

Information zu den funktionalen Anpassungen für die Euroclear Märkte Frankreich, Niederlande und Belgien auf T2S

Clearstream Banking AG, Frankfurt¹ informiert die Kunden über die Gültigkeit der im November 2015 kommunizierten funktionalen Anpassungen für die Migration der Euroclear-Märkte auf TARGET2-Securities (T2S) am

Montag, 12. September 2016

Der Migrationstermin der Märkte Euroclear Frankreich (EF), Euroclear Niederlande (ENL) und Euroclear Belgien (EBE) soll durch die Gremien bis Ende März bestätigt werden. Darüber hinaus wurde damit begonnen, die funktionalen Anpassungen in bilateralen Tests zwischen CBF und Euroclear zu validieren. Nachfolgend ist beschrieben, welche der im November 2015 bekannt gegebenen funktionalen Anpassungen weiterhin Gültigkeit besitzen und bei welchen Teilaspekten sich zwischenzeitliche Änderungen ergeben haben. Es ist erforderlich, dass diese Details in den Prozessen unserer Kunden für den Produktionsstart sowie in Teilen gegebenenfalls für die im Mai 2016 stattfindende Kundensimulation der T2S Welle 3 berücksichtigt werden.

Gültigkeit der kommunizierten funktionale Anpassungen

Folgende funktionalen Anpassungen bleiben für die Kunden, die bereits den existierenden CBF Cross-Border Link zu den ESES Märkten nutzen, unverändert gültig. Weitere Details hierzu sind in der Kundeninformation [D15042](#) vom 9. November 2015 beschrieben:

- Änderung der Kontonummern für Euroclear Frankreich (EF), Euroclear Niederlande (ENL) und Euroclear Belgien (EBE)
- Anpassung der Verarbeitungszeiten (Settlement Timeline) für gültig erteilte Aufträge
- Berücksichtigung der T2S Matchkriterien
- Verwendung von T2S Party BICs und SACs
- Änderung bei der Abwicklung von Geschäften gegen Zahlung
- Änderungen bei der Nutzung von Überträgen frei von Zahlung ohne Matching (Dumps)
- Anpassung des Prozesses für Hold/Release
- Anpassung des Prozesses zur Stornierung von gültig erteilten Aufträgen
- Änderungen bei der Abwicklung von Kapitalmaßnahmen

Bei folgenden funktionalen Anpassungen haben sich in Teilaspekten bezüglich der Belegung von Settlement Parties geringfügige Änderungen ergeben. Daher haben wir in dieser Information ausschließlich die geänderten Passagen aufgeführt und möchten Sie bitten, für die weiteren Details unsere Information vom November 2015 als Basis für die Umsetzung und gegebenenfalls für die geplante Kundensimulation zu verwenden:

- Anpassung von Abwicklungsnachrichten im ISO 15022 Format
- Änderungen bei der Belegung von Party-Feldern in CASCADE Online

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.

Folgende Aspekte bleiben von der Migration weiterhin unberührt:

- Die derzeit in den Links mit Euroclear Frankreich, Niederlande und Belgien zugelassenen Wertpapiere
- Der Registrierungsprozess für im Link mit Euroclear Frankreich zugelassene Namensaktien
- Der Tax Agent Status von CBF im französischen Markt

Anpassung von Abwicklungsnachrichten im ISO 15022 Format (aktualisiert)

Gegenüber der Kundeninformation [D15042](#) vom 9. November 2015 ergeben sich in dem genannten Kapitel folgende Änderungen im Beispiel für eine Lieferinstruktion mit zwei Party-Leveln (Änderungen hervorgehoben):

Wenn zusätzlich ein zweites Party-Level (z. B. ~~eigener Kunde~~ und Kunde des Euroclear-Teilnehmers) mitgeliefert werden soll:

MT542/3: CBF-Kunde liefert – zwei Party-Level	
FIAC SAFE	:97A: :SAFE//xxxx0000 (Last-Konto in CASCADE)
SELL	:95Q: :SELL/Text (Party 2 Informationen, z.B. eigener Kunde)
	:95P: :REAG//SICVFRPPXXX (Euroclear Frankreich) :97A: :SAFE//45000000
	oder
REAG	:95P: :REAG//NECINL2AXXX (Euroclear Niederlande) :97A: :SAFE//44990000
	oder
	:95P: :REAG//CIKBBEBBXXX (Euroclear Belgien) :97A: :SAFE//44980000
RECU	:95P: :RECU//BANKFRPPXXX (Party 1: BIC Euroclear-Teilnehmer) :97A: :SAFE//SICVBANKFRPPXXX1000L10 (Party 1: SAC Euroclear-Teilnehmer – optional)
BUYR	:95Q: :BUYR/Text (Party 2 Informationen, z.B. Kunde des Euroclear-Teilnehmers) oder :95P: :BUYR//CUSTFRPPXXX (Party 2 Informationen im BIC-Format, z.B. Kunde des Euroclear-Teilnehmers)

Änderungen bei der Belegung von Party-Feldern in CASCADE Online (aktualisiert)

Gegenüber der Kundeninformation [D15042](#) vom 9. November 2015 ergeben sich in dem genannten Kapitel folgende Änderungen im Beispiel für eine Lieferinstruktion in CASCADE Online mit zwei Party-Leveln (Änderungen hervorgehoben):

Wenn zusätzlich ein zweites Party-Level (z.B. ~~eigener Kunde und~~ Kunde des Euroclear-Teilnehmers) mitgeliefert werden soll:

```
TRAN: KVEE FC: WE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          WP-UEBERTRAG / SETL.PTY-ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

          PRIMANOTE:  100      AUFTNR:           1      WKN: I FR0000120628

SETTL PARTY - LIEFERER
P1: BANKDEFFXXX _____
P2: TX PARTY 2 INFORMATIONEN _____
P3: _____
P4: _____
P5: _____

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: BANKFRPPXXX SICVBANKFRPPXXX1000L10 _____
P2: TXT PARTY 2 INFORMATIONEN _____
P3: _____
P4: _____
P5: _____

-- ID-KZ:          -- PW:          -----          --          --          --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück
```

Wenn zusätzlich ein zweites Party-Level (z. B. Kunde des Euroclear-Teilnehmers) im BIC-Format mitgeliefert werden soll:

```
TRAN: KVEE FC: WE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          WP-UEBERTRAG / SETL.PTY-ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

          PRIMANOTE:  100      AUFTNR:           1      WKN: I FR0000120628

SETTL PARTY - LIEFERER
P1: BANKDEFFXXX _____
P2: _____
P3: _____
P4: _____
P5: _____

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: BANKFRPPXXX SICVBANKFRPPXXX1000L10 _____
P2: BIC CUSTFRPPXXX _____
P3: _____
P4: _____
P5: _____

-- ID-KZ:          -- PW:          -----          --          --          --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück
```