

Kundeninformation zum T2S Release 1.3.1 – Einsatzdatum 20. November 2017

Clearstream Banking AG, Frankfurt¹ möchte die Kunden über den Inhalt des T2S Release 1.3.1 und die Erweiterungen von CBF, die im Zusammenhang mit den für T2S bereitgestellten CBF Services eingeführt werden, informieren. Die Einführung dieser Modifikationen erfolgt am

Montag, 20. November 2017.

Neben den funktionalen Änderungen, die in dieser Kundeninformation beschrieben werden, kündigte CBF mit der Kundeninformation "CBF Release in November 2017: Vorankündigung der Änderungen [\(D17037\)](#)" weitere Erweiterungen an. Alle CBF-Erweiterungen werden gebündelt und in einem Schritt implementiert.

Diese Kundeninformation bietet

- eine Zusammenfassung über den Leistungsumfang des T2S Release 1.3.1
- eine Beschreibung hinsichtlich der Anpassungen in der Software von CBF für T2S
- eine Übersicht der Aktivitäten in der Kundensimulation in Vorbereitung auf die T2S und CBF Releases im November 2017
- einen „Customer Readiness Plan“ bis Ende 2017.

Zusammenfassung des Umfangs des T2S Release 1.3.1

Basierend auf dem T2S Release Concept² wird T2S mit dem Release im November 2017 die Fehlerbereinigung von verschiedenen Produktionsproblemen (Problem Tickets „PBIs“)³ einführen. Das Release 1.3.1 deckt zurzeit 31 Produktionsprobleme ab. Die Fehlerbereinigung zu diesen Produktionsproblemen wurde von den T2S Settlement Managers als vorrangig eingestuft. Zusätzlich erhielten vier Produktionsprobleme den Status „Candidate for T2S Release 1.3.1“. Diese Produktionsprobleme werden untersucht und können für den Einsatz zugelassen werden. Jedoch können in dringenden Fällen, und wenn entsprechende Priorität gegeben ist, weitere funktionale Anpassungen autorisiert werden. Wenn der Einsatz weiterer Fehlerbereinigungen von Produktionsproblemen von T2S angekündigt wird, wird CBF eine aktualisierte Kundeninformation veröffentlichen.

Dieser Kundeninformation ist eine Datei beigefügt, die die neuesten Informationen über die entsprechenden Produktionsprobleme (PBIs) zeigt, welche Auswirkungen auf Kunden von CBF haben können, die im ICP- und/oder DCP-Modus operieren. Den Kunden wird empfohlen, die benannten Produktionsprobleme auf Relevanz zu validieren und zu prüfen, ob operative und/oder funktionale Änderungen in ihren Prozessen notwendig sind.

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.

² Details finden Sie im Anhang A. „T2S Release Concept“

³ Details finden Sie im Anhang B. „Scope of Launch Dates – Potential Release Items“

Gemäß der Planung der EZB wird die aktualisierte Software in der T2S Pre-Production Umgebung (UTEST) am 16. Oktober 2017 installiert. Sofern während des Tests die erwarteten Ergebnisse erzielt wurden, wird die CSD Steering Group über den Einsatz des T2S Release 1.3.1 in die Produktion entscheiden. Die finale Entscheidung, auch bekannt als "Go / No-Go Decision", soll am Donnerstag, 9. November 2017, getroffen werden.

Der Einsatz des T2S Release 1.3.1 in die Produktion ist für Montag, 20. November 2017, vorgesehen. Die Implementierung der Software wird während des T2S-Wartungsfensters am Wochenende erfolgen. Dies bedeutet, dass zurzeit keine Änderungen im T2S Operational Day erwartet werden, weder für die Verarbeitung der "End of Day" (Tagesende) Prozesse am Freitag, 17. November 2017, noch für den Beginn des Geschäftstages Montag, 20. November 2017.

Beschreibung der Modifikationen in der Software von CBF hinsichtlich T2S

Das T2S Release 1.3.1 wird die Änderungen der Software am gleichen Wochenende einsetzen, an dem CBF die Erweiterungen für das CBF Release November 2017 implementieren wird. Zugleich wird CBF dieses Einführungsfenster dazu nutzen, um weitere Service-Updates im Zusammenhang mit T2S einzusetzen.

Die nachstehende Tabelle bietet eine Übersicht der Service-Erweiterungen in verschiedenen Geschäftsbereichen. Diese Änderungen werden in den nachstehenden Passagen detailliert beschrieben. Bitte beachten Sie, dass diese Modifikationen sich auf funktionale oder organisatorische Prozesse der Kunden von CBF auswirken können. Wir bitten daher unsere Kunden, die Anforderungen an die Implementierung zu untersuchen.

Geschäftsfeld	Anpassungen / Erweiterungen mit dem CBF Release November	Auswirkungen auf ICP / DCP	Kommentar
1. Liquiditäts-Management Services	CBF Cash Forecast Fixed Income CCP Instruktionen werden berücksichtigt	ICP, welche die CASCADE Online Funktionalität (HOST / PC) nutzen	Serviceerweiterung, um Beträge aus der CCP Fixed Income Abwicklung zu berücksichtigen
2. CBF Auftragsabwicklung (CASCADE)	CASCADE Online Funktionalität Aktualisierung der Bildschirmanzeigen von verschiedenen Transaktionen / Funktionen	ICP, welche die CASCADE Online Funktionalität (HOST / PC) nutzen	Nach der erfolgreichen Migration von CBF auf T2S beginnt der Rückbau von nicht mehr relevanten Funktionalitäten
3. Kapitaldienste (KADI)	Market Claims und Reverse Claims CBF wird die Referenz aus dem zugrundeliegenden Wertpapierauftrag (sese.023) in der Instruktion eines Claims bereitstellen	DCP	Klärung eines von DCP Kunden gestellten Service Investigation Request

Geschäftsfeld	Anpassungen / Erweiterungen mit dem CBF Release November	Auswirkungen auf ICP / DCP	Kommentar
	<p>Abwicklung von Transformationen: Erweiterung für den „Trade Date“ (Handelstag)</p> <p>Instruktionen am Handelstag werden nicht länger berücksichtigt, wenn die Kapitalmaßnahme keine Änderung der zugrundeliegenden ISIN (Terminart 232) erfordert</p>	ICP / DCP	Serviceerweiterung, um die Anzahl an betroffenen schwebenden Instruktionen zu verringern
	<p>Abwicklung von Transformationen: Passive Matching Service</p> <p>Die Referenz der Gegeninstruktion wird hinzugefügt, wenn der Kontrahent den Passive Matching Service nutzt</p>	ICP / DCP	Serviceerweiterung bezüglich der Referenzierung von Instruktionen
4. Connectivity	<p>Nutzung des optionalen Felds “Place of Safekeeping”</p> <p>Die folgenden Nachrichtenarten werden erweitert, um die Lagerstelle im Feld :94B::SAFE: anzuzeigen</p> <ul style="list-style-type: none"> – MT535 Statement of Holdings – MT536 Statement of Transactions 	ICP, welche die technische Anbindungsvarianten von CBF nutzen	Serviceerweiterung; Kunden können diese Information auf Wunsch nutzen
	<p>Ausbau / Rückbau von CASCADE Tageslisten</p> <p>Die Tageslisten aus dem ehemaligen CBF SDS Zyklus 2 werde nicht länger ausgeliefert</p>	ICP, wenn Print Report bestellt wurde	Ausbau- / Rückbaumaßnahmen der CBF Software nach der Migration auf T2S

Geschäftsfeld	Anpassungen / Erweiterungen mit dem CBF Release November	Auswirkungen auf ICP / DCP	Kommentar
5. Stammdaten	Aus- / Rückbau von bisherigen CBF Geldkonten Nach der Migration auf T2S werden Zahlungs- / Lieferungsanweisungen über das T2S Dedicated Cash Account (DCA) abgewickelt. Die zuvor genutzte Geldkontostruktur wird aus dem System gelöscht	ICP	Rückbaumaßnahmen zum Aufräumen der CBF Software nach der Migration auf T2S
	Aus- / Rückbau von marktrelevanten Informationen in 2017 Die Informationen zum spanischen CSD, Iberclear, werden gelöscht	ICP, welche die CASCADE Online Funktionalität oder den KUSTA Data Carrier (Markets) nutzen	Neugestaltung, um Marktinformationen nur für T2S Out-CSDs zu liefern
	Restrukturierung der KUSTA Data Carrier bezüglich der Dateien für „CBF Customers und Markets“ Maßnahmen in 2017 und 2018.	ICP, wenn die Übertragung der Datei bestellt wurde	Der “Legal Entity Identifier” (LEI) wird eingeführt, um MiFID II bezogene Daten bereitzustellen. Vorbereitung auf die Neugestaltung der Datei “CBF Customers”, damit die wesentlichen Kundenstammdaten nach der Migration von CBF auf T2S zur Verfügung gestellt werden können

Tabelle 1 Übersicht der CBF Service Erweiterungen im November 2017

Die Anpassungen / Erweiterungen in der voranstehenden Tabelle werden in den folgenden Abschnitten beschrieben. Nachstehend wird definiert, wie die Kundeninformation strukturiert ist.

Zu jedem Geschäftsbereich gibt es eine kurze Einführung. Innerhalb dieses Abschnitts wird jede Anpassung / Erweiterung beschrieben. Er beschreibt die Änderungen und, sofern erforderlich, die möglichen Auswirkungen auf die Kunden auf. Außerdem werden bei Änderungen von Bildschirmanzeigen Beispiele aufgeführt. Nachstehend wird die Struktur der Beschreibung der Änderungen dargestellt:

X. Geschäftsfeld

- **Anpassungen / Erweiterungen**

[Beschreibung der Änderungen](#)

[Mögliche Auswirkungen auf Kunden](#)

[Layout CASCADE “abc”](#)

1. Liquiditäts-Management Services

Seit der Migration der T2S Wave 4 bietet CBF einen Zugang für einen konsolidierten Forecast Report für die Dedicated Cash Accounts (DCAs) den Kunden an. Diese Schnittstelle ermöglicht ein effektives Liquiditätsmanagement. Dieser erweiterte CBF Cash Forecast basiert auf den Daten des T2S Cash Forecast. CBF ergänzt die Informationen aus dem T2S Cash Forecast mit seinen eigenen Cash Forecast Daten, um dadurch den Kunden ein möglichst effizientes Management ihrer Liquiditätspools zu ermöglichen.

CBF Cash Forecast

In Übereinstimmung mit Eurex Clearing AG (ECAG) hat CBF beschlossen, dass mit dem Release im November 2017 die Cash Forecast Informationen erweitert werden. Von dieser Erweiterung werden die Kunden profitieren, die den CBF Cash Forecast nutzen. Der Cash Forecast dient als Basis für die Daueraufträge, die von CBF initiiert werden, um Liquidität vom TARGET2 RTGS Kundenkonto auf das T2S Dedicated Cash Account (DCA) zu transferieren. Mit diesem Release wird eine Lücke für CCP Fixed Income Produkte geschlossen und die dann ausgewiesenen Zahlen erfordern hierzu keine weitere Aktion auf Kundenseite. In Zukunft wird der kalkulierte Betrag auch die CCP (central counterparty) Fixed Income Instruktionen berücksichtigen.

Beschreibung der Änderungen

Zurzeit deckt der Cash Forecast die Beträge von CCP (central counterparty) Transaktionen für Aktien und aktienähnlichen Wertpapierinstruktionen gegen das EUREX CLEARING AG / EQUITY CCP Konto (8501) ab.

Auf Tagesbasis liefert die ECAG die kalkulierten Beträge für Abwicklungsinstruktionen mit einem Abwicklungsbetrag (also delivery versus payment (DvP) und receipt versus payment (RvP)). Diese Zahlen werden für das CBF Cash Forecast Reporting berücksichtigt. Dieser Report kann über die CBF Online Funktionalität abgerufen werden; unter Verwendung von CASCADE-HOST mit der Transaktion "KUCF" oder unter Verwendung von CASCADE-PC "cash forecast: full display: settlement".

Beginnend am 20. November 2017 wird die ECAG die Beträge liefern, die sich aus den Transaktionen ergeben, die über die folgenden CBF Kontostämme abgewickelt werden:

- 7525 - EUREX CLEARING AG / FIXED INCOME CCP
welches für Wertpapierüberträge in Anleihen genutzt wird. Bitte beachten Sie, dass GC Pooling Geschäfte, die ebenfalls über dieses Konto verarbeitet werden, nicht berücksichtigt werden, da diese Geschäfte weiterhin über die T2 RTGS Konten und nicht als Zahlungs-/Lieferungsinstruktionen über T2S abgewickelt werden;
- 7530 - EUREX CLEARING AG / FIXED INCOME NOTIF./ALLOCATIONS
welches für die Wertpapierabwicklung von Anleihen aus Eurex Notifications oder Allocations (Ausübung)⁴ genutzt wird.

Diese Zahlen werden in das CBF Cash Forecast Reporting einfließen. Zudem werden sie im Gesamtbetrag der Liquiditätsaufträge, der an TARGET2 übermittelt wird, berücksichtigt. Die heutigen Servicezeiten für die Generierung des Forecasts (gegen 17:15 Uhr) und des Nachrichtenflusses an die Nationalen Zentralbanken (gegen 19:00 Uhr) bleiben unverändert.

Die CASCADE Online Bildschirmanzeigen werden aktualisiert, um diese Änderung zu reflektieren. Heute wird die Bezeichnung "CCP (XETRA / FWB)" für EQUITY CCP Instruktionen benutzt. In Zukunft wird die entsprechende Zeile "EQUITY & FIXED INCOME CCP" lauten. Die Bildschirmabbildungen für die CBF Online Funktionalität (HOST / PC) befinden sich auf den nachfolgenden Seiten.

⁴ Mehr Informationen stehen im ECAG Rundschreiben 005/12 zur Verfügung.

Mögliche Auswirkungen auf Kunden

Kunden, die die CBF Liquidity Management Services nutzen, sollten prüfen, ob Daueraufträge und die entsprechenden operativen Prozesse angepasst werden müssen.

ECAG wird die erweiterten Daten mit Informationen von CCP Fixed Income Lieferungen ab Montag, 20. November 2017, für den folgenden Geschäftstag (21. November 2017), liefern. Daher müssen am Freitag (17. November 2017), vor dem Einsatz, die heutigen Prozesse noch ausgeführt werden.

Außerdem müssen bei Nutzung von CASCADE-PC die Roll-Out Aktivitäten für die Version 9.3 berücksichtigt werden. Für das CBF Release November 2017 ist eine verpflichtende Implementierung der Software geplant. Gemäß dem neuesten CBF Customer Readiness Plan soll die CASCADE-PC Software am 6. November 2017 zum Download bereitstehen. Weitere Informationen werden rechtzeitig erfolgen.

Layout CASCADE Online "HOST" ab November 2017

```
TRAN: KUCF FC: CF SB: 7899#222#EUR#31.07.2017#NTS
CASH FORECAST UEBERSICHT                T2S-GENERIERUNG: 31.07.2017 17:04:55
DCA REF: 7899 222 MUSTER BANK AG
DCA      : CDEEURBANKDEFFXXDCA-7999-222-XXXX
TAG DER GELDVERRECHNUNG: 01.08.2017 VERARBEITUNGSLAUF: NTS
```

	SOLL IN EUR	HABEN IN EUR
ABWICKLUNG PENDING	200.000,00	
ABWICKLUNG NAECHSTER TAG	300.000,00	
LIQUIDITY TRANSFER		700.000,00

SALDO T2S FORECAST		200.000,00
EQUITY & FIXED INCOME CCP	600.000,00	
KAPITALDIENSTE		100.000,00

SALDO CBF FORECAST	500.000,00	

AKT. DISPOSITIONSBETRAG	300.000,00	
=====		
-- ID-KZ: 00000-000 -- PW: ----- B79-504 -- 31/07/17 -- 17:35:00 -		
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch		

Layout CASCADE Online "PC" ab Version 9.3

CASCADE - PC cash forecast: full display: settlement

window help

T2S creation: 31.07.2017 17:15:35

DCA reference: 7899 222 TEST DCA-REF-KONTO

DCA: CDEEURBANKDEFFXXX-T2S-TEST-7 222 cash clearing date: 31.07.2020

currency: EUR - Euro processing cycle: NTS - night time settlement 7:30 pm - 3:00 am

	debit	credit
pending settlement:		0.00
settlement next day:	9,000,000.00	
liquidity transfer:		7,200,000.00
total T2S forecast:	1,800,000.00	
CCP (equity & fixed income):	1,424,527.00	
custody services:		0.00
total CBF forecast:	1,424,527.00	
net funding requirement:	3,224,527.00	

cancel

2. CBF Auftragsabwicklung (CASCADE)

CASCADE Online Funktionalität

CBF hat in verschiedenen "Detailed Functional Descriptions" angekündigt, dass nach der erfolgreichen Migration von CBF auf T2S einige CASCADE Online Bildschirmanzeigen aktualisiert werden. Diese Maßnahme wurde als ein „Post Launch Item“ geplant. Mit dem CBF Release November 2017 wird damit begonnen, bisherige CBF Funktionalität, die nicht mehr benötigt wird, zurückzubauen.

Während der T2S Wave 4 Business Day Testphase hatten Kunden von CBF um eine Änderung der CASCADE Online Funktionalität (HOST / PC) für die "Umsatzanzeige" / "movements overview" gebeten. Der vorhandene Begriff "Buchung / accounting", der über den effektiven Abwicklungstag auf T2S informiert, stimmt nicht mit der tatsächlichen Datums-/Zeit-Anzeige überein. Die CASCADE Online Bildschirmanzeigen werden dem Kundenwunsch entsprechend aktualisiert.

Beschreibung der Änderungen

Die nachstehende Tabelle bietet eine Übersicht der CASCADE Bildschirmanzeigen, die mit dem kommenden Release angepasst werden. Demnach wird das umgestaltete Layout bei Nutzung von CASCADE Host ab dem 20. November 2017 oder nach der Installation CASCADE-PC Software Version 9.3 dargestellt.

CBF Funktionalität	CASCADE-HOST	CASCADE-PC	Neugestaltung
Main Selection Screen	Menü (MENU)	CASCADE-PC main menu	Die heutige Information zur Anzeige, dass das System nicht zur Verfügung steht, wird geändert. Die Nachricht "DFS065 hh:mm:ss TRAN/LTERM STOPPED, T/L=KVAC" wird geändert in "DFS064 hh:mm:ss DESTINATION CANNOT BE FOUND OR CREATED, DEST=KVXX"
Instruction Management	CASCADE Auftragsstatus / -information (KVAI)	Not applicable	Der Funktionscode für: "SS" für "SDS-Aufträge" "SR" für "RTS-Aufträge" wird aus dem Auswahlbildschirm gelöscht. Die entsprechenden Seiten können nicht mehr angezeigt werden.
Instruction Management	CASCADE Match-Dienst (KVAM)	CASCADE-PC selection: match service	Der Funktionscode für: "RM" für "Rücknahme Matching" beziehungsweise "cancel matched instructions" wird aus dem Auswahlbildschirm gelöscht. Die entsprechenden Seiten können nicht mehr angezeigt werden.

CBF Funktionalität	CASCADE-HOST	CASCADE-PC	Neugestaltung
Instruction Entry	CASCADE Auftragsabwicklung Match-Instruktion Erfassung (KVEE)	CASCADE-PC: entry screen	Das Feld „RTS-DvP“ wird vom Eingangsbildschirm gelöscht. Das Feld „Selbstbesicherung“ und „Gegen-Auftnr“ wird nur vom CASCADE-HOST-Eingangsbildschirm entfernt, da es über CASCADE-PC nicht zur Verfügung steht.
Movements	CASCADE Umsatzanzeige – Depotumsätze Inland – Auswahl (KVDU)	CASCADE-PC selection: domestic movement	Die Werte „Lauf: (S/1/2/R/C)“ beziehungsweise „process cycle“ zur Auswahl eines bestimmten Zyklus werden nicht mehr benötigt und daher nicht mehr angezeigt.
Movements	CASCADE Umsatzanzeige – Depotumsätze – Vollanzeige (KVDU / ID)	CASCADE-PC selection: domestic movement – item detail screen	Die Begriffe „Buchung“ beziehungsweise „accounting“ werden ersetzt durch „T2S Effective Settlement“ und „Processing Time“. Zusätzlich wird der entsprechende Hilfebildschirm angepasst, um die T2S Verarbeitungszeiten anzuzeigen.

Tabelle 2 Übersicht der Anpassungen von CASCADE Bildschirmanzeigen

Beispiele für die Bildschirmanzeigen befinden sich am Ende dieses Abschnitts.

Mögliche Auswirkungen auf Kunden

Kunden, die die CASCADE Online Funktionalität über HOST oder CASCADE-PC nutzen, sollten prüfen, ob die Anpassungen ihre zugehörigen operativen Prozesse beeinträchtigen.

Außerdem müssen bei Nutzung von CASCADE-PC die Roll-Out Aktivitäten für die Version 9.3 berücksichtigt werden. Für das CBF Release November 2017 ist eine verpflichtende Implementierung der Software geplant. Gemäß dem neuesten CBF Customer Readiness Plan soll die CASCADE-PC Software am 6. November 2017 zum Download bereitstehen. Weitere Informationen werden rechtzeitig folgen.

[Layout CASCADE Online "HOST": "KVAI"](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt die Zeilen, die gelöscht werden.

```
TRAN: KVAI FC: ID SS: #I####  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG          I N F O R M A T I O N          AUFTRAGSSTATUS  
  
AA  AUFTRAGSART              : ..                      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 : ....      WKN           : .....  
AUSWAHL           GUTSCHRIFT-BANK  : ....      SETTLEMENT-DAY : .....  
                                                           WRG GEGENWERT : ...  
  
HA  HISTORISCHE AUFTRAEGE          EINGEBER      : ....  
  
-- ID-KZ: 7907999999-- PW:          ----- B790753V -- 31/07/17 -- 17:35:00 --  
  
PF1:Hilfe  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

[Layout CASCADE Online "HOST": "KVAM"](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt die Zeile, die gelöscht wird.

```
TRAN: KVAM FC: RM SB: #  
  
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/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)  
MI  MATCH-INSTRUKTIONEN     : .    M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)  
  
RM  RUECKNAHME MATCHING: ..... (AUFTRAFSNUMMER)  
  
ZUSAETZLICHE      BANK-NR DES KONTRAHENTEN : ....  
AUSWAHL           WKN                       : .....  
                                                           SETTLEMENT-DAY : .....  
                                                           WRG GEGENWERT  : ...  
  
-- ID-KZ: 7097999999 -- PW:          ----- B790753V -- 31/07/17 -- 17:35:00 --  
  
PF3: Rücksprung  PF4: Abbruch
```

[Layout CASCADE Online "HOST": "KVEE"](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt die Felder, die gelöscht werden.

```
TRAN: KVEE FC: MI SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          MATCH-INSTRUKTION / ERFASSUNG          ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: _____          AUFTNR: _____          VWA: GS

LAST      : _____          /
GUT       : _____          /
WKN       : _____

NOMINALE  : _____          EINHEIT: _____          DISPO-PRIORITAET: _
GEGENWERT: _____          WRG    : EUR              PARTY-HOLD (J/N): N
DCA/REF   : _____          EMISS-EINF (J/N): N

SET-DAY   : 31.07.2017          EX-TRD : _____          BATM/ADEA (J/N): N
BOERSENPL: _____          OPT-OUT: _                RTS-DVP   (J/N): N

SCHLUSSTAG: _____          REFERENZ-NR : _____
KURS / WRG: _____          AUFTRAGS-REFERENZ : _____
SELBSTBES (J/N/ ) : _____          GEGEN-AUFTNR : _____
```

[Layout CASCADE Online "HOST": "KVDU" selection screen](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt die Zeile, die gelöscht wird.

```
TRAN: KVDU FC: ID SB: #I##

UMSATZANZEIGE          DEPOTUMSAETZE INLAND - AUSWAHL

Buchungstag   : _____ bis: I          Lauf: (S/1/2/R/C)
Zeit          : _____ bis _____ Uhr
Auftr-/GS-Nr : _____ Teilnehmer-Referenz:
T2S Actor Ref : _____
WKN/ISIN     : _____ DvP: _ (J/N)          Sortierung: _ (G/N/Z)
Auftragsart  : _____ KZ-AA : _____
Umsatzart    : _____ (L: Lastschrift / G: Gutschrift)
Bank/Konto   : _____ Boersenplatz: _____
Kontrahent   : _____

-- ID-KZ: 7907999999-- PW: _____ B790753V -- 31/07/17 -- 17:35:00 --
```

[Layout CASCADE Online "HOST": "KVDU" item detail screen](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt, dass der Begriff "Buchung" in "T2S Effective Settlement" geändert wird. Zusätzlich wird der Begriff "Processing Time / Verarbeitungszeit" aufgenommen.

```
TRAN: KVDU FC: ID SB: 31.07.2017#####I#####L#7899#####  
  
UMSATZANZEIGE                DEPOTUMSAETZE - VOLLANZEIGE  
  
Auftr-Art: 13  KADI NON-INCOME                Umsatzart: Last  
  
Eingeber :      7899      T2S Effective Settlement  31.07.2017  
Auftr-Nr :      323273    Processing Time / Verarbeitungszeit um 18:58:04 Uhr  
  
Konto      : 7899 000      MUSTERBANK AG                / MUSTDEFFXXX  
Wg Ndl     :  
DCA/REF    :  
Kontrah   : 7924 003      CBF AUSB.-WERTLOSE STUECKE-    / DAKVDEFFT06  
Wg Ndl     :  
DCA/REF    :  
WKN/ISIN  : I DE000DL76065 DEUT.BANK WAVEC17 N225  
  
Nominale   :              9.999-      Einheit : ST      Verwahrart: GS  
Gegenwert  :              Waehrung:      Set-Day   : 31.07.2017  
MITI Ref1  : 9000000000000001      MITI Ref2: 9000000000000002
```

[Layout CASCADE-PC: "entry screen"](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt die Zeile, die gelöscht wird.

The screenshot shows a software window titled "CASCADE - PC delivery: enter". It contains several input fields and dropdown menus for transaction details. The "RTS-DvP" field is highlighted with a red border and shows the value "no". Other fields include "instruction no.", "file no.", "debit", "credit", "securities" (with an "ISIN" dropdown), "nominal", "unit", "cash" (set to "EUR"), "DCA/REF", "settlement date" (set to "02-08-2017"), "opt-out", "BATM/ADEA" (set to "no"), "stock exchange", "ex-trade", "trade date", and a "party hold" checkbox. At the bottom, there are three buttons: "process", "check", and "cancel".

[Layout CASCADE-PC: "selection: match service"](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt die Zeile, die gelöscht wird.

The screenshot shows a window titled "CASCADE - PC selection: match service". It has a menu bar with "window" and "help". The main area is divided into sections:

- selection:** Contains three radio buttons: "delivery instructions" (selected), "receipt instructions", and "cancel matched instructions" (highlighted with a red box).
- matching status:** A dropdown menu currently showing "unmatched".
- additional selection:** Contains several input fields:
 - counterparty: [text box]
 - securities code: [text box] with an "ISIN" dropdown menu to its left.
 - settlement date: [text box]
 - currency: [text box] with a dropdown arrow on the right.

At the bottom, there are two buttons: "gk" and "cancel".

[Layout CASCADE-PC: "selection: domestic movements"](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt die Zeile, die gelöscht wird.

The screenshot shows a window titled "CASCADE - PC selection: domestic movements". It has a menu bar with "window" and "help". The main area is divided into sections:

- selection:** Contains various input fields:
 - accounting date: [text box] with "up to:" and [text box] to its right.
 - time: [text box] : [text box] with "up to:" and [text box] : [text box] to its right.
 - transactions type: [text box] with a dropdown arrow.
 - securities: [text box] with an "ISIN" dropdown menu to its left, and "DvP:" and [text box] with a dropdown arrow to its right.
 - T2S actor reference: [text box]
 - bank/account: [text box] [text box]
 - counterparty: [text box] [text box]
 - instruction type: [text box] with a dropdown arrow, currently showing "all instruction types".
 - instruction no.: [text box] (transaction no.)
 - customer reference: [text box]
 - stock exchange: [text box] with a dropdown arrow.
- additional selection:** Contains two dropdown menus:
 - process cycle: [text box] with a dropdown arrow (highlighted with a red box).
 - sort criteria: [text box] with a dropdown arrow.

At the bottom, there are two buttons: "gk" and "cancel".

[Layout CASCADE-PC: "selection: domestic movements – item detail screen"](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt die Zeile, die aktualisiert wird. In Zukunft wird der Begriff "T2S Effective Settlement" anstatt "accounting" angezeigt.

CASCADE - PC movements

debit entry instructor: 7907

accounting [] on: 26-07-2017 12:16:05 pm

account: 4424 000 CBF W/KUNDENSIMULATION CRC / DAKVDEFFT80

DCA/REF: [] due to []

counterparty: 7899 000 MUSTERBANK AG / MUSTDEFFXXX

DCA/REF: [] due to []

nominal: [] -10,000,000 unit: EO settlement date: 26-07-2017

cash: [] [] []

Miti Ref1: 9000000000000001 Miti Ref2: 9000000000000002

3. Kapitaldienste (KADI)

Mit der CBF Release Information für November 2017 (D17037) wurden Kunden Änderungen in den Nachrichtenarten MT564, MT565 und MT567 angekündigt.

Zusätzlich zu diesen Änderungen wird CBF einige kleinere Serviceerweiterungen zur Verfügung stellen, die als „Post Launch Item“ geliefert werden sollen. Die Implementierung dieser Erweiterungen bringt Verbesserungen für Kunden, die im ICP- und / oder DCP- Modus operieren.

Market Claims und Reverse Claims

Während der T2S Wave 4 Business Day Testphase hatten Kunden von CBF, die im DCP-Modus operieren, eine Bereitstellung der „MITI“ (Market Infrastructure Transaction Identification) in Nachrichten zu Kapitaldiensten und in T2S sese.023 für Instruktionen, die aus der Verarbeitung von Corporate Actions (KADI) stammen, angefragt.

In Zukunft wird die „MITI“ der zugrundeliegenden Instruktion als zusätzliche Information für Market und Reverse Claims in der MT564 Corporate Action Notification zur Verfügung gestellt. Die Erweiterung wird die folgenden Verarbeitungsprozesse am Record Date unterstützen:

- ADDB//ACLA Expected market claim; message is sent on record date evening;
- ADDB//CLAI Generated market or reverse claim;
provided upon settlement of underlying instruction;
- ADDB//ATXF Income or non-income transformation;
- ADDB//CNTR Cancellation of underlying instruction due to OPT/OUT flag
in case of income and non-income transformation.

Im MT564 bei einer REPE Abwicklung am Record Date minus 1 und minus 2 (RD -1 / RD -2) kann keine „MITI“ bereitgestellt werden. Bitte beachten Sie, dass CBF in diesem Fall nur die Summe der zugrundeliegenden Lieferungen und Eingänge berichtet und daher keine „MITI“ zur Verfügung gestellt werden kann.

CBF erweitert außerdem den MT566 Corporate Action Confirmation um die „MITI“ der zugrundeliegenden Instruktion zu berichten.

Die „MITI“ der zugrundeliegenden Instruktion wird in KADI Instruktionen bereitgestellt, um das Reporting der Referenz in T2S sese.023 zu ermöglichen. Dies wird für schwebende, kompensierte oder transformierte Domestic-OTC, grenzüberschreitende und LION (Börsengeschäfte) Instruktionen ermöglicht.

Beschreibung der Änderungen

CBF wird die „MITI“ der zugrundeliegenden Instruktionen an T2S in sese.023 im nachfolgenden Format zur Verfügung stellen, Nachstehend ein Ausschnitt aus sese.023:

```
←Lnkgs→
                                     ←PrcgPos→
                                     ←/PrcgPos→
←Cd→INFO←/Cd→
                                     ←Ref→
←MktInfrstrctrTxId→MITIREFUNDERLYING←/MktInfrstrctrTxId→
                                     ←/Ref→
←/Lnkgs→
```

Vorteil für Kunden

Kunden, die im DCP-Modus operieren, können diese zusätzliche Referenz in den zugrundeliegenden Instruktionen für die Verarbeitung von Kapitalmaßnahmen nutzen. Bitte beachten Sie, dass das Verfahren am 20. November 2017 implementiert wird. Vorhandene (schwebende) Instruktionen werden nicht aktualisiert.

Abwicklung von Transformationen: Erweiterung für den „Trade Date“ (Handelstag)

Für die Kapitalmaßnahmen der Terminart TA 232 "Conversion" kommt die Verarbeitung als Reorganisation zum Tragen. Dies bedeutet, dass die zugrundeliegende ISIN ausgebucht und eine neue ISIN eingebucht wird. Sofern möglich, wird eine Transformation abgewickelt, das heißt, a) die Löschung der zugrundeliegenden schwebenden gematchten Instruktion und b) die Wiedereinstellung einer neuen Instruktion mit geänderter ISIN und / oder Nominale.

Die Transformation eines schwebenden Geschäfts (matched) erfolgt in der Regel ab Stichtag bis 20 Geschäftstage danach.

Seit der Migration von T2S hat sich die Gesamtzahl an transformierten Instruktionen erhöht, wenn die Daten der Kapitalmaßnahmen eine Umstellung erfordern, damit die vorhandene ISIN weiterhin verwendet wird (ISIN alt = ISIN neu). Da nach dem Stichtag alle gematchten Instruktionen innerhalb der nächsten 20 Geschäftstage transformiert werden, wird jede Instruktion, die mit einem in der Vergangenheit liegendem Handelstag eingegeben wird, für eine Transformation berücksichtigt. Dies gilt auch, wenn die Kontrahenten bereits die Kapitalmaßnahmen in den Instruktionen berücksichtigt haben.

Beschreibung der Änderungen

Das vorhandene Verfahren zur Identifizierung von zu transformierenden Instruktionen wird angepasst. Der Handelstag wird für den Transformationsprozess in den folgenden Instruktionstypen berücksichtigt:

- 01 P Depotübertrag RS // Account transfer RS
- 01 W Ohne KZ-AA // Without identifier AA
- 10 Börsengeschäfte (LION) // Stock Exchange trades (LION)
- 99 Storno / Nachbuchung // Cancellation / booking account transfer

In Zukunft wird der Transformationsprozess die folgende Regel berücksichtigen:

Wenn der "TRADE DATE" der zugrundeliegenden Instruktion vor oder am (<=) ENTITLEMENT DATE der Kapitalmaßnahme liegt, wird keine Transformation für die neu aufgesetzten Instruktionen durchgeführt.

Vorteil für Kunden

Die Gesamtzahl der unerwünschten, automatisch generierten Reserve und Market Claims wird sich verringern.

Mögliche Auswirkungen auf Kunden

Nach der Implementierung der erweiterten Regel werden Kunden aufgefordert, ihre operativen Prozesse für die Abwicklung von Transformationen aktualisieren. In der aktualisierten Version des „CBF Handbuch Kompensation“ werden die notwendigen Informationen zur Verfügung gestellt.

Die Anpassungen werden am 18. November 2017 implementiert. Jede Instruktion, die während einer beginnenden oder laufenden Kompensationsfrist zur Verarbeitung mit T2S NTS Cycle 1 eingestellt wird, wird gemäß dem erweiterten Regeln abgewickelt.

Abwicklung von Transformationen: Passive Matching Service

CBF wird eine Gegeninstruktion für Kunden erstellen, die den "Passive Matching Service" nutzen. Diese Instruktionen werden von CASCADE generiert. Diese Verfahren findet auch bei der Verarbeitung von Free of Payment (FOP) Instruktionen Anwendung, die im Zuge von Kapitalmaßnahmen erstellt werden.

Bei Kapitalmaßnahmen mit Transformationen wird derzeit die T2S-ACTOR REFERENCE der Match-Instruktion aus dem "Passive Matching Service" weder im MT564 Corporate Actions Notification noch im MT566 Corporate Action Confirmation berichtet.

Beschreibung der Änderung und Vorteil der Kunden

CBF wird das heutige Verfahren für die Generierung von Gegeninstruktionen für den "Passive Matching Service" aktualisieren. Die notwendige Referenz der Gegeninstruktion wird in den oben benannten Nachrichtentypen zu Kapitalmaßnahmen bereitgestellt und steht für die weitere Abwicklung auf Kundenseite zur Verfügung.

4. Connectivity

Mit der CBF Release Information für November 2017 ([D17037](#)) wurde den Kunden die Änderungen in den Nachrichtenarten für Kapitalmaßnahmen angekündigt.

Zusätzlich zu diesen Änderungen wird CBF die Nachrichtenarten der Kategorie 5 (Settlement Area) erweitern,

- um die Nutzung des optionalen Felds "Place of Safekeeping" zu ermöglichen. Der "TAG 94B" wird verwendet, um die Lagerstelle auszuweisen
- um die Abwicklungsplattformen T2S und CBL Creation im Pflichtfeld "Place of Settlement (TAG 95P)" auszuweisen.

Kunden, die die Nachrichtenarten im Format SWIFT, File Transfer oder MQSeries beziehen wollen, senden bitte das entsprechende Connectivity Formular an Clearstream Banking Client Services Connectivity. Alle Formulare können von Clearstreams Internetseite heruntergeladen werden.

Im Zuge der Rückbaumaßnahmen von CBF nach der Migration auf T2S wird das Settlement Reporting bezüglich des ehemaligen "CBF SDS Cycle 2" aus der Produktion herausgenommen und nicht länger zur Verfügung gestellt. In den folgenden zwei Abschnitten werden diese Änderungen im Detail beschrieben.

Nutzung des optionalen Felds "Place of Safekeeping"

[Erweiterung des MT535 Statement of Holdings](#)

Der MT535 Statement of Holdings wird erweitert, um Informationen über die Lagerstelle des Wertpapiers abzubilden. Die Lagerstelle wird im "Optional Repetitive Sequence B Sub-safekeeping account" angezeigt; hier wird der "TAG 94a" angeboten. CBF wird die Option "B" nutzen, um die Lagerstelle anzuzeigen („Place of Safekeeping“). Diese Information wird aus den CBF Wertpapierstammdaten, Feld "GS011 BIC of depository" gezogen. Daher wird die Lagerstelleninformation als BIC ausgewiesen. Für alle Wertpapiere, die über CBF emittiert werden, wird der BIC „DAKVDEFF“ im TAG 94B ausgewiesen.

Bereits heute stellt CBF im MT536 Statement of Transactions und MT537 Statement of Pending Transactions of Stock Exchange Trades die Verwahrart zur Verfügung. Diese Information wird aus den CBF Wertpapierstammdaten, Feld "GS135" gezogen. In Zukunft werden diese Daten im MT535 mit den folgenden Werten abgebildet:

Custody Type	GS135 Value	Mapping for MT535 TAG 94B
Girosammelverwahrung (GS) / Collective Safe Custody (CSC)	1 GS	94B::SAFE/DAKV/COLL
Streifband / Individual Safe Custody (STR)	2 STR	94B::SAFE/DAKV/INDI
AKV / Non Collective Safe Custody (NCSC)	4 NCSC	94B::SAFE/DAKV/TOWN

Tabelle 3 Mapping für MT535 TAG 94B – GS135 Value

Bitte beachten Sie, dass das Feld leer bleibt, wenn kein Wert aus den Wertpapierstammdaten ermittelt werden kann.

[Beschreibung der Änderungen](#)

Übereinstimmend mit dem SWIFT Format für ISO 15022 Nachrichten wird CBF das folgende Schema benutzen:

- TAG: 94
- Option: B
- Format: SAFE/DAKV/4!a/4!a2!a2!c[3!c]
- Sample: 94B::SAFE/DAKV/COLL/DAKVDEFFXXX

Die generelle Beschreibung des MT535 und ein Beispiel kann auf den folgenden Seiten gefunden werden.

[Mögliche Auswirkungen für Kunden](#)

Die Verwendung von "TAG 94B Place of Safekeeping" ist optional.

Interessierte Kunden können die zusätzlichen Informationen ab 20. November 2017 nutzen. CBF plant den Einsatz der Software am 18. November 2017. Daher werden die Informationen im MT535 erstmals am Montag, 20. November 2017 um 20:30 Uhr übermittelt.

[Überblick MT535 Statement of Holdings mit Angabe des „TAG 94B Place of Safekeeping“](#)

Tag	Status	Field name	Format	Comment
Mandatory Sequence A General Information				
16R	M	Start of Block	GENL	
28E	M	Page Number/Continuation Indicator	5n/4!c	
13A	O	Number Identification	STAT//3!c	
20C	M	Sender's Message Reference	SEME//16x	
23G	M	Function of the Message	NEWM	
98C	O	Preparation Date/Time	PREP//8!n6!n	
98A	M	Statement Period	STAT//8!n	
22F	O	Statement Frequency Indicator	SFRE//[8c]/4!c	
22F	O	Complete/Updates Indicator	CODE//[8c]/4!c	
22F	M	Statement Type	STTY//CUST	
22F	M	Statement Basis	STBA//SETT	
97A	M	Safekeeping Account	SAFE//35x	
17B	M	Activity Flag	ACTI//1!a	
17B	M	Sub-safekeeping Statement	CONS//Y	
16S	M	End of Block	GENL	
End of Sequence A General Information				
Optional Repetitive Sequence B Sub-safekeeping account				
16R	M	Start of Block	SUBSAFE	
97A	O	Safekeeping Account	SAFE//35x	
94B	O	Place of Safekeeping	SAFE/DAKV/4!a/4!a2!a2!c[3!c]	Update
17B	O	Activity Flag	ACTI//1!a	
Optional Subsequence B1 Financial Instrument				
16R	M	Start of Block	FIN	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
93B	M	Aggregate Balance	AGGR//4!c/[N]15d	
94B	O	Place of Safekeeping	SAFE/DAKV/4!a/4!a2!a2!c[3!c]	Neu
70E	O	Holdings Narrative	HOLD//10*35x	
16S	M	End of Block	FIN	
End of Sequence B1 Financial Instrument				
16S	M	End of Block	SUBSAFE	
End of Sequence B Sub-safekeeping account				

Beispiel MT535 Statement of Holdings mit Angabe des "TAG 94B Place of Safekeeping"

Message fields and contents	Comments
ä1: F01DAKVDEFFADOM5974506563 ä2: I535DXIADEBBXXXN ä3: ä108: B0BF155710D063DS ä4:	Header
:16R: GENL :28E: 5/MORE :13A::STAT//348 :20C::SEME//B0BF155710D063DS :23G: NEWM :98C::PREP//20091214155710 :98A::STAT//20091214 :22F::SFRE//DAIL :22F::CODE//COMP :22F::STTY//CUST :22F::STBA//SETT :97A::SAFE//1111 :17B::ACTI//Y :17B::CONS//Y :16S: GENL :16R: SUBSAFE :97A::SAFE//22220045 :94B::SAFE/DAKV/COLL/DAKVDEFFXXX :17B::ACTI//Y :16R: FIN :35B: ISIN DE000A0KAV21 BERLIN, LAND LSA07/22A226 :93B::AGGR//FAMT/70000000, :70E::HOLD///DLTR 20090717 :16S: FIN :16S: SUBSAFE :16R: SUBSAFE :97A::SAFE//22220000 :94B::SAFE/DAKV/COLL/DAKVDEFFXXX :17B::ACTI//Y :16R: FIN :35B: ISIN DE000DB5S568 DT.BANK MTN 07/10 :93B::AGGR//FAMT/65000000, :70E::HOLD///DLTR 20090317 :16S: FIN :16S: SUBSAFE	Das Beispiel zeigt CBF als Lagerstelle für ein Wertpapier in Girosammelverwahrung (GS) / Collective Safe Custody (CSC) Das Beispiel zeigt CBF als Lagerstelle für ein Wertpapier in Girosammelverwahrung (GS) / Collective Safe Custody (CSC)
-ü ä5: äMAC: 5C2DE495üäCHK:490FBC7919BAüü	Trailer

[Anpassung von MT536 Statement of Transactions](#)

Entsprechend der Erweiterung für den MT535 Statement of Holdings wird der MT536 Statement of Transactions aktualisiert. In "Optional Subsequence B1a2 Transaction Details" wird der "TAG 94B" hinzugefügt, der die Lagerstelle angibt.

Das für MT535 definierte Format wird auch hier angewendet (":SAFE/DAKV/4!a/4!a2!a2!c[3!c]").

Nachstehend finden Sie die Mapping-Tabelle für den MT536, welche die CBF Wertpapierstammdaten mit dem Feld "GS135 Custody Type" berücksichtigt:

Custody Type	GS135 Value	Mapping for MT536 TAG 94B
Girosammelverwahrung (GS) / Collective Safe Custody (CSC)	1 GS	94B::SAFE/DAKV/COLL
Streifband / Individual Safe Custody (STR)	2 STR	94B::SAFE/DAKV/INDI
Wertpapierrechnung / WPR	3 WPR	94B::SAFE/DAKV/TOUT
AKV / Non Collective Safe Custody (NCSC)	4 AKV	94B::SAFE/DAKV/TOWN

Table 4 Mapping für MT536 TAG 94B – GS135 Values

Bitte beachten Sie, dass das Feld leer bleibt, wenn kein Wert aus den Wertpapierstammdaten abgerufen werden kann.

[Beschreibung der Änderungen](#)

Übereinstimmend mit dem SWIFT Format für ISO 15022 Nachrichten wird CBF das folgende Schema benutzen:

- TAG: 94
- Option: B
- Format: SAFE/DAKV/4!a/4!a2!a2!c[3!c]
- Sample: 94B::SAFE/DAKV/COLL/DAKVDEFFXXX

Die Beschreibung der "Optional Subsequence B1a2 Transaction Details" für MT536 kann auf den folgenden Seiten gefunden werden.

[Mögliche Auswirkungen auf Kunden](#)

Generell ist die Verwendung von "TAG 94B Place of Safekeeping" optional.

CBF wird das erweiterte Mapping am 18. November 2017 einsetzen. Daher finden die Anpassungen im MT536 am Montag, 20. November 2017, mit der ersten Übertragung statt. Dies gilt sowohl für das Reporting im "Delta Mode" (gegen 06:00 Uhr) als auch im "Complete Mode" (gegen 18:45 Uhr). Jedoch ist der Roll-Out für den neuen Wert „60 NCSC-T“ Teil der OneClearstream Maßnahmen. Die Einführung ist für das zweite Quartal 2018 geplant.

Bereits heute stellt CBF Lagerstelleninformationen mit dem "TAG 70E (Transaction Details Narrative)" im MT536 zur Verfügung. Diese Angabe wird mit der Kennung "/CUST" bereitgestellt. Der Wert "/CUST" wird mit dem CBF Release in November 2018 ausgebaut. Nur während einer Zwischenperiode werden die Lagerstellendaten mehrfach angezeigt. Kunden, die "/CUST" nutzen, werden gebeten, die Änderung einzuplanen und mit den Umstellungsaktivitäten so bald wie möglich zu beginnen.

Überblick MT536 mit Angabe von TAG "94B Place of Safekeeping"

Tag	Status	Field name	Format	Comment
Optional Subsequence B1a2 Transaction Details				
16R	M	Start of Block	TRANSDT	
94B	O	Place of Trade	TRAD//EXCH/4!n	
94B	O	Place of Safekeeping	SAFE/DAKV/4!a/4!a2!a2!c[3!c]	Neu
36B	M	Posting Quantity	PSTA//4!c15d	
99A	O	Number of Days Accrued	DAAC//[N]3!n	
19A	O	Posting Amount	PSTA//[N]3!a15d	
19A	O	Accrued Interest Amount	ACRU//[N]3!a15d	
22F	M	Transaction Indicator	TRAN//4!c	
22H	M	Receive/Deliver Indicator	REDE//4!c	
22H	M	Payment Indicator	PAYM//4!c	
22F	O	Type of Settlement Transaction	SETR/[8c]/4!c	
22F	O	Corporate Action Event Indicator	CAEV//4!c	
22F	O	Party Capacity Indicator	TRCA/[8c]/4!c	
22F	O	Settlement Transaction Condition Indicator	STCO/[8c]/4!c	
98C	M	Effective Settlement Date/Time	ESET//8!n6!n	
98A	O	Settlement Date/Time	SETT//8!n	
98A	M	Trade Date/Time	TRAD//8!n	
70E	O	Transaction Details Narrative	TRDE//10*35x	

Ausbau / Rückbau von CASCADE Tageslisten

CBF hat in der "Detailed Functional Description" angekündigt, dass nach der erfolgreichen Migration von CBF auf T2S einige CASCADE Tageslisten ausgebaut werden, da sich die Verarbeitungszyklen mit T2S geändert haben. Diese Maßnahme wurde als ein „Post Launch Item“ geplant. CBF führt im November entsprechende Rückbaumaßnahmen durch. Bitte berücksichtigen Sie auch den Abschnitt "["CBF Settlement Procedures \(CASCADE\)"](#)" wegen weiterer Anpassungen.

Beschreibung der Änderungen

Gemäß dem T2S Operational Day findet keine Batch-Verarbeitung während des Tages statt. Während des Tages werden alle Abwicklungsaktivitäten im Real-Time-Modus (RTS) ausgeführt. Der T2S RTS Zyklus beginnt um 05:00 Uhr und endet um 18:00 Uhr. Daher sind die früheren CASCADE Abwicklungszyklen nicht mehr relevant und zugehörige Informationen können nicht mehr geliefert werden. Seit der Migration von CBF auf T2S enthält eine Anzahl von Reports keine Informationen; dies heißt sie sind leer.

Daher können alle CASCADE Settlement Reports, die eine Druckaufbereitung haben und für den früheren CBF Abwicklungszyklus SDS 2 generiert wurden, ausgebaut werden. Die Druckaufbereitung mit dem Job "JQ266000" der CASCADE Tageslisten („Daily CASCADE lists“) wird aus dem produktiven Betrieb gelöscht.

Mögliche Auswirkungen auf Kunden

CBF stellt die "Daily CASCADE lists" über verschiedene Medien zur Verfügung. Diese Listen werden über Connect:Direct, NJE, Hob FT, CBF Fileservice und CA Spool angeboten.

Abhängig von dem gewählten Anbindungsmedium müssen die Kunden angemessene technische und / oder technische Maßnahmen treffen.

CBF plant den Ausbau / Rückbau des Druckjobs mit dem Release im November 2017. Der Druckjob "JQ266000" wird am 17. November 2017 um 13:30 Uhr das letzte Mal gestartet.

5. Stammdaten

CBF begann 2013, regelmäßig Funktionalitäten hinsichtlich der Nutzung unter T2S zu aktualisieren. Dies galt auch für die Pflege der Kontenstammdaten. Ferner wurden die Markt- und Teilnehmerdaten aktualisiert, um die Änderungen widerzuspiegeln, die mit jeder T2S Migrationswelle notwendig wurden.

Mit dem CBF Release im November 2017 wird das T2S Implementation Project die Aktualisierung der Markt- und Teilnehmerdaten finalisieren, da Iberclear am 18. September 2017 auf T2S migrieren wird.

Zusätzlich wird der KUSTA Data Carrier (KUSTA Datenträger) umstrukturiert, da eine Anzahl von Informationen für eine Abwicklung mit T2S nicht notwendig sind. Der Roll-Out dieser Änderungen wird in zwei Schritten erfolgen. Es beginnt mit der Stilllegung von Informationen im November 2017 und wird mit einem Redesign von Dateiformaten / -strukturen in 2018 abgeschlossen. Die Kunden werden über das Implementierungsdatum in 2018 rechtzeitig informiert.

In den folgenden Abschnitten werden beide Anpassungen im Detail beschrieben.

Ausbau / Rückbau von bisherigen CBF Geldkonten

Während der „T2S Wave 4 Customer Readiness Activities“ hatte CBF darüber informiert, dass dedizierte Unterkonten nach der erfolgreichen Migration auf T2S gelöscht werden. Mit dem Release im November 2017 werden Unterkonten gelöscht, die aufgesetzt wurden, um das frühere Cash Management über das RTGS Konto, welches bei den Nationalen Zentralbanken (NZB) besteht, zu unterstützen.

Wie in der Detailed Functional Description “Cash Management” und der “CASCADE Account Description – 2013 / CASCADE Kontobeschreibung – 2013” angezeigt, werden die nachstehenden, zuvor benötigten und nun nach der Migration von CBF auf T2S nicht mehr relevanten Konten:

- cash settlement account (sub-account 220);
- cash funding account (sub-accounts 221-229)⁵;
- cash market account for ESES markets (sub-accounts 261, 263, 265)

geschlossen, sowie die entsprechende Funktionalität bei CBF rückgebaut.

[Beschreibung der Änderungen / Auswirkungen auf Kunden](#)

Diese Information zeigt das Ende der angekündigten T2S Implementierungsmaßnahmen in diesem Bereich der Stammdaten an. Die Maßnahme zum Ausbau / Rückbau wird ausschließlich die internen Prozesse von CBF betreffen. Kunden sollten davon nicht beeinträchtigt werden, da diese Konten seit der Migration von CBF auf T2S nicht mehr genutzt werden.

⁵ Dies wird keine Auswirkung haben auf die neu aufgesetzten Konten, die die Dedicated Cash Accounts darstellen.

Ausbau / Rückbau von marktrelevanten Informationen in 2017

Nach jeder T2S Migrationswelle hatte CBF die Informationen von teilnehmerbezogenen Daten eines Heimatmarkts gelöscht, sobald der betroffene CSD ein T2S In-CSD wurde.

Beschreibung der Änderungen / Auswirkungen auf Kunden

Nach der Implementierung der T2S Final Wave wird mit dem CBF Release in November 2017 die abschließende Aktualisierung der CASCADE Bildschirmanzeigen für die Transaktion "KQAV" ausgeführt. Konkret heißt dies, dass die Marktinformationen für Iberclear werden gelöscht. Dadurch stehen die Teilnehmerdaten nicht mehr zur Verfügung und können daher auch nicht über die entsprechenden Funktionen "IA / IB" abgerufen werden.

Auch in Zukunft können Informationen für die unten aufgeführten Märkte abgerufen werden. Nachstehend finden Sie die Bezeichnung und Beschreibung, die ab 20. November 2017 angezeigt wird:

- 01 DE CBF GERMANY CBF
- 11 US DTCC USA DTCC
- 16 FI EFI FINLAND EFI
- 60 CBL AS ISSUER CBL AS ISSUER
- 90 CH SIS AS ISSUER SWITZERLAND SIX SIS AS ISSUER

Die Anpassung der Beschreibungen kann sich auf die funktionalen und / oder organisatorischen Prozesse der Kunden von CBF auswirken.

Die Löschung des Marktes "25 IBERCLEAR" wird sich zudem im KUSTA Data Carrier „Markets“ widergespiegeln. Kunden, die den KUSTA Data Carrier „Markets“ erhalten, werden eine Reihe von Datensätzen mit Löschungen erhalten. Diese Löschungen werden am Montag, 20. November 2017, in der Datei zur Verfügung gestellt. Kunden müssen darauf vorbereitet sein, dass die Teilnehmerinformationen von Iberclear nicht mehr angezeigt werden.

Weitere Informationen zum Thema Herausnahme des KUSTA Data Carrier „Markets“ können im Abschnitt „Ausbau des KUSTA Data Carrier “Markets” in 2018“ gefunden werden.

Restrukturierung der KUSTA Data Carrier

Zurzeit können Teilnehmer von Clearstream Informationen über Kunden von CBF und über Marktteilnehmer T2S Out-CSD erhalten. Dazu stehen die zwei nachstehend aufgeführten Dateien bereit:

- KUSTA Data Carrier "CBF Customers";
- KUSTA Data Carrier "Market".

Auch nach der Migration auf T2S optimiert CBF Prozesse und passt weiterhin gegenwärtige Verfahren an.

In Folge von internen Analysen und einer Kundenbefragung hat CBF begonnen, die Informationen, die im Dateiformat über Kunden von CBF zur Verfügung gestellt werden, zu überarbeiten. Eine Anpassung wird notwendig, da die T2S Abwicklungsplattform den T2S Party BIC fordert. Zusätzlich wird mit der Implementierung von MiFID II der "Legal Entity Identifier (LEI)" ein wesentliches Kennzeichen im regulatorischen Berichtswesen.

In Zukunft wird der T2S Party BIC und der LEI für jeden Kunden von CBF veröffentlicht. Wenn ein Kunde sich für einen "unpublished participant setup" entschieden hat, werden neben der CBF Kontonummer diese beiden Kennzeichen im KUSTA Data Carrier „CBF Customers“ angezeigt. Im August 2017 werden die Kunden, die ein Konto Setup mit der Kennzeichnung "unpublished participant" nutzen, weitere Informationen zu der beabsichtigten Änderung über E-Mail vom T2S Support Team erhalten. Ende September 2017 wird das Team die Kunden kontaktieren, die bisher

noch keinen LEI eingereicht haben, da diese Informationen ab Anfang Januar 2018 zur Verfügung stehen müssen.

In den vergangenen Jahren wurden die Informationen zu den Kundendaten im KUSTA Data Carrier regelmäßig erweitert. Mit dem CBF Release November 2017 werden weitere Informationen hinzugefügt. Die Kunden von CBF haben darum gebeten, dass eine Kennzeichnung LEI hinzugefügt wird, und hätten gerne einen Indikator, der anzeigt, ob ein Kunde von CBF aufgesetzt ist, Zahlungs- / Lieferungsinstruktionen ("Teilnahme DvP") akzeptiert. Nach der Umsetzung dieser Anforderungen, wird ein Redesign des KUSTA Data Carrier „CBF Customers“ erfolgen. Demzufolge wird eine Anpassung des Formats / der Struktur umgesetzt. Die Einführung dieser Neugestaltung wird in zwei Schritten durchgeführt. Es beginnt mit der Löschung von Informationen im November 2017 und wird mit dem Redesign des Dateiformats / der Dateistruktur in 2018 vervollständigt. Der zweite Schritt ist für Mai 2018 geplant. CBF wird das Implementierungsdatum rechtzeitig bestätigen.

Mit dieser Kundeninformation kündigt CBF den Kunden die Änderungen im KUSTA Data Carrier an und möchte gleichzeitig darauf hinweisen, dass die KUSTA Datei, die über die Clearstream Webseite abgerufen werden kann, entsprechend angepasst wird.⁶

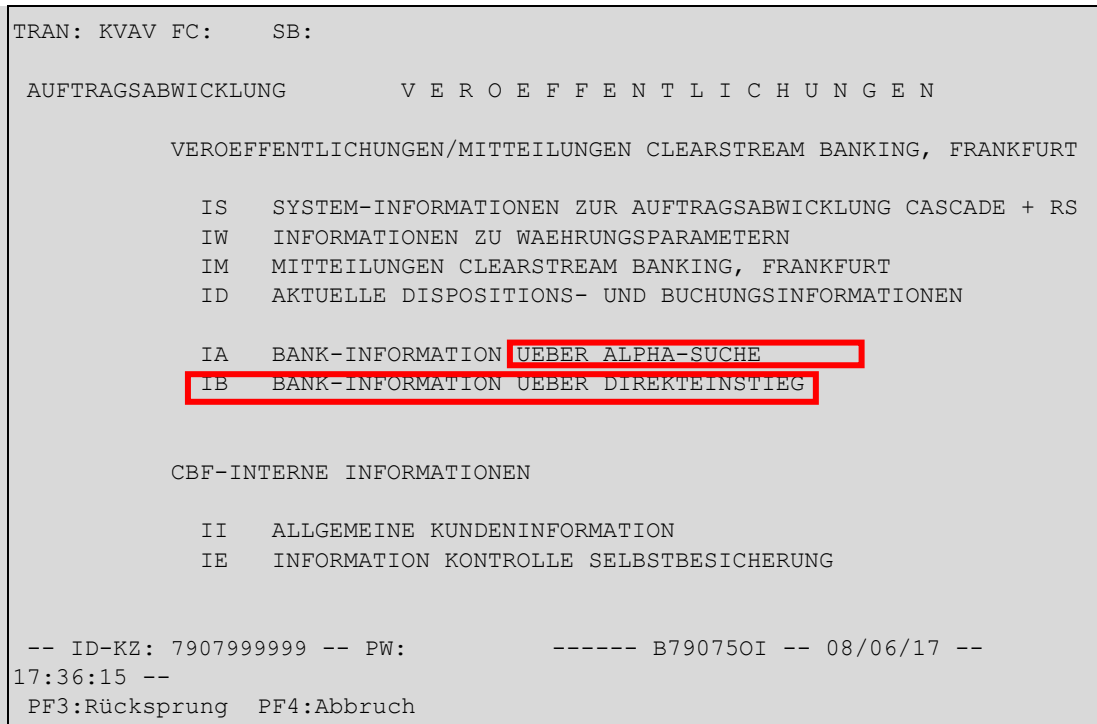
Das Ergebnis der Kundenbefragung hinsichtlich des KUSTA Data Carrier "Market" zeigt, dass nach der Implementierung der T2S Final Wave kein weiterer Bedarf besteht, die Teilnehmerinformationen der Märkte bereitzustellen, wenn CBF einen Link zu einem T2S Out-CSD unterstützt und einen „Direkten Link“ unterhält. Daher wird gleichzeitig mit der Einführung des umgestalteten KUSTA Data Carrier „Customers“, der KUSTA Data Carrier „Markets“ im Mai 2018 aus der Produktion genommen.

Die Aktivitäten zum Redesign sollen im Mai 2018 beendet sein. Das bedeutet auch, dass das Layout der CASCADE Online Funktionalität (HOST / PC) aktualisiert wird. Die Funktion "IB – Bank Information über Direkteinstieg" beziehungsweise „selection bank information“ werden angepasst. Eine Umorganisation dieser Bildschirmanzeige und der Auswahlkriterien ist geplant. In Zukunft können Kunden den BIC, LEI oder Namen als Auswahlkriterium nutzen. Die Anpassungen sind nachfolgend dargestellt.

⁶ <http://www.clearstream.com/clearstream-en/keydocuments--1-/csd--1-/referencedata/customer-listings/kundenlisten/12344>

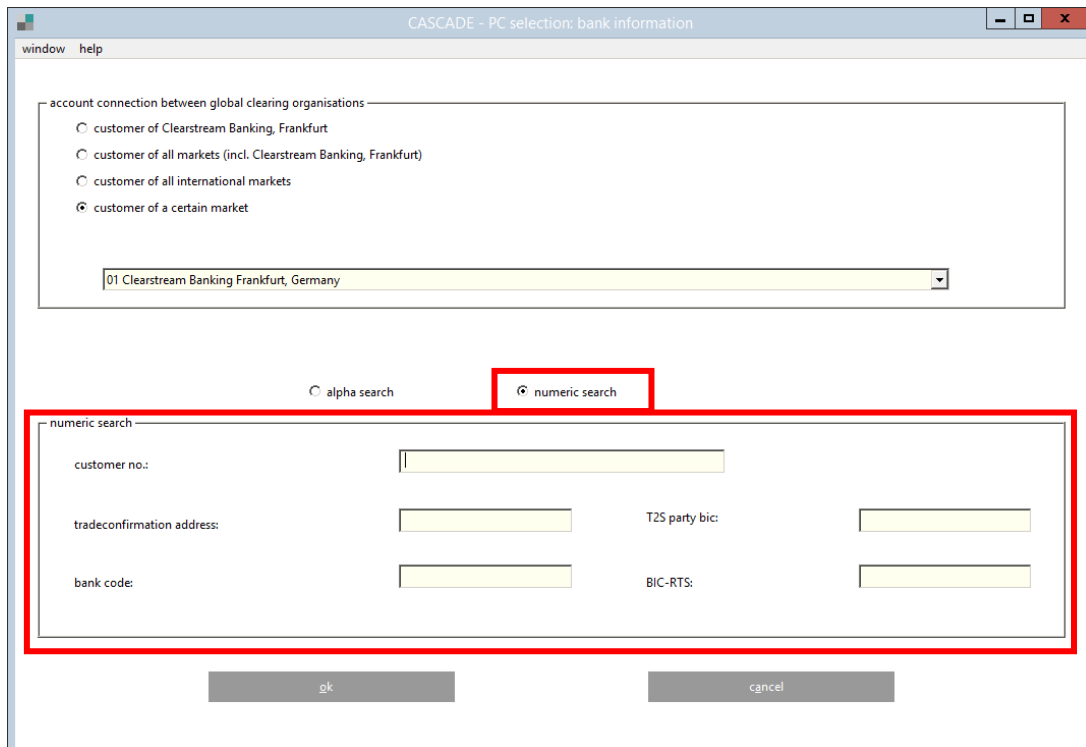
[Layout CASCADE Online "HOST": "KVAV"](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt die Zeilen, die ab Mai 2018 gelöscht werden.



[Layout CASCADE-PC: „selection bank information“](#)

Die Bildschirmabbildung zeigt die Option, die ab Mai 2018 gelöscht wird.



Geplantes Layout CASCADE Online "HOST": "KVAV"

Die Bildschirmabbildung zeigt das geplante Layout ab Mai 2018.

```
TRAN: KVAV FC: IA SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          BANK-INFORMATION          VEROEFFENTLICHUNGEN

                                BANK          :
                                T2S PARTY BIC :
                                LEI          : _____

ALPHASUCHE VON:                BIS:

-- ID-KZ: 7907999999 -- PW:      ----- B790750I -- 08/06/17 -- 16:29:49--
KV0014I Bitte Daten eingeben
```

Auswirkungen der Änderungen im KUSTA Data Carrier "CBF Customers"

Grundsätzlich bleiben die heutigen Auswahlkriterien für die Daten, die im KUSTA Data Carrier „CBF Customers“ übertragen werden, unverändert.

In Zukunft werden die Namen- und Adressangaben aus dem an CBF bekanntgegebenen „rechtlichen Sitz“ ermittelt. Dies unterscheidet sich zu heute, wo diese Angaben aus der Kontoanschrift ermittelt werden.

In Vorbereitung auf die Umgestaltung werden in den nachstehend aufgeführten Datenfeldern ab November 2017 keine Informationen mehr übermittelt. Abhängig vom Format wird der Wert entweder als leer (" ") oder Null ("0") angezeigt.

- Veröffentlichung / Indicator which data is provided
- Postleitzahl / P.O. Box
- Telefon, Telefax / Telephone, Fax
- SWIFT Adresse / SWIFT Address
- Buchungsart / Posting Type
- CBF-Verrechnung / Clearing
- Bankleitzahl / Bank Code Number
- BIC-RTS / BIC-RTS
- T2S Relevant / T2S Relevance

Am Montag, 20. November 2017, wird CBF den KUSTA Data Carrier wie üblich bereitstellen. Kunden, die die Datei im "Delta Mode" nutzen, werden ein erweitertes Reporting erhalten. Alle Datensätze, die im „Full Report“ übermittelt werden, werden auch über "Delta Mode" zur Verfügung gestellt. CBF wird dieses erweiterte Reporting nur einmal zur Verfügung stellen. Daher werden die Kunden gebeten, falls notwendig, sich darauf vorzubereiten.

Die Tabelle auf den folgenden Seiten zeigt die Änderungen, die in zwei Phasen umgesetzt werden.

- Für jedes Feld wird angegeben, ob die Daten unverändert bleiben oder angepasst werden.
- "N/A" zeigt an, dass die heutige Definition unverändert bleibt.
- Die Spalte "Modification 2017" gibt an, welche Details für den 20. November 2017 berücksichtigt werden sollen.
- Die Spalte "Modification 2018" zeigt die Änderungen an, die im Mai 2018 eingeführt werden.
- Jede redaktionelle Änderung in der Spalte "Description" ist hervorgehoben (Beispiel: [Text](#)).

Am Ende dieses Abschnitts wird das finale Layout bzw. Struktur des künftigen KUSTA Data Carrier "CBF Customers" vorgestellt, welche im Mai 2018 produktiv sein soll. CBF möchte darauf hinweisen, dass die Änderungen verbindlich umgesetzt werden. Kunden, die diese Datei nutzen, werden gebeten, sich auf den Roll-Out vorzubereiten. Mit dieser frühzeitigen Ankündigung möchte CBF die Vorbereitungsaktivitäten mit der entsprechenden Vorlaufzeit auf der Kundenseite unterstützen.

Neugestaltung KUSTA Data Carrier "CBF Customers" – Anpassungen in 2017 und 2018

Nr.	Feldname	Beschreibung	Format bis 2018	Format ab 2018	Anpassungen November 2017	Anpassungen 2018
1	Satztyp	Kennzeichnung, ob dieser Datensatz Informationen über einen „CBF Inland“ (domestic) Kontoinhaber enthält.	N(3)	deleted	N/A	N/A
2	Status	Kennzeichnung, ob dieser Datensatz Informationen über eine Anpassung, Löschung oder ein neues Konto enthält / falls eine volle Datei zur Verfügung gestellt wird, bezieht sich die Kennzeichnung immer auf ein neues Konto. Dies gilt auch, wenn der Kunde ein "unpublished participant setup" gewählt hat.	A(1)	A(1)	N/A	N/A
3	CBF-ID	CBF Nummer / Bank Nummer Location N(3), Main account number N(5) Zum Beispiel: CBF-ID: 7002 → 00700002 Dies gilt auch, wenn der Kunde ein "unpublished participant setup" gewählt hat.	N(8)	N(4)	N/A	Formatänderung; der CBF Kontostamm (4-stellig) wird angezeigt.
4	Veröffentlichung	Kennzeichnung, welche Daten zur Verfügung stehen Basisinformationen (Name, Stadt, Börsenplatz). Komplettinformationen (alle Felder werden zur Verfügung gestellt, sofern vorhanden)	N(1)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "0".	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.

Nr.	Feldname	Beschreibung	Format bis 2018	Format ab 2018	Anpassungen November 2017	Anpassungen 2018
5	Name	Name entspricht der Angabe aus dem rechtlichen Sitz des Kontostamms; wenn der Kunde ein "unpublished participant setup" gewählt hat, dann wird "UNPUBLISHED PARTICIPANT" angezeigt.	A(35)	A(71)	Nach dem Einsatz des CBF Release November 2017 werden die Details aus der offiziellen Anschrift gezogen.	Das Format dieses Feldes wird von A(35) auf A(71) geändert.
6	Name Fortsetzung	Name – Fortsetzung, wenn notwendig	A(35)	deleted	N/A	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein. Das Format des Feldes "Name" wird geändert, siehe Feld Nr. 5.
7	Ort	Stadt entspricht der Angabe aus dem rechtlichen Sitz des Kontostamms.	A(30)	A(30)	Feldname, Feldtyp und Feldlänge bleiben unverändert. Ab dem Einsatz im November 2017 werden die Details aus dem rechtlichen Sitz bezogen.	N/A
8	Börsenplatz	Börsenplatz gemäß CBF-ID	N(3)	N(3)	N/A	N/A
9	AWV-Gebiet	AWV-Gebiet	N(3)	N(3)	N/A	N/A
10	AWV-Land	AWV-Land	N(5)	N(5)	N/A	N/A
11	Kontengruppe	Kontengruppe	N(3)	N(3)	N/A	N/A
12	Strasse	Straße entspricht der Angabe aus dem rechtlichen Sitz des Kontostamms.	A(30)	A(30)	Feldname, Feldtyp und Feldlänge bleiben unverändert. Ab dem Einsatz im November 2017 werden die Details aus dem rechtlichen Sitz bezogen.	N/A
13	Postfach	Postfach	A(10)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "leer"; es werden keine Daten bereitgestellt.	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.

Nr.	Feldname	Beschreibung	Format bis 2018	Format ab 2018	Anpassungen November 2017	Anpassungen 2018
14	Postleitzahl Strasse	Postleitzahl Strasse entspricht der Angabe aus dem rechtlichen Sitz des Kontostamms.	A(5)	A(10)	N/A	Formatänderung.
15	Postleitzahl Postfach	Postleitzahl Postfach	A(5)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "leer"; es werden keine Daten bereitgestellt.	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.
16	Postleitzahl Großkunde	Postleitzahl Großkunde	A(5)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "leer"; es werden keine Daten bereitgestellt.	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.
17	Telefon	Telefon	A(20)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "leer"; es werden keine Daten bereitgestellt.	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.
18	Telefax-Nummer	Fax	A(20)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "leer"; es werden keine Daten bereitgestellt.	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.
19	SWIFT-Adresse	SWIFT Adresse	A(12)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "leer"; es werden keine Daten bereitgestellt.	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.
20	Börsen-Teilnehmer	Börsen-Teilnehmer	N(3)	N(3)	N/A	N/A
21	Auslandsteilnehmer	Auslandsteilnehmer	N(3)	N(3)	N/A	N/A
22	Eurex-Teilnehmer	EUREX-Teilnehmer	N(3)	N(3)	N/A	N/A
23	Buchungsart	Buchungsart	N(3)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "0".	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.

Nr.	Feldname	Beschreibung	Format bis 2018	Format ab 2018	Anpassungen November 2017	Anpassungen 2018
24	CBF-Verrechnung	BIC11 für CBF Clearing	A(11)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "leer"; es werden keine Daten bereitgestellt.	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.
25	Bankleitzahl	Bankleitzahl	N(8)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "0".	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.
26	BIC-RTS	BIC für RTS	A(11)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "leer"; es werden keine Daten bereitgestellt.	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.
27	Reg-Ueber	CBF Nummer / Bank Nummer Location N(3), Main account number N(5) For example: CBF-ID: 7002 → 00700002	N(8)	N(4)	N/A	Formatänderung; der CBF Kontostamm (4-stellig) wird angezeigt und daher wird sich das Format ändern.
28	T2S Relevant	Kennzeichnung, ob der Kontostamm auf T2S abgebildet wird. J (yes), N (no), NK (account only; only Securities Account (SAC))	A(2)	gelöscht	Dieses Feld wird rückgebaut, daher ist ab dem CBF Release November 2017 der Inhalt "leer"; es werden keine Daten bereitgestellt.	Dieses Feld wird nicht Teil des zukünftigen Layouts / Struktur sein.
29	T2S Party BIC	BIC 11 für die Abwicklung auf T2S; Dieses Feld enthält nur dann Informationen, wenn der Kontostamm relevant ist für die Abwicklung auf der T2S Abwicklungsplattform. Der T2S Party BIC wird für jeden CBF Kundenstamm zur Verfügung gestellt, auch wenn der Kunde ein "unpublished participant setup" gewählt hat.	A(11)	A(11)	N/A	N/A

Nr.	Feldname	Beschreibung	Format bis 2018	Format ab 2018	Anpassungen November 2017	Anpassungen 2018
30	LEI	Legal Entity Identifier 20-stelliger Code, der bestimmte juristische Personen ausweist, die an Finanzgeschäften teilnehmen. <u>Der LEI wird für jeden CBF Kundenstamm zur Verfügung gestellt, auch wenn der Kunde ein "unpublished participant setup" gewählt hat.</u>	A(20)	A(20)	<u>Neuer Wert</u> , der mit dem CBF Release November 2017 eingeführt wird.	N/A
31	Teilnahme DvP	Kennzeichnung, ob Zahlungs- / Lieferungs-Instruktionen möglich sind	A(1)	A(1)	<u>Neuer Wert</u> , der mit dem CBF Release November 2017 eingeführt wird.	N/A
32	Filler	Filler	A(3)	A(116)	Bereich wird im Rahmen der Änderungen, die mit dem Release November 2017 eingeführt werden angepasst.	Bereich wird im Rahmen der Änderungen, die in 2018 eingeführt werden angepasst.

Ende der Tabelle / Beschreibung

Tabelle 6 Neugestaltung KUSTA Data Carrier "CBF Customers" – Anpassungen in 2017 und 2018

Voraussichtliche Struktur KUSTA Data Carrier "CBF Customers" in 2018

Die nachstehende Tabelle beschreibt das künftige Layout / Struktur des KUSTA Data Carrier "CBF Customers". Die Einführung ist für den Mai 2018 geplant.

Kunden, die diese Datei nutzen, müssen sich auf die Umgestaltung (den Roll-out) vorbereiten. Ähnlich der Vorgehensweise im November 2017 ist auch für diesen Einsatz ein erweitertes Reporting vorgesehen. Alle Datensätze, die im „Full Report“ übermittelt werden, werden auch im "Delta Mode" zur Verfügung gestellt.

No.	Field name	Description	Format
1	Status	Indicator, whether this data set provides information on entry, modification or deletion. This is also valid if the customer opts "unpublished participant setup".	A(1)
2	CBF-ID	The CBF account master (4-digits) is presented. This data is available, even though the customer opts for an "unpublished participant setup".	N(4)
3	T2S Party BIC	T2S Party BIC This data is available, even though the customer opts for an "unpublished participant setup".	A(11)
4	LEI	LEI This data is available, even though the customer opts "unpublished participant setup".	A(20)
5	Name	Name As given in legal address of the account master. If the customer opts for an "unpublished participant setup", then "UNPUBLISHED PARTICIPANT" is shown.	A(71)
6	Strasse	Street	A(30)
7	Postleitzahl Strasse	Postal Code	A(10)
8	Ort	City	A(30)
9	Börsenplatz	Place of Stock Exchange indicated by CBF-ID	N(3)
10	AWV-Gebiet	German foreign trade regulations – Area	N(3)
11	AWV-Land	German foreign trade regulations – Country	N(5)
12	Kontengruppe	Account group	N(3)
13	Börsen-Teilnehmer	Stock Exchange Participant	N(3)
14	Auslandsteilnehmer	Foreign Participant	N(3)
15	EUREX-Teilnehmer	EUREX Participant	N(3)
16	Reg-Ueber	The CBF account master (4-digits) is presented	N(4)
17	Teilnahme DvP	Indicator, whether against payment transactions will be possible	A(1)
18	Filler	Filler	A(116)

Ende der Tabelle / Beschreibung

Tabelle 7 Zukünftiges Format / Struktur KUSTA Data Carrier ab 2018

Ausbau des KUSTA Data Carrier "Markets" in 2018

Mit dem CBF Release November 2017 wird CBF die Aktualisierung der Markt- und Teilnehmerdaten finalisieren, da Iberclear am 18. September 2017 auf T2S migrieren wird. Weitere Informationen können im zuvor beschriebenen Abschnitt "Ausbau / Rückbau von marktrelevanten Informationen" gefunden werden.

Die Marktbefragung hinsichtlich des KUSTA Data Carrier "Market" zeigt, dass hinsichtlich der Implementierung der T2S Final Wave kein weiterer Bedarf besteht, die Teilnehmerinformationen der Märkte zu übermitteln, wenn CBF ein T2S Out-CSD Setup unterstützt und einen „Direkten Link“ unterhält. Daher wird der KUSTA Data Carrier „Markets“ im Mai 2018 aus dem produktiven Betrieb genommen.

Aktivitäten in der Kundensimulation im November 2017

Kunden können entscheiden, ob Testfälle in die CBF Kundensimulationsumgebung (IMS23) hinsichtlich der Änderungen von T2S oder durch die erweiterte CBF Funktionalität durchgeführt werden sollen.

Gemäß der Planung der EZB wird die aktualisierte Software für das T2S Release 1.3.1 am 16. Oktober 2017 im T2S Pre-Production Environment (UTEST) bereitgestellt. CBF wird die Verfügbarkeit der erweiterten Software in der IMS23 sicherstellen und die Kunden über die weiteren Schritte informieren. Mit dieser Kundeninformation avisiert CBF, dass eine Downtime (Nichtverfügbarkeit) erforderlich wird, bevor die Kunden mit den Simulationsaktivitäten beginnen können. Nach der Stabilisierungsphase für die CBF Aktivitäten bezüglich der Migration der T2S Final Wave wird die IMS23 ab dem 2. Oktober 2017 geschlossen sein und am 16. Oktober 2017 wieder geöffnet werden.

Bitte beachten Sie, dass die Teilnahme am Test für das Release im November 2017 freiwillig ist und Kunden ihre Testfälle nach eigenem Ermessen durchführen können. Der Inhalt und Zeitraum der Simulation für T2S-bezogene CBF Erweiterungen richtet sich an den Maßnahmen für das CBF Release November 2017 aus. Daher wird das Testfenster am 23. Oktober 2017 mit allen Anpassungen von CBF Software geöffnet werden. Im Hinblick auf die funktionalen Erweiterungen für die Bereiche "Stammdaten" und "Kapitaldienste (KADI)" möchte CBF die Kunden gerne unterstützen. Für diese Änderungen werden Testdaten aufgesetzt. Die derzeitige Planung sieht vor, dass für

- Stammdaten – KUSTA Data Carrier "CBF Customers"
eine Testdatei in der ersten Woche im November 2017 zur Verfügung gestellt werden soll;
- Kapitaldienste (KADI) – Event Type "Conversion (TA 232)"
zwei Maßnahmen für Anfang November 2017 aufgesetzt werden sollen. Weitere Informationen über die Details zur Kapitalmaßnahme („Focus Days“) werden rechtzeitig zur Verfügung gestellt.

Um die erforderlichen Testdaten aufzusetzen, benötigt das CBF T2S Support Team eine Registrierung für die geplanten dedizierten Testfälle ("Focus Days"). Das Registrierungsformular wird rechtzeitig bereitstehen.

Hinsichtlich der Erweiterung des CBF Cash Forecast Reporting soll ein "End-to-end Test" mit Eurex Clearing AG geplant werden. Dieser Test erfordert eine Abstimmung mit dem CCP Testkalender. Zurzeit ist vorgesehen, den End-to-end Fluss im Zeitraum 23. bis 28. Oktober 2017 zu ermöglichen.

CBF Customer Readiness Plan bis Ende 2017

Überblick zu den wichtigen Eckdaten in den kommenden Monaten

Oktober 2017	2. - 16. Oktober	CBF Simulationsumgebung für Kunden (IMS23) ist geschlossen. Während dieses Zeitraums werden die aktualisierten Programmversionen installiert.
	16. Oktober	Die EZB wird das T2S Release 1.3.1 in der UTEST installieren.
	23. Oktober	Die Kundensimulation für das T2S Release 1.3.1. mit den von CBF zugehörigen Erweiterungen für T2S zum Release im November 2017 beginnt.
	30. Oktober	Anpassung der Kundenstammdaten wegen der Veröffentlichung von Kontoinformationen im KUSTA Datenträger.
November 2017	6. November	CASCADE-PC Software Version 9.3 steht zum Download bereit. Die Installation dieser Version ist obligatorisch.
	9. November	T2S Release 1.3.1. "Go/No-Go Decision" der CSD Steering Group
	20. November	Produktionsstart für das CBF November Release, die zugehörigen Erweiterungen von CBF für das T2S Release 1.3.1 und T2S Release 1.3.1.
Dezember 2017	1. Dezember	Der "Legal Entity Identifier (LEI)" soll bis zu diesem Zeitpunkt bei CBF abgegeben sein, damit die Kundenstammdaten aktualisiert werden können.
	22. Dezember	CBF Simulationsumgebung für Kunden (IMS23) wird bis zum Jahresende geschlossen sein.

Kontakt

Das T2S Support Team von Clearstream wird gerne Ihre Fragen zum Umfang des T2S Release 1.3.1 und den CBF Erweiterungen beantworten.

Bitte beachten Sie, dass nach dem erfolgreichen Einsatz des Release im November 2017 unsere Client Services Teams für alle Kundenfragen hinsichtlich der Produktionsprozesse zuständig sind.

Clearstream T2S Support Team
Email: T2S-Support@clearstream.com
Tel. +49 (0) 69 / 211 18 27 8
Fax. +49 (0) 69 / 211 60 80 60

Clearstream Migrated to T2S - We Will Support You

Anhang

A. T2S Release Concept⁷

<p>Q1 February</p>	<ul style="list-style-type: none">– A “problem release” is planned for the third weekend in February– This release bring the resolution of reported problems in production– The concept defines a testing period of two weeks in UTEST; that is so CSD participants can execute their test cases for the upcoming deployment
<p>Q2 June</p>	<ul style="list-style-type: none">– A “major release” is planned for the second weekend of June– This release will cover functional enhancements, meaning it will contain T2S Changes. It might contain the resolution of reported problems in production– The concept defines a testing period of eight weeks in UTEST; that is so CSD participants can execute their test cases for the upcoming deployment
<p>Q3 September</p>	<ul style="list-style-type: none">– A “problem release” is planned for the third weekend in September– This release bring the resolution of reported problems in production– The concept defines a testing period of two weeks in UTEST; that is so CSD participants can execute their test cases for the upcoming deployment
<p>Q4 November</p>	<ul style="list-style-type: none">– A “minor release” is planned for the third weekend in November– This release bring the resolution of reported problems in production. It can potentially contain functional enhancements if decided by the different T2S committees– The concept defines a testing period of four weeks in UTEST; that is so CSD participants can execute their test cases for the upcoming deployment

⁷ Bitte beachten Sie, dass CBF die Angaben von T2S verwendet und diese daher in englischer Sprache aufgeführt werden

B. Scope of Launch Dates – Potential Release Items⁸

T2S Change Requests (CRs)	<ul style="list-style-type: none">– The nature of a change request (CR) is to enhance existing software.– T2S changes might bring new services or enrich existing functionality– CBF's investigation might show that there is a need to modify its software to ensure today's processing– There might be impact for customers acting in ICP and DCP mode. Hence, customers are requested to analyse their internal procedures. Also, customers might be forced to modify their software
T2S Problem Tickets (PBIs)	<ul style="list-style-type: none">– A production issue (PBI) which requires a software fix is deployed with a T2S Release. With the updated software the originally defined functionality / service will be made available– In general, such deployments shall not result in software changes. Existing, potential workarounds can be avoided. Hence, customers acting in ICP and DCP mode can execute the procedures as initially planned
CBF Software Enhancement	<ul style="list-style-type: none">– T2S Change Requests can result in modifications of the CBF software– CBF aims to absorb the impacts on the customers as much as possible.– If customer impact is assumed, a notification will be sent in due time– Customers acting in DCP mode are requested to analyse if there is a potential impact

⁸ Bitte beachten Sie, dass CBF die Angaben von T2S verwendet und diese daher in englischer Sprache aufgeführt werden