfrankfurt@clearstream.com

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

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

Leerseite

Inhalt

1.	Clearing und Settlement Services	7
1.1	Änderungen bei der CASCADE Informationsanzeige Auftragsabwicklung (KVAI) und im CASCADE Match Service (KVAM)	7
1.1.1	Umsetzung der Änderung in CASCADE (KVAI)	8
1.1.2	Umsetzung der Änderung in CASCADE PC (Auswahl Information Auftragsbestand)	9
1.1.3	Umsetzung der Änderung in CASCADE (KVAM)	11
1.1.4	Umsetzung der Änderung in CASCADE PC (Auswahl Match Dienst)	12
1.2	Änderungen bei der CASCADE Einlieferung Neuzulassung /Valutierungen der Auftragsart 16 (KVEW) 14	
1.2.1	Umsetzung der Änderung in CASCADE (KVEW)	15
1.2.2	Umsetzung der Änderung in CASCADE PC (Einlieferung Neuzulassung Valutierung)	16
1.3	Änderung in der CASCADE Umsatzanzeige KVDU	17
1.3.1	Umsetzung der Änderung in CASCADE PC	18
1.4	Änderung der Historienabfrage für Ein- und Auslieferungen in der CASCADE Transaktion KPHI sowie in der CASCADE PC Auftragshistorie	19
1.5	Voraussetzungen für die Änderungen in CASCADE PC	19
2.	Custody Services	20
2.1	OGAW IV	20
2.2	Einführung der SWIFT Nachrichtenformate MT564 und MT566 für die Income-Hauptzahlstelle	20
2.3	Einführung des MT564 und MT566 für Lead Manager bei Tilgung in Wertpapieren (TA231)	21
2.4	Umstellung der Verarbeitung bei Ausbuchung wertloser Zertifikate und Optionsscheine (TA222)	21
2.5	Einführung des Real Time-MT564 ab Stichtag der Kapitalmaßnahme	21
2.5.1	Hauptmerkmale	22
2.6	Rückzahlungen von Wertpapieren mit Zinszuwachs	23
3.	Connectivity Services	24
3.1	KUSTA Datenträger	24
3.2	SWIFT Release 2012	24
4.	CBF Global Securities Financing Services	25
4.1	Xemac	25
4.1.1	Einsatz der neuen Xemac Version 5.4	25
4.1.2	Erweiterte Xemac Bewertungsmethoden	25
4.1.3	Optimierung der GC Pooling Abwicklung	27
4.1.4	Wiederverwendung von GC Pooling Sicherheiten ("Eurex Clearing Reuse")	27
4.1.5	Sonstige Änderungen in der Benutzeroberfläche	28
5.	Wertpapierstammdaten	30
6.	Kundensimulation	31

Leerseite

1. Clearing und Settlement Services

1.1 Änderungen bei der CASCADE Informationsanzeige Auftragsabwicklung (KVAI) und im CASCADE Match Service (KVAM)

Um einen generellen Überblick über offene Settlement Instruktionen in Fremdwährungen (DVPs gegen Beträge in Fremdwährungen außer Euro) zu geben, wird in den CASCADE Transaktionen KVAM und KVAI zukünftig ein neues Selektionskriterium im Feld „WRG GEGENWERT“ zur Verfügung stehen.

Durch Auswahl „XXX“ im Feld „WRG GEGENWERT“ in KVAI und KVAM ist es bereits heute möglich, sich ausschließlich Settlement Instruktionen ohne Gegenwert anzeigen zu lassen.

Mit dem neuen Auswahlkriterium „YYY“ im Feld „WRG GEGENWERT“ in KVAI und KVAM ist es möglich, sich ausschließlich Settlement Instruktionen mit Gegenwert in einer der zulässigen Fremdwährungen anzeigen zu lassen.

Die Sortierfolge der Anzeige richtet sich hierbei zuerst nach der ISIN und dann nach aufsteigender Nominale.

In der Transaktion KVAI wird zukünftig ebenfalls durch Eingabe des Auswahlkriteriums „YYY“ die Anzahl der Settlement Instruktionen und die Summe der Nominale über DVPs in Fremdwährungen angezeigt.

1.1.1 Umsetzung der Änderung in CASCADE (KVAI)

Neues Auswahlkriterium im Bildschirm KVAI:

```

TRAN: KVAI FC: AA SB:

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

AA  AUFTRAGSART              : 01                      KZ-AA: .
AN  AUFTRAGS-NUMMER         : .....
AD  NICHT ERFOLGREICH DISPONIERTE AUFTRAEGE

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

SS  SDS-AUFTRAEGE (SOFORTDISPOSITION)
SR  RTS-AUFTRAEGE (SOFORTDISPOSITION)

ZUSAETZLICHE                LASTSCHRIFT-BANK : 7999          WKN           : I .....
AUSWAHL                     GUTSCHRIFT-BANK : ....          SETTLEMENT-DAY : 08.06.2012
                                                WRG GEGENWERT : YYY

HA  HISTORISCHE AUFTRAEGE          EINGEBER       : ....

-- ID-KZ: 7999003244 -- PW:          ----- B790730E -- 08/06/12 -- 11:07:05 --
KV0003I Verarbeitung abgebrochen
PF1:Hilfe PF3:Rücksprung PF4:Abbruch
  
```

```

TRAN: KVAI FC: AA SB: 01##7999#I###08.06.2012#YYY

AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / INFORMATION          AUFTRAGSSTATUS

LAST-BANK: 7999                      WRG GEGENWERT: YYY                      SEITE 1

K M S D AA RTS  AUFTNR GUT  WKN                      NOMINALE          GEGENWERT SET-D
_ 2 3 1 01 N   382451 7121 AU000A0B7T43          2.000             4.370,00 08.06
_ 2 3 1 01 N   370459 7121 AU000A0B7T43          3.000             4.209,99 08.06
_ 2 0 4 01 N   239294 7121 AU000A0CANX1          2.000             5.970,00 06.06
_ 2 0 4 01 N   248314 7121 CH0128954887          3.000             5.799,99 06.06
_ 2 1 1 01 N   365260 7015 CH0128954887          130              10.044,50 08.06
_ 2 1 1 01 N   357799 7015 US0970231058          10.000            9.865,00 08.06
_ 2 2 1 01 N    66511 7259 US181006CT23          10.000            10.332,22 08.06
_ 2 3 1 01 N   349185 7121 US25152EDL39           325              24.754,11 08.06
_ 1 0 4 01 N   787195 7204 US4592001014          40.000            36.440,00 06.06
_ 2 3 1 01 N   352472 7121 US5893311077           5.000             4.668,67 08.06

GESAMTSUMMEN ANZAHL AUFTRAEGE: 10          75.455

-- ID-KZ: 7999903244 -- PW:          ----- B790730E -- 08/06/12 -- 11:26:31 --
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF7:Zurück PF8:Vor
  
```

1.1.2 Umsetzung der Änderung in CASCADE PC (Auswahl Information Auftragsbestand)

Beispiel Bildschirm „Auswahl Information Auftragsbestand“

The screenshot shows a Windows-style dialog box titled "CASCADE - PC Auswahl Information Auftragsbestand". It features a menu bar with "Fenster" and "Hilfe". Below the title bar are two radio buttons: "Eigene Aufträge" (selected) and "Kontrahenten Aufträge".

The main area is divided into two sections:

- Auswahl:** A list of radio buttons for selection:
 - Aufträge nach Auftragsart
 - Auftragsnummer
 - Nicht erfolgreich disponierte Aufträge
 - Match-Aufträge
 - Match-Instruktionen
 - SDS Aufträge
 - RTS Aufträge
 - Historische Aufträge
- Auftragsart:** A dropdown menu currently showing "Wertpapierübertrag".

The **Zusätzliche Auswahl** section contains several input fields and dropdowns:

- Eigene Bank:** Text input field containing "7001".
- Kontrahent:** Text input field.
- Wertpapier:** Dropdown menu showing "ISIN".
- Settlement-Day:** Text input field.
- Währung Gegenwert:** Dropdown menu showing "YYY - Alle Fremdwährungen".
- An empty text input field.

At the bottom, there are two buttons: "OK" and "Abbruch".

The status bar at the very bottom contains the following information: "Version 7.7 Beta", "7999260001", "A", "KVAI AA", and "08.08.12 15:07:28".

Beispiel Bildschirm „Auftragsbestand Information“

CASCADE - PC Auftragsbestand Information

Fenster Vollanzeige Hilfe

Last-Bank: Seite:

Währung:

M	Se	Di	Auf	RTS-	Auftragsnummer	Gut-Konto	Wertpapierkennnummer	Nominale	Gegenwert	Settlement-Day
2	0	16	01	Nein	89130	7003	DE0005151005	30	30,00	30.05
2	0	16	01	Nein	89131	7003	DE0005151005	31	31,00	30.05
2	0	16	01	Nein	89132	7003	DE0005151005	32	32,00	30.05
1	0	14	01	Nein	89133	7003	DE0005151005	33	33,30	30.05
2	0	16	01	Nein	89134	7003	DE0005151005	34	34,00	30.05
2	0	16	01	Nein	89135	7004	DE0005151005	35	35,00	30.05

Anzahl Aufträge: Gesamtsummen:

Version 7.7 Beta 7999260001 A KVAI AA 08.08.12 15:09:53

1.1.3 Umsetzung der Änderung in CASCADE (KVAM)

Neues Auswahlkriterium im Bildschirm KVAM:

```

TRAN: KVAM FC: MA SB: O#7999#I##08.06.2012#
AUFTRAGSABWICKLUNG          M A T C H - D I E N S T          AUFTRAGSSTATUS
SETZEN KENNZEICHEN AUF OFFENE MATCH-AUFTRAEGE ODER MATCH-INSTRUKTIONEN
MA  MATCH-AUFTRAEGE          : M  M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
MI  MATCH-INSTRUKTIONEN     : .  M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
RM  RUECKNAHME MATCHING     : ..... (AUFTRAGSNUMMER)
ZUSAETZLICHE                 BANK-NR DES KONTRAHENTEN : 7999
AUSWAHL                      WKN                        : I .....
                              SETTLEMENT-DAY             : 08.06.2012
                              WRG GEGENWERT                : YYY
-- ID-KZ: 7999260001 -- PW:          ----- B790730F -- 08/06/12 -- 11:19:36 --
KV0003I Verarbeitung abgebrochen
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch

```

Es werden alle DvPs in Fremdwährung, also ohne FoPs und DvPs in EUR angezeigt:

```

TRAN: KVAM FC: MA SB: M#2013#I##08.06.2012#
AUFTRAGSABWICKLUNG          MATCH-AUFTRAEGE / MATCH-DIENST          AUFTRAGSSTATUS
                              WRG GEGENWERT :          SEITE    1
KZ M S D    AUFTNR RTS BANK WKN          NOMINALE          GEGENWERT SET-D
_ 02 3 4    6131110 N 7001 CH0038943202          110                20,00 26.03
_ 02 1 4           912 N 7015 CH0043918413          5.000              5.000,00 27.03
_ 02 0 4    559001 N 7004 CH0128954887          14.000             14.000,00 12.03
_ 02 1 4     64202 N 4003 DK0010181759           20                20,00 26.03
_ 02 1 4     64206 N 4003 DK0010268606           60                60,00 26.03
_ 02 1 4     940 N 7201 US02209SAC70          100.000            100.000,00 28.03
_ 02 3 4     62114 N 7001 US05518F2092           40                40,00 24.03
_ 02 3 4     61215 N 2731 US2546871060           50                50,00 26.03
-- ID-KZ: 7907260001 -- PW:          ----- B790730F -- 08/06/12 -- 11:20:57 --
KV0022F PF-Taste nicht zulässig
PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch

```

1.1.4 Umsetzung der Änderung in CASCADE PC (Auswahl Match Dienst)

Beispiel Bildschirm „Auswahl Match Dienst“

The screenshot shows a Windows-style dialog box titled "CASCADE - PC Auswahl Match-Dienst". The window has a menu bar with "Fenster" and "Hilfe". The main area is divided into two sections: "Auswahl" and "Zusätzliche Auswahl".

In the "Auswahl" section, there are three radio buttons: "Match-Aufträge" (selected), "Match-Instruktionen", and "Rücknahme Matching". Below them is a "Match-Status:" label and a dropdown menu currently showing "Offen".

The "Zusätzliche Auswahl" section contains four fields: "Kontrahent:" with an empty text box; "Wertpapierkennnummer:" with a dropdown menu showing "ISIN" and an empty text box; "Settlement-Day:" with an empty text box; and "Währung Gegenwert:" with a dropdown menu showing "YYY - Alle Fremdwährungen".

At the bottom of the dialog are two buttons: "OK" and "Abbruch".

The status bar at the very bottom contains the following information: "Version 7.7 Beta", "7999260001", "A KVAI", and "08.08.12 15:12:35".

Beispiel Bildschirm „Aufträge Match Dienst“

1.2 Änderungen bei der CASCADE Einlieferung Neuzulassung /Valutierungen der Auftragsart 16 (KVEW)

Zukünftig ist es möglich, den Settlement-Day bei Neuzulassungen und Valutierungen in der CASCADE Transaktion KVEW – NV (NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG) bis zu 40 Bankarbeitstage im Voraus anzugeben. Dazu wird in der Eingabemaske KVEW – NV ein zusätzliches Eingabefeld „SET-DAY“ implementiert.

Die Depotbuchung erfolgt somit frühestens zum beauftragten Settlement-Day in der Standardverarbeitung (STD).

Das Feld „SET-DAY“ muss immer gefüllt sein (Eingabe Pflicht Feld) und wird standardmäßig mit dem aktuellen Tagesdatum vorbelegt. Der vorbelegte Settlement Day kann mit einem Datum, das bis zu 40 Bankarbeitstagen in der Zukunft liegt, von den CBF Teilnehmern überschrieben werden.

Prüfungen bei Auftragserteilung gegen CARAD (z. B.: bei Valutierungen auf vorhandene Ordnungsnummer) werden nur noch für Aufträge ausgeführt deren Settlement-Day dem aktuellen Arbeitstag entspricht.

Das neue Eingabe-Feld „SET-Day“ wird in allen relevanten Informationsanzeigen (CASCADE Erfassungs-Auftrags- und Dispositionsstatus) sowie in den Online-Druckreports übernommen.

Neben der online Auftragserteilung ist eine Beauftragung mit zukünftigem Settlement-Day auch via LIMA und CASCADE PC möglich.

Eine Auftragserteilung mit zukünftigem Settlement-Day über den EDT Prozess (Electronic Data Transfer) ist nicht möglich. Automatisch generierte Aufträge zu Neuzulassungen und Valutierungen werden immer mit dem aktuellen Tagesdatum in den CASCADE Auftragsstatus eingestellt.

Auftragsänderungen über die CASCADE Transaktion KVAA sind noch bis zum Vortag des eingegebenen Settlement-Day durch den CBF-Teilnehmer möglich.

1.2.1 Umsetzung der Änderung in CASCADE (KVEW)

Beispiel der Transaktion KVEW:

```
TRAN: KVEW FC: NV SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / EINZELERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                          NEUZULASSUNG/VALUTIERUNG
PRIMANOTE:              AUFTNR:              HLG: 01 GS
LAST-KTO : _____
GUT-KTO  : _____
WKN      : I _____
NOMINALE : _____      EINHEIT:          ST-ART:
NOM-URK  : _____      EINLIEF-ART   : _
RAHMEN-NOM: _____      ORD-NR       :
SET-DAY : 19.11.2012      EINLIEF-GRUND: ____
KUNDENREFERENZ : ____ - _____ - _____      KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME:
ADRESSE: _____
BEARB-STATUS:
-- ID-KZ: 7999670001 -- PW:          ----- B79075D3 -- 19/11/12 -- 12:28:34 --
PF4:Abbruch
```

1.2.2 Umsetzung der Änderung in CASCADE PC (Einlieferung Neuzulassung Valutierung)

Beispiel Bildschirm „Einlieferung Neuzulassung Valutierung“

The screenshot shows a software window titled "CASCADE - PC Einlieferung Neuzulassung Valutierung Erfassung". The window contains a form with the following fields and controls:

- Auftragsnummer:** Text input field.
- Primernote:** Text input field.
- Unterauftragsart:** Text input field containing "Neuzulassung/Valutierung".
- Lastschrift-Konto:** Three text input fields.
- Gutschrift-Konto:** Three text input fields.
- Wertpapier:** A dropdown menu with "ISIN" selected, followed by two text input fields.
- Nominale:** Text input field.
- Einheit:** Text input field.
- Stückart:** Dropdown menu.
- Urkunden-Nominale:** Text input field.
- Hinterlegungsart:** Dropdown menu with "01 - Girosammelverwahrung" selected.
- Rahmen-Nominale:** Text input field.
- Einlieferungsart:** Dropdown menu.
- Ordnungsnummer:** Text input field.
- Bestandsart:** Dropdown menu.
- Settlement-Day:** Text input field.
- Einlieferungsgrund:** Dropdown menu.
- Kunden-Referenz:** A dropdown menu, a text input field, a hyphen, another dropdown menu, and a text input field.
- Einlieferung von:** Text input field.
- Adresse:** Text input field.
- Bearbeitungsstatus:** Text input field.

At the bottom of the form are three buttons: "Verarbeitung", "Prüfen", and "Abbruch".

The status bar at the bottom of the window displays: "Version 7.7 Beta", "7999260001", "A", "KVEW NV", and "08.08.12 11:27:24".

1.3 Änderung in der CASCADE Umsatzanzeige KVDU

In der Umsatzanzeige KVDU – ID (Depotumsätze Inland) kann innerhalb der Vollanzeige der Umsatzdaten mit der Funktionstaste PF9 in die Auftragsdaten verzweigt werden.

Hier werden für Auslieferungen mit der CASCADE Auftragsart 18, der Hinterlegungsart 30 (Fremdtresor) und der Umlegungsart 11 (Kundenreferenz) die folgenden neuen Felder innerhalb der Kundenreferenz angezeigt.

- Kundenreferenz neu
- Bestandskennzeichen (F = Fremdbestand, E = Eigenbestand)

Beispiel der Umsatzanzeige KVDU:

```
TRAN: KVDU FC: ID SB: 25.06.2012#####I####18##L#YYYY#####  
  
UMSATZANZEIGE                AUSLIEFERUNG                AUFTRAGSVOLLANZEIGE  
  
Auftnr      :      99908                HLG: 30 FREMDTRESOR  
  
Last-Kto   : YYYY YY                TRESOR-KUNDENBEST  
Gut-Kto    : 2964 013                CBF FREMDTRESOR  
WKN/ISIN   : I DE0009830182 H.F.S.IM.DT.18 GMBH+CO.KG  
  
Nominale   :      35.000                Einheit      : EO  
Nom-Urkunde :      35.000                Umlegung    :  
Ausc-Buch-Nr:      1677                Set-Day     : 25.06.2012  
                Sammelurkunde : J  
                Auslief.Vorgang: 1 AUSLIEFERUNG  
                Auslieferung RU: N  
  
Kundenreferenz      :      - 497                KTO - 380876201      F  
Kundenreferenz neu :      - 597                KTO - 799510      F  
  
-- ID-KZ: 7907000010 -- PW:                ----- B79074Q9 -- 28/06/12 -- 15:10:23 --  
  
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF9:Umsatz
```

1.3.1 Umsetzung der Änderung in CASCADE PC

Beispiel Bildschirm „Auslieferung Umsatz“

The screenshot shows the 'CASCADE - PC Auslieferung Umsatz' application window. The interface includes the following fields and controls:

- Auftragsnummer:** 74126
- Hinterlegungsart:** 30 - Fremdtresor
- Lastschrift-Konto:** 1711 096 FREMDBESTAND
- Gutschrift-Konto:** 2964 013 TRESORKONTO
- Wertpapier:** ISIN DE0009830158
- Nominale:** 50.000
- Einheit:** (empty)
- Urkunden-Nominale:** 50.000
- Ausgangsbuchnummer:** 1600
- Settlement-Day:** 13.06.2012
- Auslieferungsvorgang:** 1 - Auslieferung
- Sammelurkunde:** Ja
- Auslieferung Rahmenurkunde:** Nein
- Bestandskennzeichen:** F- Fremdbestand
- Kunden-Referenz:** 497 - KTO Kontonummer 384018198
- Bestandskennzeichen (neu):** F- Fremdbestand
- Kunden-Referenz (neu):** 498 - KTO Kontonummer 384018197

At the bottom center, there is an 'Abbruch' button. The status bar at the very bottom displays: Version 7.7 Beta, 7999260002, A, KVDU ID, and 08.08.12 13:47:36.

1.4 Änderung der Historienabfrage für Ein- und Auslieferungen in der CASCADE Transaktion KPHI sowie in der CASCADE PC Auftragshistorie

Die Anzeige der historischen und in Bearbeitung befindlichen Ein-/Auslieferungsaufträge (CASCADE Auftragsart 16 und 18 liefert künftig) in der CASCADE Transaktion KPHI und in der CASCADE PC Auftragshistorie die Information über die Aufträge aus dem Zeitraum der letzten zwei Jahre.

1.5 Voraussetzungen für die Änderungen in CASCADE PC

Da es sich um ein verpflichtendes CASCADE PC Release handelt, müssen alle CASCADE-PC Kunden sicherstellen, dass die neue CASCADE-PC Version 7.7 rechtzeitig installiert wird. Diese steht ab dem 5. November 2012 auf der Clearstream Website zum Download zur Verfügung und muss zum Stichtag, das heißt ab dem 19. November 2012 eingesetzt werden. Weitere Details zur Installation der neuen CASCADE PC Version stehen im CASCADE PC Installationshandbuch auf der Clearstream Website www.clearstream.com unter:

Home / Information Centre / Connectivity / CSD / CASCADE PC Installation.

2. Custody Services

2.1 OGAW IV

Durch den Regierungsentwurf des Jahressteuergesetzes 2013 und den damit einhergehenden Änderungen im Einkommenssteuergesetz, wird Clearstream Banking Frankfurt (CBF) die durch das OGAW-IV-UmsG definierten Besteuerungstatbestände um weitere Instrumente erweitern.

Weitere Änderungen betreffen die gesetzlichen Anforderungen in Bezug auf Leerverkäufe von relevanten Instrumenten zwischen zwei Kunden im Ausland.

Nähere Informationen hierzu sind der funktionalen Beschreibung OGAW IV auf der Clearstream Website www.clearstream.com zu entnehmen:

Home / Information Centre / Tax / Germany / OGAW

2.2 Einführung der SWIFT Nachrichtenformate MT564 und MT566 für die Income-Hauptzahlstelle

Mit diesem neuen, optionalen Service wird der SWIFT MT564 (inkl. REPE) und der MT566 für alle Kunden, die als Zahlstelle in den KADI-Income Terminarten (TA1xx) auftreten, eingeführt.

Hinweis: Die Einführung der Nachrichtenformate MT564 und MT566 für die Hauptzahlstelle löst den bisher erstellten SWIFT MT559 Nachrichtentyp ab. Der MT559 wird ab 17. November 2012 nicht mehr versendet. Kunden, die als Hauptzahlstelle agieren und ab 19. November 2012 den neuen MT564 / 566 für die Hauptzahlstelle beziehen möchten, müssen diesen Service explizit beantragen. Zu diesem Zweck wird ein aktualisiertes Bestellformular Nr. 83 „KADI Corporate Action Messages“ auf der Website www.clearstream.com bereit gestellt:

Home / Information Centre / Connectivity / CSD / CASCADE Forms / Custody Reports

Die Hauptmerkmale und die Prozesse zum neuen SWIFT-Service für Hauptzahlstellen entnehmen Sie bitte der detaillierten Beschreibung aller Änderungen im Zusammenhang mit dem SWIFT Release 2012 auf der Clearstream Website www.clearstream.com:

Home / Information Centre / Connectivity

2.3 Einführung des MT564 und MT566 für Lead Manager bei Tilgung in Wertpapieren (TA231)

Kunden, die bei der KADI Terminart TA231 (Tilgung in Wertpapieren) als Lead Manager agieren, erhalten durch diesen neuen Service die Möglichkeit zum Bezug einer Vorabinformation über die neu zu liefernden Wertpapiere sowie eine Bestätigung über die erfolgte Belastung der neu zu liefernden Stücke.

Die Hauptmerkmale und die Prozesse des neuen SWIFT-Service für den Lead Manager entnehmen Sie bitte der detaillierten Beschreibung aller Änderungen im Zusammenhang mit dem SWIFT Release 2012 auf der Clearstream Website www.clearstream.com.

Home / Information Centre / Connectivity

2.4 Umstellung der Verarbeitung bei Ausbuchung wertloser Zertifikate und Optionsscheine (TA222)

Mit dem SWIFT Release-Einsatz zum 17. November 2012 wird CBF die Verarbeitung bei der Ausbuchung wertlos gemeldeter Zertifikate und Optionsscheine umstellen.

Ab dann werden diese Papiere an dem Tag ausgebucht, den der Emittent als Valuta-Datum für die Fälligkeit vorgegeben hat (bisher 10 Bankarbeitstage nach dem Fälligkeitstermin). Bei fehlender Vorgabe eines Valuta-Datums kommt die heutige 10 Bankarbeitstage-Regel als Standard-Regel weiter zur Anwendung.

Bitte beachten Sie, dass es am 19. November 2012 zu einem erhöhten Volumen an Ausbuchungen (TA222) und damit zum Versand von MT564 Vorabveröffentlichung kommen kann. Durch die Umstellung der Verarbeitung werden MT564 CANC und MT564 NEWM Nachrichten zu den aktuellen Vorgängen erzeugt.

2.5 Einführung des Real Time-MT564 ab Stichtag der Kapitalmaßnahme

Mit dieser Service-Erweiterung verlängert sich der heutige Lebenszyklus der bestandsbezogenen MT564 Vorabveröffentlichung. Bisher wurden lediglich bis zum Stichtag der Kapitalmaßnahme MT564 erstellt. Zukünftig wird sogar noch am Stichtag in Echt-Zeit (Real Time) bei Änderung der Daten eines Income- oder Non-Income Events eine MT564 Vorabveröffentlichung erstellt.

Im Falle von Stornierungen und Neuabrechnungen von Vorgängen nach dem Stichtag der Kapitalmaßnahme wird ebenfalls durch den Versand einer MT564 Vorabveröffentlichung Nachricht vorab informiert.

2.5.1 Hauptmerkmale

2.5.1.1 Bestands- und Eventbasis

Der Real Time MT564 wird für alle Income- und Non Income Terminarten eingeführt, zu denen die CBF heute schon die bestandsbezogene MT564 Vorabveröffentlichung versendet. Zudem kommt der Real Time MT564 auch bei dem neuen MT564-Service für die Income-Hauptzahlstelle bzw. den Lead Manager (TA231) zur Anwendung.

Der Real Time MT564 wird auf Basis der Bestände der CBF-Teilnehmer bzw. des CBF-Gesamtbestandes für die Hauptzahlstelle bzw. den Lead Manager erstellt.

Der Real Time MT564 wird nicht für einzelne Transaktionen erstellt, d. h. die heutigen SWIFT-Services zu Transaktionen für das Claimshandling bleiben hiervon unberührt.

Kunden, die heute schon die bestandsbezogene MT564 Vorabveröffentlichung beziehen, erhalten automatisch ab 19. November 2012 den Real Time MT564 mit den gleichen Einstellungen, wie heute. Eine erneute Beantragung für die Erstellung und Versand des Real Time MT564 ist also nicht erforderlich.

Für die Übertragung des Real Time MT564 wird der gleiche Kommunikationsweg genutzt, wie für die bestandsbezogene MT564 Vorabveröffentlichung.

2.5.1.2 Kommunikationswege und -zeiten

Der Versand des Real Time MT564 ist über alle Kommunikationskanäle möglich, die heute schon für die bestandsbezogene MT564 Vorabveröffentlichung genutzt werden. Um auch für den File Transfer eine zeitnahe Übermittlung zu erreichen, wird eine zusätzliche Übertragung um 15:00 Uhr eingerichtet. Damit ergeben sich nachfolgende Kommunikationswege und Übertragungszeiten.

Kommunikationsweg	Übertragungszeiten
SWIFT-Netzwerk	Real time zwischen 7:00 und 19:00 Uhr
MQ Series	Real time zwischen 7:00 und 19:00 Uhr
File Transfer	Batch-orientiert: STD, RT-STD CONT, SDS1, SDS2, 15:00, RTS-CONT

Da bei Income-Terminarten die Verarbeitung von Stornierungen und Neu-Abrechnungen untertägig erfolgen kann, kann der Versandzeitpunkt eines Real Time MT564 und der entsprechende MT566 zur Bestätigung nach der Geldbuchung dicht aufeinander folgen oder sich sogar im Falle des File-Transfers überschneiden.

Bei File Transfer werden die innerhalb einer Datei übermittelten Nachrichten nach dem Zeitpunkt ihrer Erstellung sortiert.

Details zu den Nachrichtenformaten und -Inhalten sowie die detaillierte Beschreibung aller Änderungen in Zusammenhang mit dem SWIFT Release 2012 stehen Ihnen auf der Clearstream Website www.clearstream.com zur Verfügung:

Home / Information Centre / Connectivity

2.6 Rückzahlungen von Wertpapieren mit Zinszuwachs

Aufgrund der Änderungen bei Wertpapiermitteilung (WM) Datenservice werden Rückzahlungen von Wertpapieren mit Zinszuwachs (z. B. Bundesschatzbrief Typ B) nicht mehr mit KADI Terminart 111 (Zinszuwachs) verarbeitet. Die Zinszuwächse werden dem Rückzahlungskurs hinzugefügt. In Zukunft wird KADI diese Kapitalmaßnahmen als Rückzahlungen (KADI Terminart 13X) verarbeiten.

3. Connectivity Services

3.1 KUSTA Datenträger

Aktuell können im KUSTA Datenträger bzw. im KUSTA Datenfile nur Kontendaten von CBF Teilnehmern veröffentlicht werden, die einer Veröffentlichung explizit zugestimmt haben.

Mit Einführung des November Release 2012 wird CBF die Kontostammmnummern aller existierenden Kundenkonten veröffentlichen. Hierbei werden nur jene Daten berücksichtigt, für die die Kunden eine Zustimmung erteilt haben. Hat ein Kunde der Veröffentlichung nicht zugestimmt, wird nur die Kontonummer ohne weitere Angaben veröffentlicht.

Der Kunde kann weiterhin zwischen folgenden Alternativen wählen:

- Keine Veröffentlichung der Daten (nur Kontonummer)
- Teilweise Veröffentlichung der Daten (nur Grunddaten)
- Voll umfängliche Veröffentlichung der Daten (Gesamtdaten).

Neu: Die KUSTA Kontostammmnummer wird auch dann veröffentlicht werden, wenn der Kunde der Veröffentlichung der Daten vorher nicht zugestimmt hat. Das sich auf „NAME“ beziehende Feld wird mit der Ausprägung „UNPUBLISHED PARTICIPANT“ gefüllt und alle anderen Felder werden abhängig von der Art der Daten mit den Ausprägungen „0“ oder „_“ belegt werden.

Diese Änderung wirkt sich sowohl auf den KUSTA Datenträger als auch auf das KUSTA file auf der Clearstream Website www.clearstream.com:

Home / Information Centre / Market Reference / CSD / Reference Data / Customers listings

Des Weiteren wird im KUSTA file eine Spalte bzgl. des sich auf „VERÖFFENTLICHUNG“ beziehenden Feldes ergänzt. Das Feld kann die Werte „1 NEIN, KEINE DATEN“, „2 JA, NUR GRUNDDATEN“, „3 JA, GESAMTE DATEN“. „1 NEIN, KEINE DATEN“ und „2 JA, NUR GRUNDDATEN“ geben an, dass dieser Kunde der Veröffentlichung der vollständigen oder umfangreichen Daten widersprochen hat.

3.2 SWIFT Release 2012

Die detaillierte Beschreibung aller Änderungen im Zusammenhang mit dem SWIFT Release 2012 stehen Ihnen auf der Clearstream Website www.clearstream.com zur Verfügung:

Home / Information Centre / Connectivity

4. CBF Global Securities Financing Services

4.1 Xemac

4.1.1 Einsatz der neuen Xemac Version 5.4

Mit dem Release am 19. November 2012 setzt Clearstream Banking die Xemac® Version 5.4 ein. Diese neue Version muss von allen teilnehmenden Instituten bis zu diesem Zeitpunkt installiert sein. Der Zugriff auf Xemac 5.3 sowie auf die Vorgängerversionen wird ab diesem Zeitpunkt nicht mehr möglich sein.

Die Software der Xemac Version 5.4 wird auf der Clearstream Website www.clearstream.com unter folgendem Pfad zum Download bereitgestellt:

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

Das "Installation Manual" steht dort ebenfalls zum Download zur Verfügung.

Das genaue Bereitstellungsdatum der neuen Softwareversion wird separat bekanntgegeben.

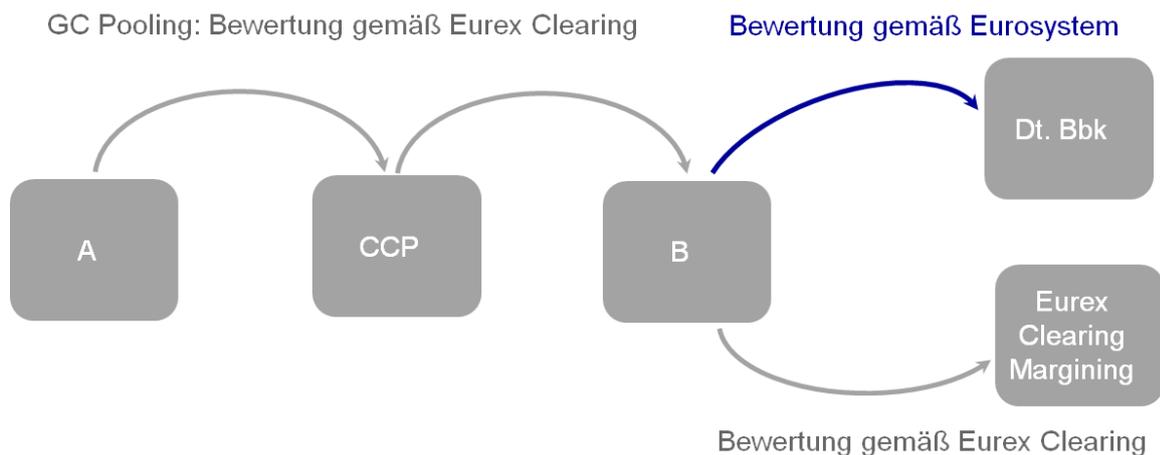
Nachstehend werden die wesentlichen Neuerungen der Xemac Version 5.4 erläutert.

4.1.2 Erweiterte Xemac Bewertungsmethoden

Ab November 2012 liefert Eurex Clearing sämtliche Haircuts und Preise zur Bewertung von GC Pooling® Positionen.

Xemac nutzt diese Neuerung, um innerhalb der Vertragsdefinitionen ein breiteres Spektrum an Bewertungsmethoden anzubieten, wodurch neue Funktionalitäten ermöglicht werden:

- Die Bewertung von Wertpapieren kann auf Basis externer Datenquellen in neuen Vertragsdefinitionen erfolgen.
- Unterschiedliche Bewertungsmethoden und Haircuts können bei der Bewertung von Sicherheitengruppen flexibel angewendet werden.
- Sicherheiten in Reuse-Forderungen, die im Rahmen von GC Pooling Transaktionen empfangen wurden, können mit einer von der Ursprungsforderung abweichenden Methode zu bewertet werden. Dieser Sachverhalt ist beispielhaft in der unten angeführten Grafik dargestellt. Dort weicht die Bewertungsmethode der Reuse-Forderung zu Gunsten der Deutschen Bundesbank von der in der Ursprungsforderung angewandten Bewertungsmethode von Eurex Clearing ab.



Kunden, die den GC Pooling Reuse nutzen, sollten stets ausreichend Sicherheiten im Pool bereithalten. Bedingt durch die beschriebenen potentiellen Abweichungen in der Bewertung von Wertpapieren (z. B. in Bezug auf Preise, Haircuts, Stückzinsen, etc.) ist somit gewährleistet, dass Substitutionen und GC Pooling Transaktionen reibungslos abgewickelt werden können.

Die Ansicht „Vertragsdefinition“ wird den Änderungen entsprechend angepasst. Die folgend angeführte Grafik zeigt eine Vertragsdefinition basierend auf der Bewertungsmethode „Eurex Clearing GC Pooling“:

The screenshot shows the '7907 - Vertragsdefinition - Anzeigen' window. The 'Bewertungsmethode' field is highlighted with a red box and set to 'Eurex Clearing GC Pooling'. Other fields include 'Zuständiges Institut: 7525', 'Vertragsdefinitions Nr: 1', 'Version: 5', 'Allokationsart: Übereignung EGC', 'Forderungsaufschlag: 1,00 %', and 'Mindestrestlaufzeit: 1 Bankarbeitstag'. The 'GCP Reuse' section is set to 'Automatisch'. The 'Concentration Limit' section has 'Limit Übergreifend' and 'Limit pro Clearer' unchecked.

Die im Rahmen der Migration erforderlichen Aktivitäten werden ausschließlich durch Clearstream Banking vor dem 19. November 2012 durchgeführt.

4.1.3 Optimierung der GC Pooling Abwicklung

Um die Abwicklungseffizienz weiter zu optimieren, werden ab dem 19. November 2012 GC Pooling Geschäfte, die in der SDS1 Massenverarbeitung nicht erfolgreich abgewickelt werden konnten, durch Eurex Clearing direkt nach SDS1 gelöscht und als RTS-DvP Transaktionen neu instruiert. Die SDS2 Massenverarbeitung wird für die Abwicklung von GC Pooling Transaktionen nicht mehr genutzt.

Die Nicht-Verfügbarkeit bestimmter Xemac-Funktionen (beispielsweise die Eingabe manueller Allokationen/Freigaben oder die Durchführung von Forderungsänderungen) bleibt daher nur noch auf den Zeitraum vor und während des SDS1 Verarbeitung beschränkt.

4.1.4 Wiederverwendung von GC Pooling Sicherheiten ("Eurex Clearing Reuse")

Seit November 2011 ist es Sicherheiten-Nehmern möglich, im Rahmen von GC Pooling erhaltene Sicherheiten zur Besicherung ihrer Margin Forderungen gegenüber der Eurex Clearing zu verwenden.

Um die Xemac Teilnehmer bei der Nutzung dieses Services zu unterstützen und zusätzlich die Abwicklung von GC Pooling Geschäften zu verbessern, bietet Xemac die Möglichkeit, automatische Herabsetzungen für Reuse-Forderungen zu Gunsten der Eurex Clearing zur Freistellung von Sicherheiten zu generieren. Die Freigabe wird bei ausreichender Besicherung der Marginanforderung durch Eurex Clearing autorisiert. Sicherheiten-Geber von GC Pooling Reuse Forderungen können diese Funktionalität in den Forderungsdetails der Detailansicht „Forderung - Bearbeiten“ aktivieren.

Zur vereinfachten Identifizierung von GC Pooling Geschäften, wird die CASCADE Auftragsreferenz in Xemac künftig in den Detailansichten „Forderung - Anzeigen“ und „Forderung - Bearbeiten“ ausgewiesen.

6335 - Forderung - Anzeigen

Eigene Forderungs Nr Forderungs Nr System 2012000123 Version 3

Eigene Vertrags Nr Vertrags Nr System 2012000100 Version 1

Xemac-Partner Forderungsdaten Bearbeitungsinfo

Vertragsdaten

Eigene Vertrags Nr Vertrags Nr System 2012000100 Version Vertrag 1

Vertragsbezeichnung ABCD - ABC BANK AG - Reuse

Forderungsdaten

Eigene Forderungs Nr

Betrag Währung EUR

Besichern ab Besichern bis

Kommentar Reuse

Steuerung

GCP Reuse

Automatische Anfrage Forderungsherabsetzung

Weitere Informationen

Auftragsreferenz

Besicherungszeitpunkt 19/11/2012 05:44:53

Sicherheitenwert EUR Deckungsgrad %

Schließen

Daneben ist die CASCADE Auftragsreferenz auch in der Anzeige und in dem Report „Historische Forderungen“ ersichtlich.

4.1.5 Sonstige Änderungen in der Benutzeroberfläche

4.1.5.1 Modifikation der Funktion „Automatische Rückgabe“

Ab November 2012 werden die Optionen der Funktionalität „Automatische Rückgabe“ zur Änderung durch die Xemac Nutzer freigegeben. Modifikationen können über „Bearbeiten“ in dem Xemac-Objekt „Kundenreferenzen“ durchgeführt werden.

Mit der Funktionalität „Automatische Rückgabe“ werden zu gewählten Zeitpunkten freie Sicherheiten mit Abwicklungsort CBL von dem Reservierungskonto auf das Ursprungskonto automatisch transferiert.

Mit Bezug auf die in Absatz 4.1.3 „Optimierung der GC Pooling Abwicklung“ beschriebene Änderung, wird der Zeitraum „Nach SDS2“ durch den Zeitpunkt „Um 14:00 Uhr“ ersetzt.

The screenshot shows a software window titled "6335 - Kundenreferenz - Anzeigen". At the top, it displays "Teilnehmer 6335 ABC BANK AG". Below this are three tabs: "Kundendaten", "Abwicklungsdaten" (which is active), and "Bearbeitungsinfo".

Under the "Abwicklungsdaten" tab, there are several sections:

- CBL**: "BIC Sicherheitengeber" with the value "ABCDEFGH".
- Reservierung**: "Reservierungskonto" with the value "12345". Below it is a checkbox for "Automatische Beschaffung".
- Automatische Rückgabe**: A section with four checkboxes: "Nach SDS1", "Um 14:00 Uhr" (which is selected and highlighted with a red box), "Um 16:00 Uhr", and "Tagesende".
- Segregierungskonto**: A text box containing the value "67890".
- ID**: "Member ID" and "Clearer ID", both with the value "ABCDE".
- Geld**: "RTGS Konto" and "Creation Geldkonto", both with empty text boxes.

At the bottom right of the window are "OK" and "Abbruch" buttons.

4.1.5.2 Änderungen in Xemac-Anzeigen

4.1.5.2.1 Ein-/Ausbuchungsaufträge: Abwicklungsdatum im „Status nicht kontrolliert“

Die tabellarische Anzeige „Status nicht kontrolliert“, wird um eine Spalte „Abwicklungsdatum“ erweitert:

6335 - Status Nicht Kontrolliert

Auftrag Ansicht Ausgabe Spalten

Filteroptionen

<Bitte wählen Sie aus> =

Zurücksetzen Filtern

	Teilnehmer Nr	Kundenreferenz	Auftragsart	Auftrags Nr	WKN	Abwicklungsort	Last-Konto	Gut-Konto	Nominale / Betrag	WKN-Kurzbezeichnung	Datum Erfassung	Abwicklungsdatum	Kommentar
1	6335		Einbuchung	54651	DE0008032004	CBF	6335 000	6335 550	1.000.000	COMMERZBANK AG O.H.	19/11/2012	19/11/2012	
2	6335		Einbuchung	726156	FR0000121501	CBF	6335 000	6335 550	5.000.000	PEUGEOT SA	19/11/2012	19/11/2012	
3	6335		Ausbuchung	7261	AT0000720008	CBF	6335 550	6335 000	10.000.000	TELEKOM AUSTRIA AG	19/11/2012	19/11/2012	

Schließen

4.1.5.3 Kundenreferenzen: Reservierungskonto in Emittentenverbindungen

Die tabellarische Anzeige „Emittentenverbindungen“ wird um eine Spalte „Reservierungskonto“ erweitert:

6335 - Emittentenverbindungen

Kundenreferenz Ansicht Ausgabe Spalten

Filteroptionen

<Bitte wählen Sie aus> =

Zurücksetzen Filtern

	Emittenten Nr	Emittenten-Name	Clearer ID	Member ID	Teilnehmer Nr	Teilnehmer Bezeichnung	Kundenreferenz	Kunde	Reservierungskonto
1	123456	ABC Bank AG	ABCDE	AAAAA	6335	ABC BANK AG	ABC BANK AG	AAAAA	Bank AAAAA 62345
2	123456	ABC Bank AG	ABCDE	ABCDE	6335	ABC BANK AG	ABC BANK AG	ABCDE	Bank ABCDE 67890
3	123456	ABC Bank AG	ABCDE	BBBBB	6335	ABC BANK AG	ABC BANK AG	BLZ BBBB	Bank BBBB 61234
4	123456	ABC Bank AG	ABCDE	CCCCC	6335	ABC BANK AG	ABC BANK AG	CCCCC	Bank CCCCC 65432

Schließen

5. Wertpapierstammdaten

Die Einführung der sogenannten EFIC Felder (Enhanced Financial Instruments Classification) durch WM (Wertpapier Mitteilungen) im Jahr 2005 hat dazu geführt, dass die WM Felder GD190 Wertpapiergruppe und GD195 Wertpapierart eingefroren wurden.

Clearstream Banking Frankfurt hat daraufhin alle betroffenen Applikationen schrittweise umgestellt.

Zum 1. Dezember 2012 wird die Umstellung der Kalkulationsgrundlage zur Ermittlung der Gebühren als letzter Umstellungsschritt erfolgen. Hierzu werden bei der Ermittlung der relevanten Depotbestände sowie bei der Kursermittlung die neuen EFIC Felder herangezogen.

Weitere Details entnehmen Sie bitte dem bis dahin angepassten 'CBF Domestic Fee Schedule'.

6. Kundensimulation

Vom 29. Oktober bis zum 16. November 2012 bieten wir unseren Kunden eine Simulationsphase für die Änderungen zum November 2012 Release. Die Simulation wird in der IMS23 Simulationsumgebung zu den dort üblichen Bedingungen eingerichtet.

Kontakt

www.clearstream.com

Veröffentlicht von

Clearstream Banking Frankfurt

Eingetragene Adresse

Clearstream Banking AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Germany

Postanschrift

Clearstream Banking AG
60485 Frankfurt /Main
Germany
