

# CBF SWIFT & Connectivity Änderungen - Updates

November 2012

## **CBF SWIFT & Connectivity Änderungen - Updates**

Oktober 2012

Dokumentnummer: F-CON20

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

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

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

## CBF SWIFT & Connectivity-Änderungen im November 2012

Clearstream Banking Frankfurt (CBF) stellt in dieser Kundeninformation die Änderungen im Zusammenhang mit dem SWIFT Standard Release 2012 vor. Diese Änderungen werden mit Wirkung zum **17. November 2012** eingeführt.

Die vorliegende Zusammenfassung bezieht sich auf die CBF-Änderungen im Rahmen des SWIFT Standard Releases, zusätzliche CBF Connectivity Änderungen, auf weitere Implementierungen im Rahmen der Securities Markets Practice Groups (SMPG) und auf Vereinheitlichungen der verschiedenen Nachrichtentypen.

Jedes Jahr veröffentlicht SWIFT Spezifikationen für die verschiedenen ISO15022 Nachrichtentypen. Diese geänderten bzw. erweiterten Spezifikationen beziehen sich auf die Anforderungen der National Market Practice Groups (NMPGs) und der SMPGs.

Clearstream Banking Frankfurt (CBF) wird in der Upgrade Information den fachlichen Hintergrund zu den verschiedenen Änderungen/Anpassungen erläutern.

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

Im Rahmen des SWIFT Release im November 2012 werden die nachfolgend beschriebenen Änderungen von Clearstream Banking Frankfurt umgesetzt. Diese Änderungen gelten für Nachrichten im ISO15022 Format, die über das SWIFT Netzwerk, über IBM WebSphere MQ sowie über die File-Transfer Schnittstelle empfangen bzw. versendet werden.

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

Die Informationen sind in folgende Abschnitte gegliedert:

- Clearing and Settlement Services
- Custody Services

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

Leerseite

# Inhalt

<b>CBF SWIFT &amp; Connectivity .....</b>	<b>2</b>
<b>Änderungen - Updates.....</b>	<b>2</b>
November 2012.....	2
<b>CBF SWIFT &amp; Connectivity Änderungen -Updates .....</b>	<b>3</b>
<b>CBF SWIFT &amp; Connectivity-Änderungen im November 2012 .....</b>	<b>4</b>
<b>1. Clearing und Settlement Services .....</b>	<b>8</b>
1.1 MT535 Statement of Holdings .....	8
1.2 MT536 Statement of Transactions .....	8
1.3 MT537 Statement of Pending Transactions .....	8
1.4 MT586 Statement of Settlement Allegements .....	8
1.5 MT530 Transaction Processing Command.....	9
1.6 MT540-543 Settlement Instructions .....	9
1.7 MT544 - 547 Settlement Confirmations.....	11
1.8 MT548 Settlement Status and Processing Advice .....	13
1.9 MT578 Settlement Allegement.....	14
1.10 MT569 Triparty Collateral and Exposure Statement .....	14
1.11 MT942 Interim Transaction Report / EUR Cash Clearing Report .....	14
<b>2. Custody Services.....</b>	<b>15</b>
2.1 Änderungen aus dem SWIFT SR 2012 .....	15
2.2 Anpassungen an die Market Practice.....	16
2.3 Einführung des MT564 und MT566 für die Hauptzahlstelle .....	23
2.4 Einführung des MT564 und MT566 für den Lead Manager in TA231 .....	34
2.5 Einführung des Real Time-MT564 ab Stichtag.....	42
2.6 Ausbuchung wertlos gemeldeter Zertifikate und Optionsscheine .....	45

Leerseite

## 1. Clearing und Settlement Services

Die neuen Clearing und Settlement Services und Änderungen, die ab dem 17. November 2012 im Rahmen des SWIFT Release eingeführt werden, sind in diesem Kapitel beschrieben.

### 1.1 MT535 Statement of Holdings

---

**Keine Änderungen**

### 1.2 MT536 Statement of Transactions

---

**Keine Änderungen**

### 1.3 MT537 Statement of Pending Transactions

---

**OTC**

**Teilsequenz C2, Transaction Details**

**:70E::TRDE// Transaction Details Narrative**

Aktuell wird das Narrative aus dem Feld :70E::SPRO der ursprünglichen Instruktion MT540-543 nicht im MT537 angezeigt.

In Zukunft wird das Feld 70E::TRDE und dem Label /FREE mit dem Narrative der ursprünglichen Instruktion aus dem Feld 70E::SPRO gefüllt

:98A::SETT//20121224

:98A::TRAD//20121221

:70E::TRDE///QRYR Q02-2G/FREE TEXT BEISPIEL

:16R:SETPRTY

### 1.4 MT586 Statement of Settlement Allegements

---

**Teilsequenz B5a Settlement Parties**

**:70C::PAC0// Party Narrative**

Aktuell wird das Narrative aus dem Feld :70E::SPRO der Instruktion MT540-541 des Kontrahenten nicht im MT586 angezeigt. Für Lieferungen des Kontrahenten wird das Narrative bereits heute angezeigt.

In Zukunft wird das Narrative des Feldes :70E::SPRO aller Instruktionen im Feld 70C::PACO angezeigt.

:97A: :SAFE//55550000  
:70C: :PACO//TEXT BEISPIEL  
:16S: SETPRTY

## 1.5 MT530 Transaction Processing Command

---

**Keine Änderungen**

## 1.6 MT540-543 Settlement Instructions

---

Die SWIFT Network Validation Rules werden für MQ-Series und File-Transfer angewandt. Folgende SWIFT Network Validation Rules werden häufig missachtet:

### **Teilsequenz E1 Settlement Parties**

**:95C::PSET// Place of Settlement**

**:95P::PSET// Place of Settlement**

**:95Q::PSET// Place of Settlement**

Aktuell ist es möglich, den Place of Settlement für Instruktionen, die über MQ-Series oder File-Transfer gesendet werden, nicht anzugeben.

In Zukunft werden Instruktionen ohne Place of Settlement abgelehnt, da das Feld Place of Settlement nach den SWIFT Network Validation Rules verpflichtend ist.

### **Teilsequenz E1 Settlement Parties**

**:95C::DEAG// Delivering Agent**

**:95P::DEAG// Delivering Agent**

**:95Q::DEAG// Delivering Agent**

Aktuell ist es möglich, den Delivering Agent für Instruktionen des Typs MT540 und MT541, die über MQ-Series oder File-Transfer gesendet werden, nicht anzugeben.

In Zukunft werden MT540 und MT541 Instruktionen ohne Delivering Agent abgelehnt, da das Feld Delivering Agent für den MT540 und MT541 nach den

SWIFT Network Validation Rules verpflichtend ist.

### **Teilsequenz E1 Settlement Parties**

**:95C::REAG// Receiving Agent**

**:95P::REAG// Receiving Agent**

**:95Q::REAG// Receiving Agent**

Aktuell ist es möglich, den Receiving Agent für Instruktionen des Typs MT542 und MT543, die über MQ-Series oder File-Transfer gesendet werden, nicht anzugeben.

In Zukunft werden MT542 und MT543 Instruktionen ohne Receiving Agent abgelehnt, da das Feld Receiving Agent für den MT542 und MT543 nach den SWIFT Network Validation Rules verpflichtend ist.

### **Teilsequenz E1 Settlement Parties**

**:95Q:: Party Format**

Aktuell ist es bei Instruktionen, die über MQ Series oder File Transfer geschickt werden, möglich, dass eine Zeile mit einem Schrägstrich „/“ beginnt oder endet bzw. das Feld zwei hintereinander folgende Schrägstriche „//“ beinhaltet.

In Zukunft werden MT540 - MT543 Instruktionen, die in einer Zeile mit einem Schrägstrich „/“ beginnen oder enden oder aber zwei Schrägstriche „//“ enthalten, abgelehnt.

Folgende CBF internen Validierungen werden für Instruktionen des Typs MT540 und MT541 umgesetzt:

### **Teilsequenz E1 Settlement Parties**

**:70E::DECL// Declaration Details Narrative**

#### **Label /SETR – Securities Transfer Reason**

Aktuell wird das Label /SETR für den MT540 und MT541 nur für match-pflichtige Geschäfte mit Iberclear benötigt. Der Kunde kann bislang aber für den MT540 und MT541 andere gültige Werte senden, die aber keine Bedeutung für die Verarbeitung haben.

In Zukunft werden für den MT540 und MT541 nur noch Instruktionen mit dem Label /SETR in Feld :70E::DECL akzeptiert, die für match-pflichtige Geschäfte mit Iberclear bestimmt sind. In allen anderen Fällen werden der MT540 und MT541 mit dem Label /SETR in Feld :70E::DECL abgelehnt.

## Erweiterung der Funktionalität für File-Transfer

CBF Kunden haben die Möglichkeit, Instruktionen über MQ-Series oder SWIFT gezielt zu markieren, für die der Kunde keine Confirmation (MT544-547) oder aber einen Status Advice (MT548) erhalten möchte (Die Status des Produktes Matching-Informationen MTCH/MACH (matched) und MTCH/NMAT mit NMAT/CMIS (unmatched) sind darin nicht eingeschlossen). Hierzu muss sich der Kunde bei CBF für diesen Service registrieren lassen.

Dieser Service wird über das Feld :22F::RPOR (Reporting Indikator) in den MT540-543 Instruktionen gesteuert.

- Wenn das Feld :22F::RPOR mit dem Zeichen „DAKV/NCON“ gefüllt wird, erhält der Kunde keine Settlement Bestätigungen oder Status Informationen über die gewählten Produkte für die MT544-547 oder MT548.
- Wenn das Feld :22F::RPOR nicht genutzt wird, erhält der Kunde Settlement Bestätigungen oder Status Informationen über die gewählten Produkte für die MT544-547 oder MT548.

## Teilsequenz B1 Financial Instrument Attributes

### :22F::RPOR/DAKV/NCON Reporting Indicator

Aktuell kann dieser Service nicht für File-Transfer genutzt werden.

In Zukunft ist es möglich über File-Transfer Instruktion zu kennzeichnen, für die der Kunde keine Settlement Bestätigungen und keine Statusinformationen des Produktes Processing Information erhalten möchte.

```
:16R: TRADDET  
:98A: :SETT//20120703  
:35B: ISIN DE0000000000  
      Name XXX  
:22F: :RPOR/DAKV/NCON  
:16S: TRADDET
```

## 1.7 MT544 - 547 Settlement Confirmations

---

### OTC

#### Sequenz B Trade Details

#### :70E::SPRO// Settlement Instruction Processing Narrative

Aktuell wird das Narrative aus dem Feld :70E::SPRO der ursprünglichen Erhalt Instruktion MT540 und MT541 nicht im MT544 und MT545 angezeigt.

In Zukunft wird das Feld 70E::SPRO der MT544 und MT545 mit dem Narrative der ursprünglichen Instruktion aus dem Feld 70E::SPRO gefüllt.

:16R: TRADDET  
:98A: :TRAD//20121218  
:98A: :ESET//20121218  
:35B: ISIN DE0000000000  
      Name XXX  
:22F: :PRIR/DAKV/0004  
:70E: :SPRO//TEXT BEISPIEL  
:16S: TRADDET

### **Teilsequenz A1 Linkages**

#### **:20C::CORP// Corporate Action Reference**

Aktuell wird die Corporate Action Reference nicht für alle Buchungen der AA01 und AA02 zu Kapitalmaßnahmen angezeigt.

In Zukunft wird das Feld :20C::CORP mit der Corporate Action Reference gefüllt, falls eine Kapitalmaßnahme der Buchung zugrunde liegt und die Reference in CASCADE angezeigt wird.

:16R: LINK  
:20C: :RELA//123456  
:16S: LINK  
:16R: LINK  
:20C: :TRRF//KP77770107240270  
:16S: LINK  
:16R: LINK  
:20C: :COMM//278900  
:16S: LINK  
:16R: LINK  
:20C: :CORP//27892009110503100  
:16S: LINK

### **Teilsequenz E1 Settlement Parties**

#### **:95a:: 4!C//Party**

Aktuell wird für die Vaults-Auftragsarten (CASCADE Auftragsart AA16 und AA18) nur die erste Ebene der Settlement Parties REAG und DEAG gefüllt.

In Zukunft werden auch die beiden weiteren Ebenen RECU/DECU und BUYR/SELL gefüllt, soweit sie im zugrunde liegenden Wertpapier-Auftrag vorhanden sind.

:16R: SETDET  
:22F: :STCO//PHYS

:22F: :SETR//TRAD  
:22F: :RTGS//NRTG  
:16R: SETPRTY  
:95Q: :BUYR//Testkonto  
:97A: :SAFE//KTO-11111111  
:16S: SETPRTY  
:16R: SETPRTY  
:95Q: :DEAG//UNKNOWN  
:97A: :SAFE//79640888  
:16S: SETPRTY

## 1.8 MT548 Settlement Status and Processing Advice

---

### OTC

#### Sequenz B Settlement Transaction Details

##### **:70E::SPRO// Settlement Instruction Processing Narrative**

Aktuell wird das Narrative aus dem Feld :70E::SPRO der ursprünglichen Erhalt Instruktion MT540 und MT541 nicht im MT548 angezeigt.

In Zukunft wird das Feld 70E::SPRO der MT548 mit dem Narrative der ursprünglichen Instruktion aus dem Feld 70E::SPRO gefüllt.

- Für Instruktionen mit dem Status MTCH/MACH (matched) wird das Narrative des Kontrahenten angezeigt.
- Für alle anderen Status wird das Narrative der eigenen Instruktion angezeigt.

:16R: TRADDET  
:98A: :TRAD//20121218  
:98A: :ESET//20121218  
:35B: ISIN DE0000000000  
Name XXX  
:22F: :PRIR/DAKV/0004  
:70E: :SPRO//TEXT BEISPIEL  
:16S: TRADDET

#### Teilsequenz A1 Linkages

##### **:20C::CORP// Corporate Action Reference**

Aktuell wird die Corporate Action Reference im MT548 nicht angezeigt.  
In Zukunft wird die Corporate Action Reference im Feld :20C angezeigt.

:16R: LINK  
:20C: :RELA//123456  
:16S: LINK  
:16R: LINK  
:20C: :TRRF//KP79070107240270  
:16S: LINK  
:16R: LINK  
:20C: :COMM//278900  
:16S: LINK  
:16R: LINK  
:20C: :CORP//27892009110503100  
:16S: LINK

## 1.9 MT578 Settlement Allegement

---

### Teilsequenz E1 Settlement Parties

#### :70C::PACO// Party Narrative

Aktuell wird das Narrative aus dem Feld :70E::SPRO der Instruktion MT540-541 des Kontrahenten nicht im MT578 angezeigt. Für Lieferungen des Kontrahenten wird das Narrative bereits heute angezeigt.

In Zukunft wird das Narrative des Feldes :70E::SPRO aller Instruktionen im Feld 70C::PACO angezeigt.

:97A: :SAFE//55550000  
:70C: :PACO//TEXT BEISPIEL  
:16S: SETPRTY

## 1.10 MT569 Triparty Collateral and Exposure Statement

---

**Keine Änderungen**

## 1.11 MT942 Interim Transaction Report / EUR Cash Clearing Report

---

**Keine Änderungen**

## 2. Custody Services

In diesem Kapitel sind die Änderungen und Erweiterungen der CBF Custody Services, die ab dem 17. November 2012 eingeführt werden, erläutert.

### 2.1 Änderungen aus dem SWIFT SR 2012

---

#### 2.1.1 MT564 Corporate Action Notification

##### **Teilsequenz E Corporate Action Options und E2 Cash Movement**

##### **:90a:: OFFR// Generic Cash Price Received per Product**

Der Qualifier OFFR im Feld :90a wird nicht mehr in Sequenz E verwendet. Für Income Events erfolgt die Anzeige eines Rückzahlungspreises künftig als :90a::OFFR// in Teilsequenz E2

##### **Teilsequenz E2 Cash Movement**

##### **:90a:: EXER// Exercise Price**

Der Qualifier EXER im Feld :90a wird nicht mehr verwendet. Für Non Income Events erfolgt die Anzeige des Ausübungspreises in Teilsequenz E2 künftig mittels des Qualifier PRPP.

Bei Wandelanleihen wurde bislang im Falle der Terminarten TA280 und TA281 in Teilsequenz E2 der Wandelpreis unter :90a::EXER und eine darin enthaltene Zu-/Auszahlung unter :90a::PRPP bzw. :90a::OFFR angezeigt. Künftig erfolgt kein separater Ausweis einer Zu-/Auszahlung mehr und es wird nur noch der Wandelpreis unter :90a::PRPP angezeigt.

#### 2.1.2 MT566 Corporate Action Confirmation

##### **Teilsequenz D Corporate Action Confirmation und D2 Cash Movement**

##### **:90a:: OFFR// Generic Cash Price Received per Product**

Der Qualifier OFFR im Feld :90a wird nicht mehr in Sequenz D verwendet. Für Income Events erfolgt die Anzeige eines Rückzahlungspreises künftig als :90a::OFFR// in Teilsequenz D2.

## 2.2 Anpassungen an die Market Practice

### 2.2.1 Einführung des Corporate Action Event Indicator "SHPR"

Bislang werden steuerfreie Leistungen aus dem steuerlichen Einlagenkonto (§27 neu KStG) im MT564 und MT566 mit dem Corporate Action Event Indicator :22F::CAEV//DVCA (Cash Dividend) gemeldet. Zur eindeutigen Identifikation solcher Vorgänge wird künftig für diese Dividendenart (WSS-ED006 = 64) im MT564 und MT566 ein eigener Indikator :22F::CAEV//SHPR (Shares Premium Dividend) verwendet. Die heutigen Nachrichtenformate für diese Dividendenart bleiben ansonsten unverändert.

### 2.2.2 Referenzierung im MT564 und MT566 auf OTC-Transaktionen der Kunden

Im MT564 und MT566 auf Basis von Market und Reverse Claims durch Income und Non Income Events wird die Anzeige der Referenz zur OTC-Instruktion des Kunden vereinheitlicht und erweitert.

#### Non Income Events

- Im MT566 Non Income auf Basis eines gebuchten FoP Market oder Reverse Claims wird künftig die Auftragsreferenz des Kunden aus seinem zugrundeliegenden Wertpapierübertrag bzw. Match-Instruktion im Feld :20C::RELA zusammen mit dem Feld :13A::LINK in der Teilsequenz A1 Linkages angezeigt. Heute wird diese Referenz bei Non Income Events nur im MT564 REPE angezeigt.
- Im MT564 REPE und MT566 wird heute nur die Auftragsnummer des Wertpapierübertrags im Freitextfeld :70E::ADTX hinter dem Schlüsselwort TR RELA angezeigt unabhängig davon, ob der Empfänger der Nachricht auf der Gut- oder Lastschriftseite der zugrundeliegenden OTC-Transaktion steht. Künftig wird dem Kunden, der auf der Last-Seite steht, die Auftragsnummer aus seinem Wertpapierübertrag und dem Kunden, der auf der Gut-Seite steht die Auftragsnummer aus seiner Match-Instruktion angezeigt.

Erfolgt das Claiming durch Modifikation der offenen OTC-Transaktion (Änderung der ISIN und/oder des Nominals), so erfolgt heute in dem MT566, der auf Basis der modifizierten und gebuchten OTC-Transaktion erstellt wird, die Anzeige der Auftragsnummer im Freitextfeld :70E::ADTX hinter dem Schlüsselwort TRADE REF. Zur Vereinheitlichung wird auch in diesem Fall künftig die Auftragsnummer aus dem Wertpapierübertrag bzw. der Match-Instruktion hinter dem Schlüsselwort TR RELA angezeigt.

- Im MT564 REPE und MT566 auf Basis von FoP Claims in NCSC-Titel, die über die CBL-Creation-Plattform abgewickelt werden, erfolgen die gleichen Erweiterungen und Vereinheitlichungen wie oben beschrieben. Zusätzlich wird im MT566 im Freitextfeld :70E::ADTX nach dem Schlüsselwort COL TRN die :20C::SEME der auf der CBL-Creation-Plattform generierten Settlementbestätigung (MT544 oder MT546) zum FoP Claim angezeigt.

Die nachfolgenden Tabellen geben einen vollständigen Überblick zur neuen Referenzierung im MT564 REPE und MT566 Non Income auf OTC-Transaktionen der Kunden.

Ref.	MT564 REPE (ACLA, ATXF) für offene Instruktionen	MT564 REPE (CLAI) for Reverse Claims und geblockte Market Claims	MT566 für Buchung des FoP Claims (Market & Reverse) in CASCADE	MT566 für Buchung der modifizierten Instr. in CASCADE
<b>RELA</b>	20C::RELA: AUFTRAGSREFERENZ aus WPÜ oder MI	20C::RELA: AUFTRAGS-REFERENZ aus WPÜ oder MI	20C::RELA: AUFTRAGS-REFERENZ aus WPÜ oder MI	20C::RELA: AUFTRAGS-REFERENZ aus WPÜ oder MI
<b>TRADE REF</b>	Nicht relevant	70E::ADTX – <b>TRADE REF:</b> AUFTR-NR (CASCADE) oder 20C::SEME (Creation) aus FoP Claim	70E::ADTX – <b>TRADE REF:</b> AUFTR-NR (CASCADE) aus FoP Claim	Nicht relevant
<b>TR RELA</b>	70E::ADTX - <b>TR RELA:</b> AUFTNR aus WPÜ oder MI	70E::ADTX - <b>TR RELA:</b> AUFTNR aus WPÜ oder MI	70E::ADTX - <b>TR RELA:</b> AUFTNR aus WPÜ oder MI	70E::ADTX - <b>TR RELA:</b> AUFTNR aus WPÜ oder MI
<b>TD</b>	70E::ADTX - <b>TRADE DAY:</b> Trade Day aus zugrundeliegender Instruktion	70E::ADTX - <b>TRADE DAY:</b> Trade Day aus zugrundeliegender Instruktion	70E::ADTX - <b>TRADE DAY:</b> Trade Day aus zugrundeliegender Instruktion	70E::ADTX - <b>TRADE DAY:</b> Trade Day aus zugrundeliegender Instruktion
<b>CPTY</b>	70E::ADTX – <b>COUNTERPART</b> – Counterpart aus WPÜ oder MI	70E::ADTX – <b>COUNTERPART</b> – Counterpart aus WPÜ oder MI	70E::ADTX – <b>COUNTERPART</b> – Counterpart aus WPÜ oder MI	70E::ADTX – <b>COUNTERPART</b> – Counterpart aus WPÜ oder MI

Ref.	MT566 für Buchung FoP Claim in Creation
RELA	20C::RELA: AUFTRAGS-REFERENZ aus WPÜ oder MI
TRADE REF	70E::ADTX – <b>TRADE REF:</b> 20C::SEME aus FoP Claim – (MT540 oder 542)
COL TRN	70E::ADTX – <b>COL TRN:</b> 20C::SEME aus CBL-Settlementbestätigung – (MT544 oder 546)
TR RELA	70E::ADTX - <b>TR RELA:</b> AUFTNR aus WPÜ oder MI
TD	70E::ADTX - <b>TRADE DAY:</b> Trade Day aus zugrundeliegender Instruktion
CPTY	70E::ADTX – <b>COUNTERPART</b> – Counterpart aus WPÜ oder MI

**Hinweis:** Die obige dargestellte Belegung des Freitextfeldes :70E::ADTX im MT566 auf Basis eines auf der CBL-Creation-Plattform gebuchten FoP Claims gilt auch im Falle einer zugrundeliegenden LION SE-Transaktion in CASCADE.

### Income Events

- Im MT564 REPE und MT566 wird heute nur die Auftragsnummer des Wertpapierübertrags im Freitextfeld :70E::ADTX hinter dem Schlüsselwort TR RELA angezeigt unabhängig davon, ob der Empfänger der Nachricht auf der Gut- oder Lastschriftseite der zugrundeliegenden OTC-Transaktion steht. Künftig wird dem Kunden, der auf der Last-Seite steht, die Auftragsnummer aus seinem Wertpapierübertrag und dem Kunden, der auf der Gut-Seite steht die Auftragsnummer aus seiner Match-Instruktion angezeigt.

Die nachfolgende Tabelle gibt einen vollständigen Überblick zur neuen Referenzierung im MT564 REPE und MT566 Income auf OTC-Transaktionen der Kunden.

Ref.	MT564 REPE (ACLA, CLAI) für offene Instruktionen und für generierte Reverse Claims	MT566 für Cash-Buchungen von Market oder Reverse Claims
RELA	20C::RELA: AUFTRAGSREFERENZ aus WPÜ oder MI	20C::RELA: AUFTRAGSREFERENZ aus WPÜ oder MI
TR RELA	70E::ADTX - TR RELA: AUFTNR aus WPÜ oder MI	70E::ADTX - TR RELA: AUFTNR aus WPÜ oder MI
OWN REF	70E::ADTX – OWN REF: REFERENZ-NR aus WPÜ oder MI	70E::ADTX – OWN REF: REFERENZ-NR aus WPÜ oder MI
TD	70E::ADTX - TRADE DAY: trade day aus zugrundeliegender Instruktion	70E::ADTX - TRADE DAY: trade day aus zugrundeliegender Instruktion
CPTY	70E::ADTX – COUNTERPART – Counterpart aus WPÜ or MI	70E::ADTX – COUNTERPART – Counterpart aus WPÜ oder MI
ACTUAL SD	Nicht relevant	70E::ADTX – ACTUAL SETTLEMENT DATE – Actual Settlement Date der zugrundeliegenden Instruktion

### 2.2.3 Referenzierung im MT564 und MT566 auf börsengehandelte Transaktionen der Kunden

Im Falle von Market und Reverse Claims aufgrund von Income und Non Income Events wird die Geschäftsnummer eines zugrundeliegenden börsengehandelten Geschäfts heute im Freitextfeld :70E::ADTX des MT564 REPE und MT566 nach dem Schlüsselwort TR RELA angezeigt. Diese Geschäftsnummer wird künftig zusätzlich auch in das Feld :20C::RELA in der Teilsequenz A1 Linkages aufgenommen (ohne zusätzlicher Anzeige des Feldes :13A::LINK). Folgende Geschäftsarten sind hiervon betroffen:

#### Income:

- SE-LION Transaktionen
- CCP Bruttogeschäfte
- Eurex Ausübungen
- Xemac-Transaktionen.

Non Income:

- SE-LION Transaktionen

## 2.2.4 MT564 Non Income basierend auf Transaktionen – Payment Date und Posting Date

### Teilsequenz E1 Securities Movement

#### :98a:: PAYD// Payment Date

Diese Änderung betrifft den MT564 REPE auf Basis von geblockt eingestellten FoP Claims auf der CBL-Creation-Plattform. Der Zahlbarkeitstag für den geblockten FoP Claim wird künftig als unbekannt ausgewiesen und deshalb mit :98B::PAYD//UKWN ausgewiesen.

### Teilsequenz C Intermediate Securities

#### :98a:: POST// Posting Date

Diese Änderung betrifft die Terminarten TA210 und TA211 und hier den MT564 REPE auf Basis offener Transaktionen (:22F::ADDB//ACLA) und FoP Claims (:22F::ADDB//CLAI).

Bei Abwicklung des Events durch Ausschüttung von Bezugsrechten wird in der Sequenz C als Posting Date (:98A::POST) künftig generell der Ex Tag des Events angezeigt.

## 2.2.5 Belegung der CA Option Number im MT566, Sequenz D Corporate Action Confirmation

Im MT566 wird heute im Feld 13A::CAON// als CA Action Option Number die 3-stellige KADI-Terminart angezeigt (z.B. "120" für Dividendenzahlung). Künftig wird für Income und Non Income Mandatory Events die korrekte CA Option Number übermittelt.

## 2.2.6 Anzeige von Umtauschvorbehalte im MT564 Non Income

Im MT564 werden heute Vorbehalte zu Übernahme- oder Umtauschangebote wie z.B. "Angebot bis Max.", "Angebot ab Mind." oder "Mindestbetrag bei Ausübung" durch Anzeige des Maximal- bzw. Mindestbetrags bzw. der Stückzahl im Feld :36B::FOLQ// in der Sequenz E oder :36B::MIEX// in der Sequenz B1 angezeigt. Für eine feinere Unterscheidung der Art des Vorbehaltes wird künftig nachfolgendes Mapping des WSS-Feldes UD030 (VORBEHALT) auf SWIFT vorgenommen:

WSS-VORBEHALT (UD030)	WSS- BETRAG (UD031A)	EVENT TYPE	SWIFT MT564 , 36B::Quantity
ANGEBOT AB MIND AEND. MINDESTBETRAG	belegt	TA280 Angebot	Sequence D: :36B::QTSO//quantity type code / WSS- BETRAG QTSO = Minimum Quantity Sought
ANGEBOT BIS MAX AEND. MAX. BETR.	belegt	TA280 Angebot	Sequence D: :36B::MQSO//quantity type code / WSS- BETRAG MQSO = Maximum Quantity of Securities
MIN.BETR.B.AUSUEBUNG AEND. MINDESTBETRAG	belegt	TA280 Ausübung Optionsschein TA281 Ausübung Optionsschein	Sequence B1 : :36B::MIEX//quantity type code / WSS- BETRAG MIEX = Minimum Exercisable Quantity

## 2.2.7 TA121 / TA127 – Änderungen und Ergänzungen in der Anzeige von Steuer-Informationen

**MT564, Sequenz E2 Cashmove**

**MT566, Sequenz D2 Cashmove**

**:92J:: GRSS/SMPG/REES/Immobilienanteil**

Im Falle von TA121 und TA127 wird ein vorhandener Immobilienanteil im MT564 und MT566 nicht mehr im Freitextfeld 70E::ADTX sondern in dem strukturierten Feld 92J::GRSS/SMPG/REES ausgewiesen, wie nachfolgend dargestellt.

```

:92F: :GRSS//EUR4,3
:92J: :GRSS//INCO/EURO,044500000/ACTU
:92J: :GRSS//INTR/EURO,1614000/ACTU
:92J: :GRSS/SMPG/REES/EURO,044500000/ACTU
:16S: CASHMOVE
:16S: CAOPTN
:16R: ADDINFO
:70E: :TAXE//ESTATE/EURO,044500000
:95Q: :PAYA//DWPBANK W/COMMERZBANK AG
      WILDUNGER STRASSE 14
      POSTFACH 90 01 39
      D-60487 FRANKFURT AM MAIN
:16S: ADDINFO

```

**MT564, Sequenz D Corporate Action Details**  
**MT566, Sequenz C Corporate Action Details**

**:22F::ADDB//Indicator**

Im Falle der TA127 wird im MT564 und MT566 zusätzlich der Indikator :22F::ADDB//TAXR aufgenommen. Damit soll verdeutlicht werden, dass diese SWIFT-Nachrichten im Zusammenhang mit einem Steuerprozess (Steuergrundschrift bei thesaurierenden Fonds) stehen.

## **2.2.8 Sonstige Anpassungen in den SWIFT-Formaten**

**MT564, Sequenz E Corporate Action Options**

**:22F:: CAOP// CA Option Code Indicator**

Im Falle der Terminart TA281 (Andienungsrechte) wird im MT564 der heute verwendete CA Option Code Indicator :22F::CAOP//CASE durch :22F::CAOP//PRUN ersetzt, falls die Option in Cash und/oder Titel resultieren kann. In WSS (Felder UD061, UD062) entspricht dies der Erfüllungsart "Komplexe Erfüllung" oder "Lieferung abweichende Titel".

**MT566, Sequenz C Corporate Action Details**

**:22F:: ADDB// Additional Business Process Indicator**

Im Falle einer offenen LION-SE-Transaktion und einem Non Income Event der Terminart 232 mit Wechsel der ISIN von CSC-Titel nach NCSC-Titel erfolgt das Settlement der modifizierten Transaktion auf der CBL-Creation-Plattform. Die Kunden können heute auf Basis der modifizierten und gebuchten Transaktion einen MT566 beziehen, der in der Sequenz C den Additional Business Process Indicator :22F::ADDB//CLAI enthält. Künftig wird der Indikator CLAI auf ATXF geändert.

**MT566, Sequenz D1 Securities Movement**

**:92a:: RATE// Rückzahlungsrate**

Für die Terminarten TA220, TA222, TA223 und TA260 wird im MT566 künftig in Sequenz D1 die Rückzahlungsrate im Feld :92a::RATE// angezeigt.

## 2.3 Einführung des MT564 und MT566 für die Hauptzahlstelle

---

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

**Hinweis:** Mit Einführung des MT564 und MT566 für die Hauptzahlstelle wird der heutige SWIFT MT559 abgelöst. Der MT559 wird ab 17. November 2012 nicht mehr versendet. Kunden, die ab 19. November 2012 den neuen MT564 / 566 für die Hauptzahlstelle beziehen möchten, müssen diesen Service explizit bestellen. Hierzu wird ein aktualisiertes Bestellformular Nr. 83 „KADI Corporate Action Messages“ auf der Homepage [www.clearstream.com](http://www.clearstream.com) bereit gestellt.

### 2.3.1 Hauptmerkmale und Workflow

Nachfolgend werden die Hauptmerkmale und der Workflow zum neuen SWIFT-Service für Hauptzahlstellen aufgeführt. Weitere Informationen werden noch in einem aktualisierten CBF Connectivity Handbook, Part 3 (Custody) veröffentlicht.

- Der Workflow des MT564 für die Hauptzahlstelle ist unabhängig von dem der heutigen MT564 Pre-Notifikation auf Basis der Kundenbestände. Kunden, die auf ihrem CASCADE-Konto über Eigenbestand im Underlying eines Income Events verfügen und gleichzeitig als Hauptzahlstelle agieren, können somit unabhängig voneinander die heutige MT564 Pre-Notifikation auf Basis ihres Eigenbestands und den MT564 als Hauptzahlstelle mit den Inkassoinformationen empfangen.
- Der MT56x für die Hauptzahlstelle kann anhand verschiedener Kriterien von den heutigen bestandsbezogenen MT56x-Nachrichten unterschieden werden:
  1. Der MT56x für die Hauptzahlstelle kann für eine andere SWIFT-Adresse bestellt werden.
  2. Bei der Übermittlung der MT56x-Nachrichten via File Transfer wird im MT598-Header ein eigener Message Function Code im Feld 77E verwendet:

Feld 77E	KADI SWIFT Nachrichtentyp
<b>0402</b>	<b>MT564 an Hauptzahlstelle und Lead Manager (TA231)</b>
0411	MT564 an Kunden
0413	MT568 an Kunde / Hauptzahlstelle / Lead Manager
0414	MT568 für die Tax Pre-Notification an Kunden
0415	MT568 Offene Transaktionen an Kunden
0431	MT566 an Kunden
<b>0432</b>	<b>MT566 an Hauptzahlstelle und Lead Manager (TA231)</b>

Detaillierte Informationen zum File Transfer sind im CBF Connectivity Handbook, Part 1 zu finden.

Der 3-stellige Message Function Code (ohne führende Null) kann künftig auch über die CASCADE-Onlinefunktion MAMJ als weiteres Selektionskriterium herangezogen werden. Durch Eingabe des Message Function Codes in dem neuen Feld "FORMAT/MSG-FUNKTION" kann die Nachrichtensuche auf obige KADI-Nachrichtentypen eingeschränkt werden.

3. Der MT56x weist zum CASCADE-Konto der Hauptzahlstelle den Tresorbestand mit negativem Vorzeichen ("N") aus.
  4. Der MT56x enthält in der Cashmove-Sequenz als Credit/Debit-Indikator immer "Debit", während die heutige bestandsbezogene MT56x-Nachricht immer den Indikator "Credit" beinhaltet.
  5. Zusätzlich wird im MT56x für die Hauptzahlstelle im Freitextfeld "ADVICE FOR PAYING AGENT" bzw. "CONFIRMATION FOR PAYING AGENT" angezeigt.
- Der MT564 für die Hauptzahlstelle wird für alle KADI Income-Terminarten (TA1xx) mit Zahlungen in Euro und Fremdwährung versendet. Dabei bestehen für die Hauptzahlstelle bei der Bestellung dieses neuen Service weitestgehend die gleichen Möglichkeiten des Customizing wie bei der heutigen bestandsbezogenen Pre-Notifikation
  - Für den Versand eines MT564 an die Hauptzahlstelle muss die Hauptzahlstelle für diesen Service registriert und der Income Event durch die KADI-Terminselektion als für die Abrechnung gültig selektiert sein. Ein Tresorbestand muss nicht zwingend vorhanden sein, wird aber unter :93B::SETT (gebuchter Tresorbestand) und :93B::ELIG (gebuchter Tresorbestand minus aller Absetzungen) mit Vorzeichen "N" zum CASCADE-Konto der Hauptzahlstelle angezeigt.

- Der Erstversand des MT564 für die Hauptzahlstelle beginnt 30 Bankarbeitstage vor Ex-Tag. Weitere MT564-Nachrichten können bis 1 Bankarbeitstag vor Stichtag folgen, z.B. bei Änderung der Eventdaten oder Storno des Events.
- Für den Zeitraum 30 Bankarbeitstage vor Ex-Tag bis 1 Bankarbeitstag vor Stichtag kann ein optionaler MT564 REPE bestellt werden. Der Versand dieses MT564 REPE erfolgt bei Änderung des Tresorbestandes, z.B. durch mark-up, mark-downs oder Änderungen am abgesetzten Bestand.
- Der heutige optionale MT564 REPE nach KADI-Abrechnung am Stichtag abends steht auch der Zahlstelle zur Verfügung und enthält den Inkassobetrag auf Basis des tatsächlichen, berechtigten Nostrobestandes.
- Mit der parallelen Einführung des KDOA-MT564 zum November-Release verlängert sich auch der Lebenszyklus des MT564 für die Hauptzahlstelle (siehe hierzu auch Kapitel 2.5).

Für untertägige Änderungen der Event- bzw. Abrechnungsdaten oder auch der Erstveröffentlichung eines Income Events am Stichtag versendet CBF real time MT564-Nachrichten (NEWM, REPL oder CANC). Diese real time MT564-Nachrichten weisen den aktuellen Tresorbestand ohne Berücksichtigung von Absetzungen im Feld :93B::SETT auf. Bitte beachten Sie, dass im Falle einer parallel laufenden Settlementverarbeitung der unter :93B::SETT ausgewiesene Bestand nicht notwendigerweise dem tatsächlichen oder berechtigten Bestand entsprechen kann. Eine Anzeige von :93B::ELIG erfolgt nicht.

Nach der Stichtagsverarbeitung können weitere real time MT564 Nachrichten an die Hauptzahlstelle folgen, z. B. bei Stornierung der Abrechnung und Neuabrechnung. Auch hier wird als Bestand nur :93B::SETT ausgewiesen und enthält den zur Stichtagsverarbeitung herangezogenen, berechtigten Tresorbestand ohne Berücksichtigung von Absetzungen.

Zur Erkennung, ob ein MT564 CANC eine Stornobuchung avisiert (der Income Event wurde zuvor schon abgerechnet) oder vor der Abrechnung zurückgezogen bzw. storniert wird, wird im MT564 CANC der "Additional Business Indicator" in Sequenz D verwendet. Im Falle der Avisierung einer Stornobuchung enthält hierzu der MT564 CANC das Feld :22F::ADDDB//REVR.

- Die MT566 Nachricht bestätigt der Zahlstelle die Belastung des Inkassobetrages und wird als Bestätigung aus dem Cash Settlement versendet.

Nachfolgend werden die Formate des MT564 und MT566 für die Hauptzahlstelle beschrieben. Abweichungen in den Feldbelegungen gegenüber der heutigen bestandsbezogenen MT564 Pre-Notifikation und MT566 Bestätigung sind in der Kommentarspalte aufgeführt.

## 2.3.2 MT564 für die Hauptzahlstelle

Tag	Status	Feldname	Format	Kommentar
Mandatory Sequence A General Information				
16R	M	Start of Block	GENL	
20C	M	CA Reference	:CORP//16x	
20C	M	Sender's Reference	:SEME//16x	
23G	M	Function of the Message	4!c	<p>NEWM: Erstankündigung des Events oder Änderung der Hauptzahlstelle (NEWM für die neue Hauptzahlstelle).</p> <p>REPL: Änderung von Eventdaten</p> <p>REPE: Nachricht wegen Änderung des Nostrobestandes oder Nachricht auf Basis der KADI-Abrechnung am Stichtag Abend.</p> <p>CANC: Stornierung der Nachricht durch CBF oder WM. CANC auch für die alte Hauptzahlstelle bei Änderung der Hauptzahlstelle.</p>
22F	M	CA Event Indicator	:CAEV//4!c	
22F	M	Mandatory/Voluntary Indicator	:CAMV//MAND	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	
25D	M	Processing Status	:PROC//4!c	Ab Stichtag immer COMP.
Repetitive Optional Subsequence A1 Linkages				
16R	M	Start of Block	LINK	
13A	O	Linked Message	:LINK//3!c	
20C	M	Corporate Action Reference	:CORP//16x	
16S	M	End of Block	LINK	
End of Subsequence A1 Linkages				
Repetitive Optional Subsequence A1 Linkages				
16R	M	Start of Block	LINK	
20C	M	Previous Message Reference	:PREV//16x	
16S	M	End of Block	LINK	
End of Subsequence A1 Linkages				
16S	M	End of Block	GENL	
End of Sequence A General Information				
Mandatory Sequence B Underlying Securities				
16R	M	Start of Block	USECU	
35B	M	Identification of FI	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	

Tag	Status	Feldname	Format	Kommentar
Optional Subsequence B1 Financial Instrument Attributes				
16R	M	Start of Block	FIA	
22F	0	Method of Interest Computation Indicator	:MICO//4!c	
11A	0	Currency of Denomination	:DENO//3!a	
92A	0	Previous Factor	:PRFC//[N]15d	
16S	M	End of Block	FIA	
End of Subsequence B1 Financial Instrument Attributes				
Repetitive Mandatory Subsequence B2 Account Information				
16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	CASCADE-Konto der Hauptzahlstelle
93B	0	Total Eligible for CA	:ELIG//4!c/[N]15d	<p><u>Vor Stichtag:</u> Nostrobestand (:93B::SETT) minus der Absetzungen.</p> <p><u>Am Stichtag vor Abrechnung:</u> Keine Anzeige dieses Feldes.</p> <p><u>Am Stichtag bei Abrechnung</u> MT564 REPE auf Basis der Abrechnung: berechtigter Nostrobestand minus der Absetzungen.</p> <p><u>Nach Stichtag:</u> Keine Anzeige dieses Feldes.</p> <p><u>Syntax:</u> Generelle Verwendung des Vorzeichens "N".</p>

Tag	Status	Feldname	Format	Kommentar
93B	0	Settlement Position	:SETT//4!c/[N] 15d	<p><u>Vor Stichtag:</u> Nostrobestand ohne Abzug von Absetzungen.</p> <p><u>Am Stichtag vor Abrechnung:</u> Aktueller Nostrobestand ohne Berücksichtigung parallel laufender Settlementverarbeitungen (Snapshot) und ohne Abzug von Absetzungen.</p> <p><u>Am Stichtag bei Abrechnung</u> MT564 REPE auf Basis der Abrechnung: berechtigter Nostrobestand ohne Abzug von Absetzungen.</p> <p><u>Nach Stichtag:</u> Berechtigter Nostrobestand am Stichtag Abend ohne Abzug von Absetzungen.</p> <p><u>Syntax:</u> Generelle Verwendung des Vorzeichens "N".</p>
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information

16S	M	End of Block	USECU	
-----	---	--------------	-------	--

End of Sequence B Underlying Securities

Optional Sequence D Corporate Action Details

16R	M	Start of Block	CADETL	
98A	0	Ex-Dividend or Distribution Date	:XDTE//8!n	
98A	0	Record Date	:RDTE//8!n	
98A	0	Effective Date	:EFFD//8!n	
69A	0	Interest Period	:INPE//8!n/8!n	
99A	0	Number of Days Accrued	:DAAC//[N]3!n	
92A or 92F	0	Interest Rate	:INTR//[N]15d :INTR//3!a15d	
36B	0	Minimum Quantity Sought	:QTSO//4!c/15d	
22F	0	Additional Business Process Indicator	:ADDB//REVR	Anzeige des Indikators nur im Zusammenhang mit 23G::CANC zur Avisierung einer Stornobuchung (zu erwartende Gutschrift auf Konto der Hauptzahlstelle).
16S	M	End of Block	CADETL	

End of Sequence D Corporate Action Details

Tag	Status	Feldname	Format	Kommentar
Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options				
16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	M	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//CASH	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//Y	
Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements				
16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	Für die Hauptzahlstelle wird immer DEBT angezeigt. Auch der MT564 CANC weißt DEBT aus.
97A	0	Cash Account	:CASH//35x	<u>EUR-Zahlungen</u> 4-stellige CASCADE-Konto der Hauptzahlstelle <u>Zahlungen in Fremdwährung</u> 6-series Konto der Hauptzahlstelle auf der CBL-Creation-Plattform.
19B	M	Entitled Amount	:ENTL//3!a15d	Das Inkasso erfolgt i.d.R. immer auf Bruttobasis. Deshalb ist Net Amount und Gross Amount i.d.R. identisch. Abweichungen ergeben sich nur, falls Provisionen berechnet werden. <u>Vor Stichtag</u> 19B::ENTL = 19B::GRSS - 19B::CHAR <u>Am Stichtag vor Abrechnung</u> 19B::ENTL = 19B::GRSS. Provisionen werden hier nicht berücksichtigt. <u>Am Stichtag bei Abrechnung</u> MT564 REPE auf Basis der Abrechnung: 19B::ENTL = 19B::GRSS - 19B::CHAR <u>Nach Stichtag</u> 19B::ENTL = 19B::GRSS. Provisionen werden hier nicht berücksichtigt. Die Berechnung von 19B::ENTL erfolgt auf Basis von 93B::ELIG, falls vorhanden, sonst auf Basis von 93B::SETT.
19B	0	Gross Amount	:GRSS//3!a15d	Brutto-Inkassobetrag auf Basis von 93B::ELIG, falls vorhanden, sonst auf Basis von 93B::SETT.
19B	0/M	Resulting Amount	:RESU//3!a15d	
19B	0	Charges / Fees	:CHAR//3!a15d	Provisionsbetrag, falls Provision berechnet wird. Siehe auch Kommentar zu 19B::ENTL.
98A	M	Payment Date	:PAYD//8!n	<u>Vor Stichtag</u> 98A::PAYD//Zahlbarkeitstag des Events

Tag	Status	Feldname	Format	Kommentar
				<u>Am Stichtag</u> 98A::PAYD//Inkasso-Valuta <u>Nach Stichtag</u> 98A::PAYD//Inkasso-Valuta
98A	M	Value Date	:VALU//8!n	<u>Vor Stichtag</u> 98A::PAYD//Zahlbarkeitstag des Events <u>Am Stichtag</u> 98A::PAYD//Inkasso-Valuta <u>Nach Stichtag</u> 98B::PAYD//UKWN
92F	0	Gross Dividend Rate	:GRSS//3!a15d	
92A or 92F	0	Applicable Rate	:RATE//[N]15d :RATE//3!a15d	
92A	0	Charges / Fees	CHAR//[N]15d	Provisionsatz, falls Provision berechnet wird. Siehe auch Kommentar zu 19B::ENTL.
92A or 92F	0	Interest Rate Used for Payment	:INTP//[N]15d :INTP//3!a15d	
92B	0	Exchange Rate	:EXCH//3!a/3!a/15d	
90A or 90B	0	Generic Cash Price Received per Product	:OFFR//PRCT/15d :OFFR//ACTU/3!a15d	
16S	M	End of Block	CASHMOVE	

End of Subsequence E2 Cash Movements

16S	M	End of Block	CAOPTN	
-----	---	--------------	--------	--

End of Sequence E Corporate Action Options

Optional Sequence F Additional Information

16R	M	Start of Block	ADDINFO	
70E	0	Additional Text	:ADTX//10*35x	:ADTX//ADVICE FOR PAYING AGENT
70E	0	Taxation Conditions	:TAXE//10*35x	
70E	0	Narrative Version	:TXNR //10*35x	
95Q	0	Paying Agent	:PAYA//4*35x	
16S	M	End of Block	ADDINFO	

End of Sequence F Additional Information

### 2.3.3 MT566 für die Hauptzahlstelle

Tag	Status	Field Name	Format	Comment
-----	--------	------------	--------	---------

#### Mandatory Sequence A General Information

16R	M	Start of Block	GENL	
20C	M	CA Reference	:CORP//16x	
20C	M	Sender's Reference	:SEME//16x	
23G	M	Function of the Message	4!c	
22F	M	CA Event Indicator	:CAEV//4!c	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	

#### Repetitive Optional Subsequence A1 Linkages

16R	M	Start of Block	LINK	
20C	M	Corporate Action Reference	:CORP//16x	
16S	M	End of Block	LINK	

#### End of Subsequence A1 Linkages

#### Repetitive Optional Subsequence A1 Linkages

16R	M	Start of Block	LINK	
20C	M	Previous Reference	:PREV//16x	
16S	M	End of Block	LINK	

#### End of Subsequence A1 Linkages

16S	M	End of Block	GENL	
-----	---	--------------	------	--

#### End of Sequence A General Information

#### Mandatory Sequence B Underlying Securities

16R	M	Start of Block	USECU	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	CASCADE-Konto der Hauptzahlstelle
35B	M	Identification of FI	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	

#### Optional Subsequence B1 Financial Instrument Attributes

16R	M	Start of Block	FIA	
22F	O	Method of Interest Computation Indicator	:MICO//4!c	
11A	O	Currency of Denomination	:DENO//3!a	
92A	O	Previous Factor	:PRFC//[N]15d	
16S	M	End of Block	FIA	

#### End of Subsequence B1 Financial Instrument Attributes

Tag	Status	Field Name	Format	Comment
93B	0	Total Eligible for CA	:ELIG//4!c/[N]15d	Nostrobestand minus der Absetzungen, der zur Abrechnung herangezogen wurde. Syntax: Generelle Verwendung des Vorzeichens "N".
93B	0	Settlement Position	:SETT//4!c/[N]15d	Nostrobestand ohne Abzug von Absetzungen, der zur Abrechnung herangezogen wurde. Syntax: Generelle Verwendung des Vorzeichens "N".
93B	M	Confirmed Balance	:CONB//4!c/[N]15d	Identisch mit :93B::ELIG. Syntax: Generelle Verwendung des Vorzeichens "N".
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information

16S	M	End of Block	USECU	
-----	---	--------------	-------	--

End of Sequence B Underlying Securities

Optional Sequence C Corporate Action Details

16R	M	Start of Block	CADETL	
98A	0	Ex-Dividend or Distribution Date	:XDTE//8!n	
98A	0	Record Date	:RDTE//8!n	
98A	0	Effective Date	:EFFD//8!n	
99A	0	Number of Days Accrued	:DAAC//[N]3!n	
92A or 92F	0	Interest Rate	:INTR//[N]15d :INTR//3!a15d	
36B	0	Minimum Quantity Sought	:QTSO//4!c/15d	
16S	M	End of Block	CADETL	

End of Sequence C Corporate Action Details

Repetitive Optional Sequence D Corporate Action Confirmation

16R	M	Start of Block	CACONF	
13A	M	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//CASH	
11A	0	Currency Option	:OPTN//3!a	

Repetitive Optional Subsequence D2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	Für die Hauptzahlstelle wird immer DEBT angezeigt. Auch der MT566 REVR

Tag	Status	Field Name	Format	Comment
				weiß DEBT aus.
97A	0	Cash Account	:CASH//35x	<u>EUR-Zahlungen</u> CASCADE-Geldverrechnungskonto der Hauptzahlstelle <u>Zahlungen in Fremdwahrung</u> 6-series Konto der Hauptzahlstelle auf der CBL-Creation-Plattform.
19B	M	Posting Amount	:PSTA//3!a15d	Gebuchter Inkassobetrag.
19B	O/M	Resulting Amount	:RESU//3!a15d	
19B	0	Charges / Fees	:CHAR//3!a15d	Falls Provision berechnet wurde erfolgt hier der Ausweis des Provisionsbetrags.
19B	0	Gross Amount	:GRSS//3!a15d	Ausmachender Inkassobetrag ohne Berucksichtigung von Provision
98A	M	Posting Date	:POST//8!n	Buchungsdatum
98A	M	Value Date	:VALU//8!n	Valuta
98A	0	Payment Date	:PAYD//8!n	Zahlbarkeitstag des Event
92F	0	Gross Dividend Rate	:GRSS//3!a15d	
92A or 92F	0	Applicable Rate	:RATE//[N]15d :RATE//3!a15d	
92A	0	Charges / Fees	CHAR//[N]15d	Falls Provision berechnet wurde erfolgt hier der Ausweis des Provisionssatzes.
92A or 92F	0	Interest Rate Used for Payment	:INTP//[N]15d :INTP//3!a15d	
92B	0	Exchange Rate	:EXCH//3!a/3! /15d	
90A or 90B	0	Generic Cash Price Received per Product	:OFFR//PRCT/ 15d :OFFR//ACTU/ 3!a15d	
16S	M	End of Block	CASHMOVE	

End of Subsequence E2 Cash Movements

16S	M	End of Block	CAOPTN	
-----	---	--------------	--------	--

End of Sequence E Corporate Action Options

Tag	Status	Field Name	Format	Comment
Optional Sequence F Additional Information				
16R	M	Start of Block	ADDINFO	
70E	O	Additional Text	:ADTX//10*35x	:ADTX//CONFIRMATION FOR PAYING AGENT
70E	O	Taxation Conditions	:TAXE//10*35x	
16S	M	End of Block	ADDINFO	

End of Sequence F Additional Information

## 2.4 Einführung des MT564 und MT566 für den Lead Manager in TA231

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

### 2.4.1 Hauptmerkmale und Workflow

Nachfolgend werden die Hauptmerkmale und der Workflow zum neuen SWIFT-Service für Lead Manager in TA231 aufgeführt. Weitere Informationen werden noch in einem aktualisierten CBF Connectivity Handbook, Part 3 (Custody) veröffentlicht.

- Der Workflow des MT564 für den Lead Manager ist unabhängig von dem der heutigen MT564 Pre-Notifikation auf Basis der Kundenbestände. Kunden, die auf ihrem CASCADE-Konto über Eigenbestand in der zu tilgenden Gattung verfügen und gleichzeitig als Lead Manager agieren, können somit unabhängig voneinander die heutige MT564 Pre-Notifikation auf Basis ihres Eigenbestands und den MT564 als Lead Manager mit der Information über die bereitzustellenden Stücke empfangen.
- Der MT56x für den Lead Manager kann anhand verschiedener Kriterien von den heutigen bestandsbezogenen MT56x-Nachrichten unterschieden werden:
  1. Der MT56x für den Lead Manager kann zusammen mit dem MT56x für die Hauptzahlstelle für eine andere SWIFT-Adresse bestellt werden.
  2. Bei der Übermittlung der MT56x-Nachrichten via File Transfer wird im MT598-Header ein eigener Message Function Code im Feld 77E verwendet:

Feld 77E	KADI SWIFT Nachrichtentyp
<b>0402</b>	<b>MT564 an Hauptzahlstelle und Lead Manager (TA231)</b>
0411	MT564 an Kunden
0413	MT568 an Kunde / Hauptzahlstelle / Lead Manager
0414	MT568 für die Tax Pre-Notification an Kunden
0415	MT568 Offene Transaktionen an Kunden
0431	MT566 an Kunden
<b>0432</b>	<b>MT566 an Hauptzahlstelle und Lead Manager (TA231)</b>

Detaillierte Informationen zum File Transfer sind im CBF Connectivity Handbook, Part 1 zu finden.

Der 3-stellige Message Function Code (ohne führende Null) kann künftig auch über die CASCADE-Onlinefunktion MAMJ als weiteres Selektionskriterium herangezogen werden. Durch Eingabe des Message Function Codes in dem neuen Feld "FORMAT/MSG-FUNKTION" kann die Nachrichtensuche auf obige KADI-Nachrichtentypen eingeschränkt werden.

3. Der MT56x weist zum CASCADE-Konto des Lead Managers den Tresorbestand mit negativem Vorzeichen ("N") aus.
  4. Der MT56x enthält in der Seqmove-Sequenz als Credit/Debit-Indikator immer "Debit", während die heutige bestandsbezogene MT56x-Nachricht zu TA231 immer den Indikator "Credit" beinhaltet.
  5. Zusätzlich wird im MT56x für den Lead Manager im Freitextfeld "ADVICE FOR LEAD MANAGER" bzw. "CONFIRMATION FOR LEAD MANAGER" angezeigt.
- Der MT564 für den Lead Manager wird für die KADI Non Income-Terminart TA231 versendet mit Belastung der neuen Titel entweder auf der CASCADE- oder der Creation-Plattform. Dabei bestehen für den Lead Manager bei der Bestellung dieses neuen Service weitestgehend die gleichen Möglichkeiten des Customizing wie bei der heutigen bestandsbezogenen Pre-Notifikation
  - Für den Versand eines MT564 an den Lead Manager muss der Lead Manager für diesen Service registriert und der TA231-Event durch die KADI-Terminselektion als für die Abrechnung gültig selektiert sein. Ein Tresorbestand in dem zu tilgenden Titel muss nicht zwingend vorhanden sein, wird aber unter :93B::SETT (gebuchter Tresorbestand) und :93B::ELIG (gebuchter Tresorbestand minus aller Absetzungen) mit Vorzeichen "N" zum CASCADE-Konto des Lead Manager angezeigt.

- Der Erstversand des MT564 für den Lead Manager beginnt 30 Bankarbeitstage vor Ex-Tag. Weitere MT564-Nachrichten können bis 1 Bankarbeitstag vor Stichtag folgen, z.B. bei Änderung der Eventdaten oder Storno des Events.
- Für den Zeitraum 30 Bankarbeitstage vor Ex-Tag bis 1 Bankarbeitstag vor Stichtag kann ein optionaler MT564 REPE bestellt werden. Der Versand dieses MT564 REPE erfolgt bei Änderung des Tresorbestandes, z.B. durch mark-up, mark-downs in der zu tilgenden Gattung oder Änderungen am abgesetzten Bestand.
- Mit der parallelen Einführung des KDOA-MT564 zum November-Release verlängert sich auch der Lebenszyklus des MT564 für den Lead Manager (siehe hierzu auch Kapitel 2.5).

Für untertägige Änderungen der Event- bzw. Abrechnungsdaten oder auch der Erstveröffentlichung eines TA231-Events am Stichtag versendet CBF real time MT564-Nachrichten (NEWM, REPL oder CANC). Diese real time MT564-Nachrichten weisen den aktuellen Tresorbestand in der zu tilgenden Gattung ohne Berücksichtigung von Absetzungen im Feld :93B::SETT auf. Bitte beachten Sie, dass im Falle einer parallel laufenden Settlementverarbeitung der unter :93B::SETT ausgewiesene Bestand nicht notwendigerweise dem tatsächlichen oder berechtigten Bestand entsprechen kann. Eine Anzeige von :93B::ELIG erfolgt nicht.

Nach der Stichtagsverarbeitung können weitere real time MT564 Nachrichten an den Lead Manager folgen, z. B. bei Stornierung der Abrechnung und Neuabrechnung. Auch hier wird als Bestand nur :93B::SETT ausgewiesen und enthält den zur Stichtagsverarbeitung herangezogenen, berechtigten Tresorbestand in der zu tilgenden Gattung ohne Berücksichtigung von Absetzungen.

Zur Erkennung, ob ein MT564 CANC eine Stornobuchung avisiert (der TA231-Event wurde zuvor schon abgerechnet) oder vor der Abrechnung zurückgezogen bzw. storniert wird, wird im MT564 CANC der "Additional Business Indicator" in Sequenz D verwendet. Im Falle der Avisierung einer Stornobuchung enthält hierzu der MT564 CANC das Feld :22F::ADDB//REVR.

- Die MT566 Nachricht bestätigt dem Lead Manager die Belastung der neuen Titel entweder auf der CASCADE- oder der Creation-Plattform und wird nach erfolgreichem Settlement der Belastung versendet.

Nachfolgend werden die Formate des MT564 und MT566 für den Lead Manager in TA231 beschrieben. Abweichungen in den Feldbelegungen gegenüber der heutigen bestandsbezogenen MT564 Pre-Notifikation und MT566 Bestätigung sind in der Kommentarspalte aufgeführt.

## 2.4.2 MT564 für den Lead Manager

Tag	Status	Field Name	Format	Comment
-----	--------	------------	--------	---------

### Mandatory Sequence A General Information

16R	M	Start of Block	GENL	
20C	M	CA Reference	:CORP//16x	
20C	M	Sender's Reference	:SEME//16x	
23G	M	Function of the Message	4!c	NEWM: Erstankündigung des Events oder Änderung des Lead Manager (NEWM für den neuen Lead Manager). REPL: Änderung von Eventdaten REPE: Nachricht wegen Änderung des Nostrobestandes CANC: Stornierung der Nachricht durch CBF oder WM. CANC auch für den alten Lead Manager bei Änderung des Lead Manager.
22F	O	CA Event Processing	:CAEP//4!c	
22F	M	CA Event Indicator	:CAEV//4!c	
22F	M	Mandatory/Voluntary Indicator	:CAMV//MAND	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	
25D	M	Processing Status	:PROC//4!c	Ab Stichtag immer COMP.

### Repetitive Optional Subsequence A1 Linkages

16R	M	Start of Block	LINK	
13A	O	Linked Message	:LINK//3!c	
20C	M	Corporate Action Reference	:CORP//16x	
16S	M	End of Block	LINK	

### End of Subsequence A1 Linkages

### Repetitive Optional Subsequence A1 Linkages

16R	M	Start of Block	LINK	
20C	M	Previous Message Reference	:PREV//16x	
16S	M	End of Block	LINK	

### End of Subsequence A1 Linkages

16S	M	End of Block	GENL	
-----	---	--------------	------	--

### End of Sequence A General Information

### Mandatory Sequence B Underlying Securities

16R	M	Start of Block	USECU	
35B	M	Identification of FI	[ISIN!e12!c]	ISIN der alten, zu tilgenden Gattung

Tag	Status	Field Name	Format	Comment
			[4*35x]	

Repetitive Mandatory Subsequence B2 Account Information

16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	CASCADE-Konto des Lead Manager
93B	O	Total Eligible for CA	:ELIG//4!c/[N]15d	<p><u>Vor Stichtag:</u> Nostrobestand (:93B::SETT) minus der Absetzungen.</p> <p><u>Am Stichtag:</u> Keine Anzeige dieses Feldes.</p> <p><u>Nach Stichtag:</u> Keine Anzeige dieses Feldes.</p> <p><u>Syntax:</u> Generelle Verwendung des Vorzeichens "N".</p>
93B	O	Settlement Position	:SETT//4!c/[N]15d	<p><u>Vor Stichtag:</u> Nostrobestand ohne Abzug von Absetzungen.</p> <p><u>Am Stichtag:</u> Aktueller Nostrobestand ohne Berücksichtigung parallel laufender Settlementverarbeitungen (Snapshot) und ohne Abzug von Absetzungen.</p> <p><u>Nach Stichtag:</u> Berechtigter Nostrobestand am Stichtag Abend ohne Abzug von Absetzungen.</p> <p><u>Syntax:</u> Generelle Verwendung des Vorzeichens "N".</p>
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information

16S	M	End of Block	USECU	
-----	---	--------------	-------	--

End of Sequence B Underlying Securities

Optional Sequence D Corporate Action Details

16R	M	Start of Block	CADETL	
98A	O	Ex-Dividend or Distribution Date	:XDTE//8!n	
98A	O	Record Date	:RDTE//8!n	
22F	O	Additional Business Process Indicator	:ADDB//REVR	Anzeige des Indikators nur im Zusammenhang mit 23G::CANC zur Avisierung einer Stornobuchung (zu erwartende Gutschrift auf Konto des Lead Manager).

Tag	Status	Field Name	Format	Comment
16S	M	End of Block	CADETL	

End of Sequence D Corporate Action Details

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (SECU)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//001	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//SECU	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//Y	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	Für den Lead Manager wird immer ein DEBIT angezeigt. Auch der MT564 CANC weißt DEBT aus
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	ISIN der neuen Gattung, in die getilgt wird. Diese kann ein CSC- oder NCSC-Titel sein.
36B	O	Entitled Quantity of Financial Instrument	:ENTL//4!c/15d	Anzahl der neuen Stücke, die dem Lead Manager auf Basis des Nostro-bestandes zu belasten sind. <u>Vor Stichtag</u> 19B::ENTL = 93B::ELIG * 92D::NEWO <u>Am Stichtag</u> 19B::ENTL = 93B::SETT * 92D::NEWO <u>Nach Stichtag</u> 19B::ENTL = 93B::SETT * 92D::NEWO
92D	O	New to Old	:NEWO//15d/15d	Tilgungsverhältnis
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	<u>Vor Stichtag</u> 98A::PAYD//Trenntermin + 1 Bank-arbeitstag <u>Am Stichtag</u> 98A::PAYD//Trenntermin + 1 Bankarbeitstag <u>Nach Stichtag</u> 98B::PAYD//UKWN
16S	M	End of Block	SECMOVE	
16S	M	End of Block	CAOPTN	

End of Sequence E Corporate Action Options

Optional Sequence F Additional Information

16R	M	Start of Block	ADDINFO	
70E	O	Additional Text	:ADTX// 10*35x	:ADTX//ADVICE FOR LEAD MANAGER
16S	M	End of Block	ADDINFO	

End of Sequence F Additional Information

## 2.4.3 MT566 für den Lead Manager

Tag	Status	Field Name	Format	
Mandatory Sequence A General Information				
16R	M	Start of Block	GENL	
20C	M	CA Reference	:CORP//16x	
20C	M	Sender's Reference	:SEME//16x	
23G	M	Function of the Message	4!c	
22F	M	CA Event Indicator	:CAEV//4!c	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	
Repetitive Optional Subsequence A1 Linkages				
16R	M	Start of Block	LINK	
20C	M	Corporate Action Reference	:CORP//16x	
16S	M	End of Block	LINK	
End of Subsequence A1 Linkages				
Repetitive Optional Subsequence A1 Linkages				
16R	M	Start of Block	LINK	
20C	M	Previous Message Reference	:PREV//16x	
16S	M	End of Block	LINK	
End of Subsequence A1 Linkages				
16S	M	End of Block	GENL	
End of Sequence A General Information				
Mandatory Sequence B Underlying Securities				
16R	M	Start of Block	USECU	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	CASCADE-Konto der Lead Manager
35B	M	Identification of FI	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	ISIN der alten, zu tilgenden Gattung
93B	O	Total Eligible for CA	:ELIG//4!c/[N]15d	Nostrobestand minus der Absetzungen, der zur Abrechnung herangezogen wurde. Syntax: Generelle Verwendung des Vorzeichens "N".
93B	O	Settlement Position	:SETT//4!c/[N]15d	Nostrobestand ohne Abzug von Absetzungen, der zur Abrechnung herangezogen wurde. Syntax: Generelle Verwendung des Vorzeichens "N".
93B	M	Confirmed Balance	:CONB//4!c/[N]15d	Identisch mit :93B::ELIG. Syntax: Generelle Verwendung des Vorzeichens "N".

Tag	Status	Field Name	Format	
16S	M	End of Block	USECU	

End of Sequence B Underlying Securities

Optional Sequence C Corporate Action Details

16R	M	Start of Block	CADETL	
98A	O	Ex-Dividend or Distribution Date	:XDTE//8!n	
98A	O	Record Date	:RDTE//8!n	
70E	O	Additional Text	:ADTX//10*35x	
16S	M	End of Block	CADETL	

End of Sequence C Corporate Action Details

Mandatory Sequence D Corporate Action Confirmation

16R	M	Start of Block	CACONF	
13A	O	CA Option Number	:CAON//3!c	
22H	M	CA Option Code	:CAOP//SECU	

Repetitive Optional Subsequence D1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	Für den Lead Manager wird immer DEBT angezeigt. Auch der MT566 REVR weist DEBT aus.
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	ISIN der neuen Gattung, in die getilgt wird. Diese kann ein CSC- oder NCSC-Titel sein.
36B	M	Posting Quantity	:PSTA//4!c/15d	Anzahl der neuen Stücke, die dem Lead Manager belastet wurden (oder im Falle des 23G::REVR wieder gutgeschrieben wurden)
92D	O	New to Old	:NEWO//15d/15d	Tilgungsverhältnis
98A	M	Posting Date	:POST//8!n	Buchungsdatum der neuen Stücke auf der CASCADE- bzw. Creation-Plattform.

Optional Repetitive Subsequence D1b Receiver/Deliverer

16R	M	Start of Block	RECDEL	Aufbau dieser Subsequenz nur, falls neue Titel = NCSC-Titel
95P	M	Place Of Settlement	:4!c//4!a2!a2!c[3!c 1]	:PSET//CEDELULL
97A	O	Safekeeping Account	:SAFE//35x	Konto des Lead Managers auf der Creation-Plattform
16S	M	End of Block	RECDEL	

End of Optional Repetitive Subsequence D1b Receiver/Deliverer

16S	M	End of Block	SECMOVE	
-----	---	--------------	---------	--

Tag	Status	Field Name	Format	
End of Subsequence D1 Securities Movement				
16S	M	End of Block	CACONF	
End of Sequence D Corporate Action Confirmation				
Optional Sequence E Additional Information				
16R	M	Start of Block	ADDINFO	
70E	O	Additional Text	:ADTX//10*35x	:ADTX//CONFIRMATION FOR LEAD MANAGER
16S	M	End of Block	ADDINFO	
End of Sequence E Additional Information				

## 2.5 Einführung des Real Time-MT564 ab Stichtag

Mit dieser Serviceerweiterung verlängert sich der heutige Lebenszyklus der bestandsbezogenen MT564 Pre-Notifikation.

- Am Stichtag eines Income- oder Non Income Events erhält der Kunde bei Änderungen von Eventdaten in real time eine MT564 Pre-Notifikation.
- Nach dem Stichtag informiert die MT564 Pre-Notifikation in real time über die Stornierung und Neuabrechnung von Vorgängen sowie über die Abrechnung eines Events per Nachlauf.

### 2.5.1 Hauptmerkmale

#### Bestands- und Eventbasis

Der real time MT564 wird für alle Income- und Non Income Terminarten eingeführt, zu denen die CBF heute schon die bestandsbezogene MT564 Pre-Notifikation versendet. Zudem kommt der real time MT564 auch bei dem neuen MT564-Service für die Hauptzahlstelle und den Lead Manager (TA231) zur Anwendung, wie in dem vorausgehenden Kapitel bereits erläutert.

Basis des real time MT564 sind die Bestände der Kunden bzw. Nostrobestände der Hauptzahlstelle bzw. des Lead Managers. Der real time MT564 wird nicht auf Transaktionen der Kunden angewandt, d.h. die heutigen SWIFT-Services zu Transaktionen für das Claiming bleiben hiervon unberührt.

Kunden, die heute schon die bestandsbezogene MT564 Pre-Notifikation beziehen erhalten automatisch ab 19. November 2012 den real time MT564 mit den gleichen Customizing-Einstellungen, wie sie heute schon vorliegen.

## Kommunikationswege und -zeiten

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

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

Für die Übertragung des real time MT564 wird der gleiche Kommunikationsweg genutzt wie für die bestandsbezogene MT564 Pre-Notifikation bzw. die MT564 Pre-Notifikation für die Hauptzahlstelle bzw. den Lead Manager.

Da bei Income-Terminarten die Verarbeitung von Stornierungen und Neuabrechnungen untertägig erfolgen kann, kann der Versandzeitpunkt eines real time MT564 und die zugehörige MT566 Bestätigung nach Geldebuchung dicht beieinander liegen oder sich im Extremfall sogar überlappen.

Bei File Transfer werden die in einer Datei übermittelten Nachrichten nach dem Timestamp ihrer Erstellung sortiert.

## Nachrichtenformate und -inhalte

Nachfolgend werden die Abweichungen im Nachrichtenaufbau des real time MT564 gegenüber der bestandsbezogenen MT564 Pre-Notifikation bis Stichtag – 1 Bankarbeitstag aufgeführt.

Sequenz / Feld	MT564 an Kunden	MT564 an Hauptzahlstelle / Lead Manager
<b>A. General Information</b>		
25D::Processing Status	Generelle Verwendung von 25D::PROC//COMP	
<b>B2. Account Information</b>		
93B:: Balance	Keine Anzeige von 93B::ELIG	
	<u>Am Stichtag:</u> Anzeige von 93B::SETT mit dem aktuellen, gebuchten <b>CASCADE-Bestand</b> des Kunden ohne Berücksichtigung von Absetzungen. Die Bestandsanzeige stellt eine Art "Snapshot" dar ohne Berücksichtigung der parallel verlaufenden RTS-Settlementverarbeitung..  <u>Nach Stichtag:</u> Anzeige von 93B::SETT mit dem zur Abrechnung herangezogenen, berechtigten CASCADE-Bestand des Kunden jedoch ohne Berücksichtigung (d.h. ohne Abzug) von Absetzungen.	<u>Am Stichtag:</u> Anzeige von 93B::SETT mit dem aktuellen, gebuchten <b>CASCADE-Nostrobestand</b> ohne Berücksichtigung von Absetzungen. Die Bestandsanzeige stellt eine Art "Snapshot" dar ohne Berücksichtigung der parallel verlaufenden RTS-Settlementverarbeitung..  <u>Nach Stichtag:</u> Anzeige von 93B::SETT mit dem zur Abrechnung herangezogenen, berechtigten Nostrobestand jedoch ohne Berücksichtigung (d.h. ohne Abzug) von Absetzungen.
<b>D. Corporate Action Details</b>		
22F:: Additional Business Process Indicator	Im Falle eines MT564 <b>CANC</b> (23G::CANC) und bereits erfolgter Abrechnung des Events wird der Indikator 22F::ADDB//REVR gesetzt. Der MT564 CANC avisiert damit eine Stornobuchung.	
E1 SecMove, E2 CashMove	Die folgenden <b>Beträge</b> werden auf Basis von 93B::SETT kalkuliert 36B:: Entitled Quantity 19B::Entitled Amount 19B:: Gross Amount 19B:: <i>Tax Amounts</i>	Die folgenden <b>Beträge</b> werden auf Basis von 93B::SETT kalkuliert 36B:: Entitled Quantity 19B::Entitled Amount 19B:: Gross Amount
	Keine Berücksichtigung von möglichen <b>Provisionen</b> bei TA1xx (Income), d.h. keine Anzeige von 19B::CHAR und 92A::CHAR.	
	Anzeige der avisierten <b>Valuta</b> (Geld) und des Payment Date (Stücke) im MT564 nach Stichtag als 98B::VALU//UKWN bzw. 98B::PAYD//UKWN.	

## 2.6 Ausbuchung wertlos gemeldeter Zertifikate und Optionsscheine

---

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

Ab dann werden diese Papiere an dem Tag ausgebucht, den der Emittent als Valuta-Datum vorgegeben hat (bisher mussten weitere 10 Bankarbeitstage abgewartet werden). Bei fehlender Vorgabe eines Valuta-Datums kommt die heutige 10 Bankarbeitstage-Regel als Standardregel zur Anwendung.

Dies sollte zu einer Erleichterung bei allen Beteiligten führen, da es die Zeit zwischen Bewertungstag und Ausbuchung signifikant reduziert und auch die Depotgebühren entsprechend senkt.

Bitte beachten Sie, dass es am 19. November zu einem erhöhten Volumen an MT564 Pre-Notifikationen in TA222 kommen kann, da durch die Umstellung der Verarbeitung MT564 CANC und MT564 NEWM Nachrichten zu den aktuellen Vorgängen erzeugt werden.

Leerseite

---

**Kontakt**

[www.clearstream.com](http://www.clearstream.com)

**Veröffentlicht von**

**Clearstream Banking Frankfurt**

**Besuchsanschrift:**

Clearstream Banking AG  
Mergenthalerallee 61  
65760 Eschborn  
Germany

**Postanschrift:**

Clearstream Banking AG  
60485 Frankfurt /Main  
Germany

---