

CBF Release

Informationen zum Release

12. Mai 2014

CBF Release

Informationen zum Release

12. Mai 2014

April 2014
Dokumentnummer: F-CMG33

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 Mai 2014: Vorankündigung der Änderungen“ vom Januar 2014 stellt Ihnen die vorliegende Information umfassend und detailliert die Neuerungen vor, die am Montag, 12. Mai 2014 in folgenden Bereichen eingeführt werden:

- Cross-border Settlement
- CASCADE Online
- Custody Services
- Xemac
- Vaults Services
- Taxbox

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 Service.

Hinweis für CASCADE-PC-Nutzer: Für die Änderungen in diesem Release wird keine neue CASCADE-PC Version zur Verfügung gestellt, die aktuelle Version 7.9 kann weiterhin genutzt werden.

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

Inhalt

1.	Cross-border Settlement	5
1.1	Migration von New Global Notes (NGNs) von Konto 7535 auf Konto 4496	5
1.2	Einführung von DvP-Abwicklung für Instruktionen mit CBL-Kontrahenten	5
1.3	Übertragungsgrund wird Pflichtfeld in Instruktionen gegen Konto 4496	6
1.4	Einführung von Pre-Matching für Instruktionen mit CBL-Kontrahenten	6
1.5	Einführung neuer Match-Fehlermeldungen („Match Error Codes“)	6
2.	CASCADE Online	8
2.1	Neue Selektionskriterien bei Eingabe der ISIN in der Anzeige KNZI ID	8
2.2	Ausweitung der Datenspeicherung in der KNZI Anzeige	8
3.	Custody Services	9
3.1	Market Claims bei Zinszahlungen	9
3.2	Erweiterungen zu den SWIFT MT564 Services	10
4.	Xemac	11
4.1	Einsatz der neuen optionalen Xemac Version 5.5.1	11
4.2	Erweiterungen in Xemac Reports/Ansichten	11
4.3	Prozess-Erweiterung für verpfändete GC Pooling Papiere	11
4.4	Erweiterungen im Reporting	11
5.	Vaults Services	15
5.1	Vorbelegung der Besonderheiten in CASCADE Auftragsart 16	15
	Erlaubte Stückespezifische Besonderheiten bei online Eingabe (KVEW – EL, - NV)	17
6.	Taxbox	19
6.1	Einführung des VVT-Datums (Verlustverrechnungstopf)	19
6.2	Abschaffung des Feldes für die TIN (Tax Identification Number)	19

1. Cross-border Settlement

Folgende Änderungen werden zum Montag, 12. Mai 2014 eingesetzt:

1.1 Migration von New Global Notes (NGNs) von Konto 7535 auf Konto 4496

Die heute über das Konto 7535 der Clearstream Banking S.A. (CBL) bei CBF zugelassenen XS-Gattungen (New Global Notes – NGNs) werden auf das Konto 4496 der CBL bei CBF migriert.

Somit können ab 12. Mai 2014 folgende Cross-border-Transaktionen über das Gegenkonto 4496 abgewickelt werden, für die im Rahmen der Erweiterung des Links teilweise unterschiedliche Abwicklungsprozesse implementiert werden:

- Transaktionen mit Kontrahenten bei Euroclear Finland:
Free-of-Payment (FoP)-Transaktionen in finnischen Wertpapieren
- Transaktionen mit Kontrahenten bei CBL:
FoP- und ab dem 12. Mai 2014 auch Delivery versus Payment (DvP)-Transaktionen in den oben genannten XS-ISINs (neu) und finnischen Wertpapieren

Das Konto 7535 wird nach dem 10. Mai 2014 deaktiviert. Instruktionen gegen das Konto 7535 mit Settlement-Datum einschließlich 9. Mai 2014 können bis Freitag, 9. Mai 2014 eingegeben werden. Gutschriften auf Konto 7535, die wegen fehlender Erhaltinstruktionen in Creation dort nicht zeitgleich abgewickelt werden können, werden von CBF am 9. Mai 2014 um 16:00 Uhr auf das Auftraggeberkonto in CASCADE zurückgebucht. Offene Transaktionen (matched und unmatched) mit Settlement-Datum nach dem 9. Mai 2014 gegen Konto 7535 müssen im Rahmen der Migration seitens der Kunden gelöscht und am Montag, 12. Mai 2014 gegen Konto 4496 neu eingestellt werden.

Hinweis: Bisher war es möglich, finnische Wertpapiergattungen auch über das Konto 7201 an CBL-Kontrahenten zu liefern. Ab Ende Mai wird CBL finnische Gattungen von CBF nur noch über das Konto 4496 von CBF annehmen.

Im Rahmen dieser Migration treten folgende weitere Änderungen in Kraft:

1.2 Einführung von DvP-Abwicklung für Instruktionen mit CBL-Kontrahenten

Für Transaktionen mit CBL-Kontrahenten über diesen Link wird die DvP-Abwicklung gegen EUR eingeführt. Die Geldabwicklung erfolgt im Rahmen des RTS-DvP-Abwicklungsprozesses über TARGET2 (ASI Prozedur 2) auf Bruttobasis pro Transaktion über die RTGS-Konten.

Zur Unterstützung des Geldverrechnungsprozesses mit CBL wird für die Abwicklung von DvP-Transaktionen ein gesondertes Cash Market Unterkonto (CMA – nnnn 270) benötigt. Ein entsprechendes Kontoeröffnungsformular wird demnächst auf der Clearstream Website www.clearstream.com unter Information Centre / Customer Information / Account Opening Forms / [Cash-related CASCADE Forms](#) zur Verfügung gestellt.

DvP-Instruktionen gegen das Konto 4496 können erstmalig am 12. Mai 2014 angenommen werden.

Die Abwicklungszeiten für die Transaktionen mit CBL-Kontrahenten werden wie folgt festgelegt:

FoP/DvP	Aktuelle Deadline	Zukünftige Deadline
FoP-Transaktionen	Settlement Tag 17:15 Uhr	Settlement Tag 17:15 Uhr (unverändert)
DvP-Transaktionen	n/a	Settlement Tag 14:30 Uhr (nur RTS DvP)

1.3 Übertragungsgrund wird Pflichtfeld in Instruktionen gegen Konto 4496

Um Instruktionen für Transaktionen mit Kontrahenten bei Euroclear Finland und CBL unterscheiden zu können, wird als entsprechendes Kriterium der Übertragungsgrund als Pflichtfeld für alle Aufträge gegen das Konto 4496 eingeführt:

- Übertragungsgrund 221 für Transaktionen mit finnischen Kontrahenten in finnischen ISINs
MT540 – MT543:
:70E::DECL///SETR 221
- Übertragungsgrund 220 für Transaktionen mit CBL-Kontrahenten in von CBL emittierten XS-ISINs und finnischen ISINs
MT540 – MT543:
:70E::DECL///SETR 220

Aufträge, die ab 10. Mai 2014 (ca. 05:30 Uhr) gegen das Konto 4496 erteilt werden und keinen Übertragungsgrund enthalten, werden abgelehnt.

Für Aufträge gegen das Konto 4496, die zum Tagesende am 9. Mai 2014 offen sind und keinen Übertragungsgrund enthalten, setzt CBF automatisch den bisherigen Default-Übertragungsgrund 221, d.h. Kunden müssen diese Transaktionen nicht neu instruieren. Transaktionen mit CBL-Kontrahenten sind davon nicht betroffen, weil sie bereits heute den Übertragungsgrund 220 ausweisen müssen.

1.4 Einführung von Pre-Matching für Instruktionen mit CBL-Kontrahenten

Für Transaktionen gegen das Konto 4496, bei denen ein CBL-Kunde Kontrahent ist, wird ein Pre-Matching eingeführt, d.h. zukünftig werden die Instruktionen umgehend nach erfolgreicher Instruktionerteilung an CBL zum Matching weitergeleitet. Dies ermöglicht eine zeitnahe Rückmeldung über den Matchstatus einer Instruktion an den Kunden.

Das Matching-Verfahren für Transaktionen mit Kontrahenten bei Euroclear Finland bleibt unverändert. Für diese Transaktionen werden wie bisher die Regeln des finnischen Markts angewendet, d.h. die CBF-Instruktionen werden erst am Settlement Tag nach erfolgreicher CBF-interner Disposition an CBL weitergeleitet und erst dort gematcht.

1.5 Einführung neuer Match-Fehlermeldungen („Match Error Codes“)

Für alle oben beschriebenen Transaktionsarten werden zukünftig den CBF-Kunden die Gründe für ein fehlgeschlagenes Matching auf Kontrahentenseite (CBL und Euroclear Finland) mitgeteilt. Diese Match-Fehlermeldungen (Match Error Codes) werden innerhalb des Match-Status in den entsprechenden CASCADE Online Masken (KVAI) und in den Statusnachrichten per SWIFT, MQSeries oder File Transfer im Rahmen der bereits heute bestehenden Match-Error Meldungen ausgewiesen.

Die zusätzlichen Match-Fehlermeldungen können von Kunden im Match-Dienst auch Kontrahenten-Instruktionen zugeordnet werden, die gegen andere CBF-Konten abgewickelt werden:

CASCADE Matching Error Code	Beschreibung
60	Abweichender Settlement-Markt
61	Abweichende Depotbank
62	Mögliches Duplikat
63	Abweichendes Settlement System/Period
70	Abweichende Zahlungstyp (mit Einsatz T2S)
71	Abweichende Wertpapier Richtung (mit Einsatz T2S)
72	Abweichende Geld Richtung (mit Einsatz T2S)
73	Abweichender Lieferer CSD (mit Einsatz T2S)
74	Abweichender Empfänger CSD (mit Einsatz T2S)
75	Abweichendes opt out flag (mit Einsatz T2S)
76	Abweichendes cum/ex flag (mit Einsatz T2S)
77	Abweichende Common Trade reference (mit Einsatz T2S)
78	Abweichender Kunde des Lieferers (mit Einsatz T2S)
79	Abweichender Kunde des Empfängers (mit Einsatz T2S)
80	Abweichender Lieferer SAC (mit Einsatz T2S)
81	Abweichender Empfänger SAC (mit Einsatz T2S)
82	Sonstige Abweichung, Absprache mit dem Kontrahenten notwendig

Hinweis: Einige der oben aufgeführten neuen Match-Fehler sind bereits in Vorbereitung auf T2S aufgenommen worden. Sie können deshalb erst nach der Migration auf T2S sinnvoll genutzt werden.

Hinweis für CASCADE-PC Nutzer: In diesem Release sind diese Fehlermeldungen nur auf Deutsch ausgewiesen, da kein CASCADE-PC Release für das Mai Release vorgesehen ist, d.h. die englischen Fehlermeldungen werden erst mit dem November Release 2014 in CASCADE-PC verfügbar sein.

2. CASCADE Online

2.1 Neue Selektionskriterien bei Eingabe der ISIN in der Anzeige KNZI ID

Heute können Kunden in der CASCADE Anzeigemaske „Detail Instruktionen für DD-Verarbeitung“ (KNZI-ID) Geldumsätze aus Erträniszahlungen (Dividenden, Zinsen, etc.) durch die Eingabe der entsprechenden ISIN gezielt abrufen. Die Abfrage kann in diesem Fall zurzeit jedoch nicht durch die Eingabe weiterer Selektionskriterien (z.B. auf Market Claims, Storno etc.) eingeschränkt werden.

Ab 12. Mai 2014 werden weitere Selektionskriterien eingeführt, die in Verbindung mit der Eingabe der ISIN eine noch zielgenauere Abfrage von Geldumsätzen ermöglichen:

- Verarbeitungslauf
- Paketnummer
- Buchungstext
- Lauf-Nr.
- Terminart

Hinweis: Der Abruf von Geldumsätzen nach ISIN ist nur für automatisch generierte Zahlungen möglich. Manuelle Zahlungen sind nicht enthalten.

2.2 Ausweitung der Datenspeicherung in der KNZI Anzeige

Heute stehen historische Geldumsatzdaten in den KNZI Anzeigen für alle Funktionscodes (ID, IN, IK, IS) sechs Monate online zum Abruf bereit. Ab 12. Mai 2014 wird der Zeitraum, in dem die Daten in den KNZI-Anzeigen vorgehalten werden, allmählich auf zwei Jahre ausgeweitet. Die Daten werden nach sechs Monaten nicht mehr aus der Online-Anzeige entfernt, sondern für weitere 18 Monate zum Abruf bereitgehalten. Der volle Zeitraum von zwei Jahren, in dem historische Daten zur Verfügung stehen, wird ca. 18 Monaten nach dem Release erreicht sein. Ab dann werden Daten, die älter als zwei Jahre sind, aus der Anzeige entfernt.

Hinweis: Daten können weiterhin pro Abfrage jeweils nur für einen Zeitraum von vier Wochen aufgerufen werden. Werden Daten für einen größeren Zeitraum benötigt, kann das über mehrere Abfragen von jeweils 4-Wochen-Perioden erreicht werden.

3. Custody Services

Im Mai Release stehen im Bereich Corporate Actions weitere Erweiterungen im Bereich Transaction Management (Market Claims und Transformationen) an. Da diese Verbesserungen auch im Zusammenhang mit der Einführung der T2S Settlement-Plattform stehen, bilden die Standards der Corporate Action Joint Working Group (CAJWG) sowie der T2S Corporate Action Sub Group (CASG) die Basis.

Im Mai Release wird zunächst eine wichtige Verbesserung bei **Market Claims für Zinszahlungen** vorgenommen; hier wird zukünftig unterschieden zwischen sogenannten **Flat Anleihen** und Anleihen, die der Stückzinsberechnung unterliegen. Bei Flat Anleihen wird die Market Claim Logik von Dividendenzahlungen übernommen.

Im November Release 2014 sollen weitere Transformationen offener OTC- und Börsengeschäfte in Geld folgen. Hierbei werden zusätzliche obligatorische Reorganisations-Events, wie z. B. Rückzahlungen, für den Transformationsprozess herangezogen.

Mit Einführung dieser Erweiterungen ist der CBF Transaction Management Service der CBF nahezu vollständig den Standard-Anforderungen der CAJWG/CASG angepasst. Die Komplettierung findet dann mit der CBF-Anbindung an T2S (Welle 3 im September 2016) mit der Berücksichtigung des Opt-Out Flags (Kunden Transaktionskennzeichen) bei der Market Claim- und Transformations-Verarbeitung statt.

3.1 Market Claims bei Zinszahlungen

Bei Market Claims für Zinszahlungen wird zukünftig unterschieden zwischen sogenannten Flat Anleihen und Anleihen, die der Stückzinsberechnung unterliegen. Bei Flat Anleihen wird die Market Claim Logik von Dividendenzahlungen übernommen. Dies betrifft alle Instrumente in Girosammelverwahrung.

Es handelt sich um eine Flat Anleihe mit möglichen Zinszahlungen, wenn eine der folgenden WSS Stammdatenbedingungen erfüllt ist.

- WSS Feld Wert GD311B (Sonderheiten bei Stückzinsberechnung) = 01 (Flat)
- WSS Feld Wert GD311B (Sonderheiten bei Stückzinsberechnung) = 02 (x-flat, dirty price)
- WSS Feld Wert GD311B (Sonderheiten bei Stückzinsberechnung) = 07 (Keine Stückzinsen)
- WSS Feld Wert GD821B (Zinsberechnungsmethode) = 99 (Keine Zinsberechnungsmethode)

Ist der Stichtag einer Zinszahlung (CBF KADI Terminart 110) erreicht und wird die Event ISIN gemäß oben genannter Kriterien als Flat Anleihe identifiziert, hat dies folgende Konsequenzen für die Verarbeitung:

- Die Zinszahlung hat einen Ex-Tag, der auch im MT564/566 von CBF gemeldet wird. Der Ex-Tag fällt auf den Stichtag/Trenntermin + 1 Bankarbeitstag; dieser wird ggf. von WM so gemeldet und von CBF auf Basis des Stichtags ermittelt. Somit können Zinszahlungen für Flat Anleihen durch die Belegung des Ex-Tags (SWIFT Feld 98A XDTE) von anderen Zinszahlungen unterschieden werden; im Detail können folgende MT56X Felder zur eindeutigen Identifizierung herangezogen werden:
 - Feld 20C CORP ist mit "110" in den ersten drei Stellen belegt.
 - Feld 22F CAEV hat den Wert INTR.
 - Feld 98A XDTE ist belegt.
- Die Market Claim Logik gemäß Dividenden wird angewendet: Alle cum gehandelten OTC- und Börsengeschäfte, die innerhalb der 20-tägigen Market Claim Periode nach dem Stichtag reguliert werden, werden automatisch von CBF vom Verkäufer an den Käufer kompensiert.
Hinweis: Flat Anleihen sind zurzeit nicht CCP fähig.

Handelt es sich nicht um eine Flat Anleihe, dann erfolgt keine Ex-Tag Festlegung, und somit wird auch nicht die Market Claim Logik für Dividenden angewendet. Ab dem Release-Einsatz wird auch kein Ex-Tag mehr in der SWIFT-Nachricht angezeigt. Stattdessen werden nur verspätet regulierte Börsengeschäfte (CCP und LION, sogenannte late trades) gemäß heutiger Regel kompensiert.

Das SWIFT Reporting folgt dem Standard Reporting für Market Claims (MT564 REPE ACLA und MT566 CLAI). Am Event Stichtag (SWIFT Feld 98A RDTE) wird ein MT564 REPE (22F ADDB = ACLA) nach Identifizierung eines anstehenden Market Claims mit den Details zu dem jeweiligen Geschäft erstellt. Der MT564 REPE kann optional von den Kunden bezogen werden.

Die heutigen Market Claim Regeln bei Zins- und Dividendenzahlungen sind im Kompensations-Handbuch ausführlich beschrieben (siehe Clearstream [Website www.clearstream.com](http://www.clearstream.com) unter Information Centre / Market Reference / CSD Information / Compensations and Giovannini Barrier 3 / [Handbuch Kompensation](#)).

3.2 Erweiterungen zu den SWIFT MT564 Services

3.2.1 Einführung des Corporate Action Event Indicators "PRIO" (Priority Offers)

CBF versendet zukünftig MT564 Notifikationen mit 22F::CAEV//PRIO in der Terminart 280 für folgende Kapitalmaßnahmen:

- Vorzugs-/Vorrechtszeichnung (ohne Bezugsrecht)
- Kapitalerhöhung gegen Sacheinlagen (ohne Bezugsrecht)
- Zeichnungsangebot (ohne Bezugsrecht)
- Bezugsangebot (ohne Bezugsrecht)

3.2.2 Verlängerung des MT564 Lifecycle um 10 Bankarbeitstage

CBF verlängert den Lifecycle der MT564 Notifikationen für Bezugsrechtsangebote und Umtauschangebote (Terminart 280) auf zehn Bankarbeitstage nach Ende der Bezugsfrist bzw. Umtauschfrist. Dadurch werden Kunden auch bei späten Eventinformationen noch mit dem MT564 informiert.

3.2.3 Einführung des MT564 für Kapitalmaßnahmen, die nicht durch CBF verarbeitet werden

CBF führt den MT564 auch für solche Kapitalmaßnahmen (Terminart 280) ein, die von CBF nicht abgewickelt werden. Derartige MT564 Notifikationen können anhand nachfolgender Merkmale identifiziert werden:

- Die MT564 Nachrichten werden grundsätzlich als "unbestätigt" versendet (25D::PROC//PREU).
- In jeder E-Sequenz wird der Indikator 22F::OPTF//NOSE (no service offered) ausgewiesen.

3.2.4 Anpassung des Eventstatus im MT564 an den Status der WM-Meldung

CBF versendet heute MT564 Notifikationen zu deutschen Ertragniszahlungen grundsätzlich mit dem Status "complete" (25D::PROC//COMP). Zukünftig erfolgt die Statusanzeige im MT564 in Abhängigkeit zu dem von den Wertpapiermitteilungen gemeldeten "Status Inhalt".

Je nach Event muss in einem der folgenden „Status Inhalt“-Felder

- ED002A Erträge
- VD002A Tilgung
- UD002A Umtausch

der Wert 2, 3 oder 4 gepflegt sein, damit der MT564 als Complete versendet wird (25D::PROC//COMP). Bei Wert 1 wird der MT564 als unbestätigt versendet (25D::PROC//PREU).

So wird z.B. zukünftig eine steuerfreie Ausschüttung aus dem steuerlichen Einlagekonto gemäß §27 KStG unter Berücksichtigung der German Market Practice zunächst als MT564 NEWM DVCA (PREU) und dann final als MT564 REPL SHPR (COMP) gemeldet, wenn die Steuerfreiheit nicht zu Beginn des Event Lifecycles feststeht.

4. Xemac

4.1 Einsatz der neuen optionalen Xemac Version 5.5.1

Mit dem Release am 12. Mai 2014 setzt Clearstream Banking die Xemac® Version 5.5.1 ein. Diese neue Version kann von allen teilnehmenden Instituten ab diesem Zeitpunkt verwendet werden. Der Zugriff auf Xemac 5.5 wird ab diesem Zeitpunkt aber weiterhin möglich sein.

Die Software der Xemac Version 5.5.1 wird ab Montag, 28. April 2014 auf der Clearstream Website www.clearstream.com unter Information Centre / Global Securities Financing / Collateral Management / Xemac / [Xemac Technical Specifications](#) zum Download bereitgestellt.

Das "Installation Manual" steht dort ebenfalls zur Verfügung.

4.2 Erweiterungen in Xemac Reports/Ansichten

Die Summenbildung in den Reports "Sicherheitenpool", "Sicherheitenpool pro KRef", sowie „Detaillierter Forderungsbetrag CMSI“ wurde korrigiert; die Reports weisen nun wieder die korrekten Summen aus.

Die Ansichten „Sicherheitenbestand“, „Sicherheitenübersicht“ und „Allokierte Sicherheiten“ erfordern einen Filter, um eine Darstellung sehr großer Datenmengen zu ermöglichen. Als Filter können Kundenreferenz, Kontrahent, WKN (ISIN) und Abwicklungsort gewählt werden, bevor die Ansicht erzeugt wird.

Die Filterfunktion kann im Tab „Einstellungen“ aktiviert und deaktiviert werden. Als Grundeinstellung ist der Filter aktiv.

4.3 Prozess-Erweiterung für verpfändete GC Pooling Papiere

Papiere, die im Rahmen von Euro GC Pooling erworben und an die Deutsche Bundesbank verpfändet wurden (sog. „T“-Papiere), unterliegen bei einer Zinsausschüttung sowohl der vollständigen Kompensation als auch ggf. einem Einbehalt der Geldzahlung im Falle einer Forderungs-Untersicherung.

Um eine temporäre Doppelbelastung der Kunden zu vermeiden, wird im Falle einer Einbehaltung der Geldzahlung für „T“-Papiere der Betrag parallel zusätzlich vom CCP-Konto eingezogen und nach Zahlungsfreigabe seitens der Bundesbank wieder an den CCP ausgeschüttet.

4.4 Erweiterungen im Reporting

Das Reporting der durch die Einführung der neuen Cash-Prozesse ausgelösten Geldebuchungen (siehe Xemac-Kundenmitteilung [D14007](#) vom 4. Februar 2014) wird erweitert.

- Es werden nun auch die Zahlungsfreigaben mit dedizierten Buchungstext-Schlüsseln ausgewiesen.

4.4.1 Änderungen im MT564 REPE und MT566

Zahlungsfreigaben werden in den Reports MT564 REPE Corporate Action Notification und MT566 Corporate Action Confirmation wie folgt gemeldet:

- Im Feld :20C::RELA wird die Xemac Forderungsnummer ausgewiesen.
- Das Feld :22F::ADDB//CLAI findet keine Anwendung.
- Im freien Textfeld :70E::ADTX wird neben dem Text "NCB-TERMINATION" auch die KADI Lauf-Nummer ausgewiesen.

Buchungen gegen das CCP-Konto (Gut- oder Lastschrift) folgen der gleichen Logik:

- Einbehaltene Zahlungen werden im freien Textfeld :70E::ADTX mit dem Text "NCB-SUSPENSION" und der KADI Lauf-Nummer ausgewiesen.
- Zahlungsfreigaben werden im freien Textfeld :70E::ADTX mit dem Text "NCB-TERMINATION" und der KADI Lauf-Nummer ausgewiesen.

Weitere Informationen zu den Nachrichtentypen finden sich im CBF Connectivity Handbook Part 3 auf der Clearstream Website www.clearstream.com unter Information Centre / Connectivity / CSD / [CASCADE via File Transfer/SWIFT/MQ](#).

- Einbehaltene Geldbeträge für „T“-Papiere werden vom CCP-Konto eingezogen und wie folgt ausgewiesen:

CLEARSTREAM BANKING AG				
MERGENTHALERALLEE 61				
65760 ESCHBORN				
TESTBANK AG				
POSTFACH 12 34 56				
D 60101 FRANKFURT AM MAIN			ESCHBORN, 28.01.2014	
			TELEFON	+49-69-211-11177
			FAX	+49-69-211-13701
PROGRAMMNAME: KD111				
KONTO-NR : 6335				
ZINSEN				
AUF ALLE NACHFOLGEND AUFGEFUEHRTEN VERPFÄNDUNGEN IN XEMAC				
WURDEN DIE ANFALLENDEN KADI-ZAHLUNGEN GEMAESS AUFTRAG DES SICHERHEITEN-				
NEHMERS FREIGEgeben.				
CBF-STICHTAG : 28.01.2014				
FAELLIGKEITSTAG : 29.01.2014				
WKN : DE000A1EMEN8 ZINSEN : 0,175822222222 %				
FORDERUNGSNR	TYP	KONTRAHENT	NOMINALE	NETTO-BETRAG EUR
2005000031	E	7908	100.000.000,000	175.822,22
2005000031	T	7908	25.000.000,000	43.955,56
2005000031	T	7525	25.000.000,000-	43.955,56-
SUMME PRO WKN				175.822,22 EUR
NETTOBETRAG	SICHERHEITENNEHMER			0,00 EUR
NETTOBETRAG	SICHERHEITENGEBER			175.822,22 EUR
VERRECHNEN WIR AM 29.01.2014 IN DD1				

4.4.3 Online Anzeige über KNZI

Die Geldebuchungen werden online unter KNZI mit spezifischem Buchungstext-Schlüssel angezeigt:

TXT	Beschreibung	Kurzbeschreibung
327	Auszahlungsfreigabe w/ Xemac DECA	Aus.Frei.w/Xemac
328	Auszahlungsstopp w/ GCP Kompensation	Aus.Stopp w/GCP Komp
329	Auszahlungsfreigabe w/ GCP Kompensation	Aus.Frei w/GCP Komp

5. Vaults Services

Die Vorbelegungen der stückespezifischen Besonderheiten bei der CASCADE Auftragserteilung in der Auftragsart 16 „KVEW – NV“ (Neuzulassungen) werden ab 12. Mai 2014 in geänderter Form vorgenommen. Eine optionale Eingabe durch den Kunden ist gemäß Tabelle „Stückespezifische Besonderheiten“ (Tabelle CKC9T03) sowohl online als auch via SWIFT, File Transfer und MQSeries (MT540) möglich.

5.1 Vorbelegung der Besonderheiten in CASCADE Auftragsart 16

Sofern von CBF Kunden keine Vorgaben zu dem Feld „stückespezifische Besonderheiten“ in der online Erfassung oder Auftragserteilung via LIMA (MT540) gemacht wurden, werden bei Neuzulassungen folgende Vorbelegungen automatisch vorgenommen:

Bedingung	Vorbelegung mit Schlüssel stückespezifische Besonderheit „alt“	Vorbelegung mit Schlüssel stückespezifische Besonderheit „neu“
Globalbonds (KV-Lagerland = 998)	Besonderheit 42 „Globalbonds“	Besonderheit 57 „Globalbonds ohne Bogen“
RS-Gattungen Verwahrmöglichkeit 14	Besonderheit 13 „Rahmenurkunde bis zu“	Besonderheit 55 „Rahmenurkunde ohne Bogen“
RS-Gattungen Verwahrmöglichkeit 15	Besonderheit 44 „IGL bis zu“	Besonderheit 48 „IGL ohne Bogen“
RS-Gattungen Verwahrmöglichkeit 16	Besonderheit 10 „technische Globalurkunde bis zu“	Besonderheit 23 techn.Globalurk.o..Bog. (lieferbar)
TEFRA D Anleihen	Besonderheit 13 „Rahmenurkunde bis zu“	Besonderheit 55 „Rahmenurkunde ohne Bogen“
Lieferungen in der Einlieferungsart 2 Verwahrmöglichkeit 1,2	Besonderheit 45 „Jungschein“	Besonderheit 26 „Jungschein ohne Bogen“
Lieferungen in der Einlieferungsart 2 Verwahrmöglichkeit 5	Besonderheit 43 „IGL“	Besonderheit 48 „IGL ohne Bogen“
Lieferungen in der Einlieferungsart 2 Verwahrmöglichkeit 9, 16	Keine Vorbelegung	Keine Vorbelegung
Lieferungen in der Einlieferungsart 2 sonstige Verwahrmöglichkeiten	Besonderheit 12 „Dauerglobalurkunde“	Besonderheit 53 „Dauerglobalurkunde ohne Bogen“
Lieferungen in der Einlieferungsart 3 und 4 Verwahrmöglichkeit 9,16	Besonderheit 10 „technische Globalurkunde bis zu“	Besonderheit 23 techn.globalurk.o..bog. (lieferbar)
Lieferungen in der Einlieferungsart 3 und 4 Verwahrmöglichkeit 1,2	Besonderheit 46 „Jungschein bis zu“	Besonderheit 26 „Jungschein ohne Bogen“
Lieferungen in der Einlieferungsart 3 und 4 Verwahrmöglichkeit 5,15	Besonderheit 44 „IGL bis zu“	Besonderheit 48 „IGL ohne Bogen“

Bedingung	Vorbelegung mit Schlüssel stückespezifische Besonderheit „alt“	Vorbelegung mit Schlüssel stückespezifische Besonderheit „neu“
Lieferungen in der Einlieferungsart 3 und 4 sonstige Verwahrmöglichkeit	Besonderheit 13 "Rahmenurkunde bis zu"	Besonderheit 55 „Rahmenurkunde ohne Bogen“

Für CBF-Kunden wird das Feld „stückespezifische Besonderheit“

- in der online Erfassung über KVEW NV
- in der online Änderung KVEB
- in der Auftragserteilung via SWIFT, MQ Series und File Transfer (MT540)

somit wieder optional verfügbar.

Für CBF-Kunden, die zur Auftragserteilung den EDT-Services (Premium) nutzen und somit die Besonderheiten nicht spezifizieren können, erfolgt die Vorbelegung nach den oben genannten Bedingungen.

Erlaubte Stückespezifische Besonderheiten bei online Eingabe (KVEW – EL, - NV)

In der folgenden Tabelle werden die erlaubten Kennzeichen (KZ) für stückespezifische Besonderheiten, je nach laufender Einlieferung oder Neuzulassung, dargestellt:

KZ-Besonderheiten:

KZ	Erläuterung	Erlaubt Neuzulassung	Erlaubt Lfd. Einl.
1	NORMALER BLOCK	N	N
2	BOGENLOS	J	J
3	NUR MANTEL, KEIN BOGENAUSDRUCK	J	J
4	EINZELURKUNDE, MANTEL/GLOBALBOGEN	N	J
5	MANTEL, BOGEN, ZESSION	N	J
6	MANTEL, TALON, ZESSION	N	J
7	BLOCK MANUELL ERFASST	N	N
8	BLOCK AUS HANDBESTAND	N	N
9	EINZELURKUNDE, GLOBALMANTEL/EINZELBOGEN	N	J
11	ALTE URKUNDEN	N	J
14	M + B GETRENNT	N	J
15	NUR MANTEL	J	J
16	UNIKAT	J	J
17	UNITS	J	N
18	CF- UND K-STUKKEN	J	J
19	CF-STUKKEN	J	J
20	TECHN.GLOBALURK. M.BOG. (MAN.ERST.)	J	J
21	TECHN.GLOBALURK. O.BOG. (MAN.ERST.)	J	J
22	TECHN.GLOBALURK. M.BOG. (LIEFERBAR)	J	J
23	TECHN.GLOBALURK. O.BOG. (LIEFERBAR)	J	J
24	MIT BOGEN	J	N
25	OHNE BOGEN	J	N
26	JGS OHNE BOGEN	J	N
27	FESTSCHREIBUNG	N	J
28	NUR BOGEN	J	J

KZ	Erläuterung	Erlaubt Neuzulassung	Erlaubt Lfd. Einl.
29	MANTEL,ZESSION	N	N
30	BOGEN, ZESSION	N	N
31	MANTEL,BOGEN,ZESSION,ABTRETUNG(en)	N	N
32	MANTEL,ZESSION,ABTRETUNG(EN)	N	N
33	BOGEN,ZESSION,ABTRETUNG(EN)	N	N
34	ZESSION,ABTRETUNG(EN)	N	N
35	ZESSION	N	N
36	ABTRETUNG(EN)	N	N
37	MIT GEWINNANTEILSSCHEIN	N	N
38	MÖGLICHER BEZUG VON URKUNDEN	N	N
39	KEIN ZINSEN- /DIVIDENTENDIENST	N	N
40	KEIN ZINSSCHEIN / TALON	J	J
41	NUR TALON	J	J
47	IGL MIT BOGEN	J	N
48	IGL OHNE BOGEN	J	N
49	JUNGSCHHEIN MIT BOGEN	J	N
50	NICHT VALUTIERT	N	N
52	DAUERGLOBALURKUNDE MIT BOGEN	J	N
53	DAUERGLOBALURKUNDE OHNE BOGEN	J	N
54	RAHMENURKUNDE MIT BOGEN	J	N
55	RAHMENURKUNDE OHNE BOGEN	J	N
56	GLOBALBONDS MIT BOGEN	J	N
57	GLOBALBONDS OHNE BOGEN	J	N
97	UMDEUTUNG GU/RU	N	N
98	UMDEUTUNG WG. 670	N	N

6. Taxbox

6.1 Einführung des VVT-Datums (Verlustverrechnungstopf)

Innerhalb des Taxbox-Hauptblocks von eingehenden und ausgehenden Nachrichten wird das optionale Feld „VVT-Datum“ (Verlustverrechnungstopf) eingeführt. Hier kann abweichend von dem aktuellen Versanddatum das Datum angegeben werden, für das der Verlustverrechnungstopf gültig sein soll. Das Datum wird im folgenden Format angegeben:

XML-Tag:

<VvtDt>JJJJMMTT</VvtDt> - Das Datum muss in der Vergangenheit liegen.

Entsprechende Plausibilitätsprüfungen werden von CBF durchgeführt und führen zu einer Ablehnung der bei CBF eingehenden Nachricht, wenn der Inhalt oder das Format des Feldes nicht dem Standard entsprechen.

6.2 Abschaffung des Feldes für die TIN (Tax Identification Number)

Das Feld „TIN“ im Hauptblock der Taxbox-Nachrichten wird auf Grund datenschutzrechtlicher Bedenken deaktiviert, jedoch noch nicht ganz aus dem Satzaufbau entfernt. So können Kunden auch weiterhin optional die TIN in ihren Nachrichten angeben. Der Inhalt des Feldes wird jedoch von CBF ignoriert, d.h. nicht in der CBF-internen Nachrichtendatenbank gespeichert und somit nicht an den Empfänger der Nachricht weitergeleitet.

Die Angabe der TIN führt jedoch nicht zu einer Ablehnung der Nachricht.

Das [Taxbox-Handbuch Connectivity](#) wurde entsprechend aktualisiert.

Kontakt

www.clearstream.com

Veröffentlicht von

Clearstream Banking Frankfurt

Eingetragene Adresse

Clearstream Banking AG

Mergenthalerallee 61

65760 Eschborn

Deutschland

Postanschrift

Clearstream Banking AG

60485 Frankfurt /Main

Deutschland
