

## CBF Release im November 2015: Vorankündigung der Änderungen

Clearstream Banking<sup>1</sup> informiert die Kunden bereits vorab über einige Änderungen, die mit dem CBF Release am

**Montag, 23. November 2015**

eingesetzt werden, da diese Anpassungen auf Kundenseite ggf. Systemänderungen nach sich ziehen.

Über weitere Änderungen, die im Rahmen des CBF Release im November 2015 in Kraft treten, und, falls erforderlich, zusätzliche Details zu den nachfolgend aufgeführten Änderungen, werden wir Sie zu einem späteren Zeitpunkt informieren.

### 1. Einführung des Record Tag für Income und Non Income Events in Deutschland

Im Zuge der Aktienrechtsnovelle 2014 ist es geplant, folgenden Sachverhalt in den § 58 Absatz 4 AktG aufzunehmen:

„Der Anspruch ist am dritten auf den Hauptversammlungsbeschluss folgenden Geschäftstag fällig. In dem Hauptversammlungsbeschluss oder in der Satzung kann eine spätere Fälligkeit festgelegt werden.“

Diese Gesetzesänderung ist die Voraussetzung für die Einführung des Record Tag für Income Events in Deutschland. Die Gesetzesänderung soll zum 1. Januar 2016 wirksam werden.

Eine Anpassung des § 44 EStG ist noch ausstehend.

Die Einführung des Record Tag für Non Income Events, die keiner Gesetzesänderung bedarf, ist ebenfalls für den 1. Januar 2016 geplant, unter der Voraussetzung der Zustimmung der BaFin. CBF wird die entsprechenden Änderungen bereits im November Release 2015 einsetzen.

Für detaillierte Beschreibungen der Auswirkungen verweisen wir auf die Kundeninformation „Record Tag Deutschland“, die auf der Clearstream Website [www.clearstream.com](http://www.clearstream.com) unter Products and Services / Assest-Services / Corporate Actions / [CSD Frankfurt](#) zur Verfügung steht.

### 2. CASCADE-PC

Durch Erweiterung und Änderung verschiedener Online-Masken am Host wird im November 2015 eine neue CASCADE-PC-Version erforderlich sein. Deren Installation ist für die Nutzer verpflichtend. Weitere Einzelheiten erhalten Sie mit einer separaten Kundeninformation.

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.

### 3. Xemac

Durch Erweiterung und Änderung verschiedener Online-Masken wird im November Release 2015 eine neue Xemac-Version erforderlich sein. Deren Installation ist für die Nutzer verpflichtend; der Client wird über die Clearstream Website zur Verfügung gestellt.

Weitere Einzelheiten zu den Änderungen sowie Informationen zu T2S bedingten Migrations-Maßnahmen für Xemac erhalten Sie mit einer separaten Kundeninformation.

### 4. Vorbereitende Maßnahmen für TARGET2-Securities (T2S) Welle 3

Das von CBF veröffentlichte Umsetzungskonzept zur Implementierung von Maßnahmen für T2S beschreibt, dass die Anpassung von CBF Applikationen schrittweise erfolgt. Seit November 2013 stellt CBF mit jedem Release für T2S benötigte Funktionalität zur Verfügung. Mit diesem Vorgehen möchte CBF die Kunden rechtzeitig auf die Neuerungen vorbereiten. Die im Folgenden genannten, T2S bedingten Änderungen dieses Releases stellen insbesondere Maßnahmen bereit, die den Migrationsaufwand mit der Implementierung der Welle 3 reduzieren.

#### 4.1 Änderungen in KUSTA (Kundenstammdaten)

Mit der Implementierung von T2S wird der CBF Kontoinhaber auf der neuen Settlement Plattform als T2S Party angelegt. Das identifizierende Kennzeichen hierzu ist der BIC11. CBF hat ihre Kunden mit einer E-Mail am 6. Januar 2015 gebeten, für ihre CBF Kontostamm-Nummer einen zugehörigen T2S Party BIC mittels des Formulars [T2S Party Identification Registrierung BIC Branch Code \(BIC11\)](#) zu benennen. CBF implementiert dieses neue Kennzeichen mit den Kunden seit April dieses Jahres. Ziel ist es, dass unsere Kunden die T2S Party BIC Informationen rechtzeitig an CBF senden, um eine abschließende Bearbeitung bis zum 15. September 2015 zu gewährleisten<sup>2</sup>. Damit unsere Kunden dieses neue Kennzeichen auch vollumfänglich nutzen können, werden die folgenden Änderungen im November Release aktiv.

Dazu werden die bisherigen Stammdaten um den T2S Party BIC, d.h. der von Kunden gelieferte BIC11, erweitert, sowie um ein Kennzeichen, ob die Informationen zum CBF Kontostamm auf T2S bereitgestellt werden. Nicht auf T2S angelegt werden z. B. so genannte RegÜber-Konten .

##### 4.1.1. Änderungen an Reports

Der Report "KUSTA Datenträger ICP Teilnehmer" mit Informationen zu Marktteilnehmern wird umbenannt in "KUSTA Datenträger Markt". Weiterhin werden die Felder "ICP" und "KV/CL" jeweils in "MARKT" umbenannt.

Der "KUSTA-Datenträger" mit Kontostammdaten wird um die folgenden neuen Felder erweitert:

- "T2S Relevant" mit den Merkmalen J (ja) / N (nein) / NK (nur Konto)<sup>3</sup>
- "T2S Party BIC" stellt den vom Kunden benannten BIC11 dar

Die zusätzlichen Felder werden sowohl im Veröffentlichungsmodus "VERÖFFENTLICHUNG: GRUNDDATEN" als auch im Modus "VERÖFFENTLICHUNG: GESAMTDATEN" angezeigt.

Die jeweiligen Internet Dateien werden ebenfalls entsprechend angepasst.

Eine Beschreibung des Satzaufbaus befindet sich im Anhang 5.1.

- 
2. Im Rahmen der Kontoeröffnung ist es notwendig den zugehörigen T2S Party BIC mit anzugeben. Ohne diesen BIC11 ist eine Eröffnung nicht möglich.
  3. Das Merkmal „NK (nur Konto)“ wird in von CBF definierten Ausnahmefällen genutzt, in denen lediglich ein Wertpapierkonto auf T2S angelegt wird. Dies betrifft nur Kontostämme, in denen CBF selbst der Kontoinhaber ist.

#### 4.1.2. Änderungen in der Bank-Information

Da zukünftig alle Teilnehmer in T2S ausschließlich über den T2S Party BIC identifiziert werden, ist eine Konto-Übersicht mit den Kundeninformationen zu den mit CBF verbunden Cross-border Märkten nicht mehr erforderlich. Für bereits nach T2S migrierte CSDs werden die Kontodaten der CSD-Teilnehmer aus der Bank-Information (Alpha-Suche und Direkteinstieg) entfernt. Daher wird der Eintrag für den Markt "10 Monte Titoli" aus der Übersicht der internationalen Märkte mit der Implementierung des November Release entnommen.

Zusätzlich werden in der Detailansicht der CASCADE Online Funktionalität zur Bank-Information (Alpha Suche in KVAV IA und Direkteinstieg in KVAV IB) für den Markt "01 CBF" die folgenden Informationen ergänzt:

- T2S RELEVANT Kennzeichen analog der Ausgabe wie im KUSTA Datenträger
- T2S PARTY BIC T2S Party des Kontostamms

## 4.2 Anpassungen in CASCADE

Mit dem CBF Release im November 2014 hat CBF bereits die Oberfläche von CASCADE Online (HOST / PC) an die zukünftige Verarbeitung mit T2S angepasst. Dazu wurden neue Eingabefelder etabliert und die Masken restrukturiert. Die bisherigen Änderungen betrafen ausschließlich das Layout, d.h. eine Erfassung von neuen Werten ist derzeit nicht möglich. Mit dem November Release 2015 werden erste Felder zur Eingabe freigegeben und in Teilen die zugehörige Funktionalität freigeschaltet.

#### 4.2.1. Etablierung der T2S Match-Kriterien

Die bisherige, für Domestic Instruktionen gültige Match-Logik in CASCADE wird an die T2S Match-Logik angeglichen. Die Änderungen betreffen das Matching der Wertpapierüberträge der Auftragsart AA01 / AA02. Weitere Details zum Matching finden sich auch in unserer Detailed Functional Description (DFD) „Domestic OTC Settlement“. Für Premium-Nutzer stehen die DFDs zu T2S auf der Clearstream Website [www.clearstream.com](http://www.clearstream.com) unter Strategy and Initiatives / TARGET2-Securities / [Detailed Functional Descriptions](#) zur Verfügung.

In Vorbereitung für die bevorstehende Migration nach T2S und die von CBF geplante Überführung von Domestic Instruktionen auf die neue Settlement Plattform kann mit dieser Maßnahme sichergestellt werden, dass die zukünftigen T2S Match-Kriterien am Tag der Migration auf T2S bereits erfüllt sind.

Der CBF Direct Matching Service ist von dieser Umstellung nicht betroffen und kann weiterhin bis zur Migration in Welle 3 genutzt werden.

#### **Anpassung des EUR-Toleranzbetrags**

Dazu wird der bisherige, maximale Toleranzbetrag von 25 EUR für den Abrechnungsbetrag gemäß den European Central Securities Depositories Association (ECSDA) Standards angepasst. Diese Änderung betrifft alle Instruktionen, in denen CBF die Rolle des Issuer CSD wahrnimmt oder das Settlement ausschließlich zwischen CBF Kunden stattfindet und ist eine vorbereitende Maßnahme für die Implementierung der Welle 3. Bitte beachten Sie, dass für Instruktionen, bei denen CBF als Investor CSD fungiert, außerhalb von T2S die Match-Logik des betroffenen Issuer CSD maßgebend ist. Weitere Details entnehmen Sie bitte hierzu unseren CASCADE Link Guides.

Nachstehend die Regeln zur Prüfung des Abrechnungsbetrags:

- Wenn der Geldgegenwert mindestens einer Instruktion kleiner oder gleich 100.000 EUR ist, so liegt die Toleranzgrenze bei 2 EUR.
- Wenn der Geldgegenwert beider Instruktionen über 100.000 EUR liegt, liegt die Toleranzgrenze bei 25 EUR.

Im Falle einer Differenz in den vorbenannten Betragsgrenzen ist der vom Verkäufer eingestellte Abrechnungsbetrag für die Anpassung des Gegenwerts maßgeblich. Der zur Abwicklung gelangte Settlementbetrag wird im CASCADE Settlement Reporting ausgewiesen.

In der CASCADE Online Funktionalität KVAV IW wird entsprechend ergänzt, dass die angegebene Toleranzgrenze für einen Geldgegenwert größer als 100.000 EUR gilt.

Für die Abwicklung von Instruktionen in Fremdwährung gelten die jeweils gültigen, maximalen Toleranzbeträge wie heute und bleiben von obiger Änderung für EUR-Beträge unberührt.

### Matching von Party Level 2

Basierend auf der neuen Struktur für die Settlement Party Informationen, die im November 2014 im deutschen Markt eingeführt wurde, wird CBF ab dem November 2015 das optionale Matching auf Party Level 2 für Domestic Instruktionen einführen. Bei einem optionalen Match-Kriterium müssen die Werte, falls sie sowohl in der Liefer- als auch der Empfangsinstruktion angegeben sind, identisch sein.

| CASCADE Feld                   | ISO 15022 Levels |                |                |                |         |
|--------------------------------|------------------|----------------|----------------|----------------|---------|
|                                | 5 Levels         | 4 Levels       | 3 Levels       | 2 Levels       | 1 Level |
| LAST-KTO /<br>GUT-KTO          | DEAG /<br>REAG   |                |                |                |         |
| P1 Lieferer /<br>P1 Empfaenger |                  |                |                |                |         |
| P2 Lieferer /<br>P2 Empfaenger | DE11 /<br>RE11   | DE11 /<br>RE11 | DECU /<br>RECU | SELL /<br>BUYR |         |
| P3 Lieferer /<br>P3 Empfaenger | DE12 /<br>RE12   | DECU /<br>RECU | SELL /<br>BUYR |                |         |
| P4 Lieferer /<br>P4 Empfaenger | DECU /<br>RECU   | SELL /<br>BUYR |                |                |         |
| P5 Lieferer /<br>P5 Empfaenger | SELL /<br>BUYR   |                |                |                |         |



Die folgende Übersicht zeigt, wie die verschiedenen Kennzeichen miteinander matchen. Die Übersicht zeigt auch, dass ein leeres Feld – wenn unterschiedlich viele Party Level befüllt sind und Party Level 2 nur von einem Kontrahenten gefüllt ist – immer matcht.

| Match-Logik               |     | Party Level 2 – Lieferer    |                             |  |     |     |     |        |
|---------------------------|-----|-----------------------------|-----------------------------|--|-----|-----|-----|--------|
|                           |     | BIC                         | BLZ                         | KTO  | ACC | TXT | DSS | <leer> |
| Party Level 2 – Empfänger | BIC | Matching bei gleichem Wert  | Kein Matching: Match Fehler | In dieser Kombination an Kennzeichen und zugehörigen Werten ist jederzeit ein Matching gegeben |     |     |     |        |
|                           | BLZ | Kein Matching: Match Fehler | Matching bei gleichem Wert  |  |     |     |     |        |
|                           | KTO |                             |                             |  |     |     |     |        |
|                           | ACC |                             |                             |  |     |     |     |        |
|                           | TXT |                             |                             |  |     |     |     |        |
|                           | DSS |                             |                             |  |     |     |     |        |
| <leer>                    |     |                             |                             |  |     |     |     |        |

CBF empfiehlt den Kunden die derzeit genutzten Kontrahentendaten in deren Systemen (z. B. Standing Settlement Instructions) schon vor Implementierung dieses Releases auf Aktualität zu prüfen. Weiterhin sollten Kunden mit ihren Kontrahenten abstimmen, ob zukünftig ein Matching auf Party Level 2 gewünscht ist und, wenn ja, ob das Kennzeichen „BIC“ oder „BLZ“ als Matchkennzeichen genutzt werden soll. Bei der Verwendung des Kennzeichens „BIC“ ist ein BIC11 mit dem Kontrahenten abzustimmen. Darüber hinaus könnten die Kontrahenten vereinbaren, dass in den Instruktionen von einer der beiden Seiten ein nicht match-relevantes Kennzeichen angegeben wird. Mit diesen Maßnahmen können sowohl ein mögliches Cross-matching minimiert als auch potentielle Match-Fehler vermieden werden.

Für das Wochenende des Releasewechsels bedeuten die obigen Änderungen, dass offene Instruktionen, die bereits erfolgreich zum Matching gelangt sind, weiterhin zum Settlement herangezogen werden. Ausschließlich für offene Instruktionen, die noch nicht gematcht, sind sowie für neue Instruktionen gilt die neue Match-Logik.

#### **Common Trade Referenz (Referenz Nr.)**

Die Common Trade Referenz (Referenz Nr.) wird zu einem optionalen Match-Kriterium, d.h. die Common Trade Referenz kann gegen den gleichen Wert sowie gegen ein leeres Feld matchen, nicht jedoch gegen einen abweichenden Wert.

Werden die Kontrahenten-Informationen auf Party Level 2 nicht mit match-relevanten Informationen gefüllt, kann die Common Trade Referenz dazu dienen, ein eindeutiges Kriterien für das Matching zu vereinbaren. Die Common Trade Referenz sollte nur dann einen Wert enthalten, wenn die Befüllung der Referenz mit dem Kontrahenten (Gegenseite) abgestimmt ist.

```

TRAN: KVA A FC: AA SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          WP-UEBERTRAG / AENDERUNG          AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR: 6999999          WKN: I DE0008404005

T2S ACTOR BIC: TESTDEFFXXX          T2S ACTOR REF          : CUSTOMERORCBFREF
MITI REF          : T2SREFERENCENUMB
REFERENZ-NR          :
ALREADY MATCHED(J/ ) :
PARTIAL SETTTL IND: NPAR
ISO TRANSACTION CODE: TRAD          REASON CODE          : LACK CVAL

SCHLUSSTAG          : 11.12.2013          KURS / WRG          :
EXT SET-DAY          :
UEB-GRUND          : 601 KEINE ZUORDNUNG
URSPR-NOM          :          RUECKUEBERTRAG: N          TR:
BELEGSCHAFTS-SP:          SP-DATUM          :
KUPONINFO/RECORD-DATE:

TEXT:
-- ID-KZ: 9999999999 -- PW:          ----- B999988S -- 11/12/13 -- 09:09:09 --

PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF7:Zurück PF8:Vor PF5:Status

```

Im automatisierten Nachrichtenverkehr (SWIFT, MQSeries und File Transfer) können unsere Kunden die Common Trade Referenz im Feld „:20C::COMM“ angeben.

|            | Kontrahent 1 | Kontrahent 2 | Match |
|------------|--------------|--------------|-------|
| Beispiel 1 | ABCD1234     | XYZ789       | ✘     |
| Beispiel 2 | ABCD123      | ABCD123      | ✔     |
| Beispiel 3 | ABC45        | <leer>       | ✔     |
| Beispiel 4 | <leer>       | XY12345      | ✔     |
| Beispiel 5 | <leer>       | <leer>       | ✔     |

#### 4.2.2. Freischaltung T2S spezifischer Felder

In den CASCADE Online Funktionalitäten gibt es bereits seit dem Release vom November 2014 T2S spezifische Felder, in denen bisher keine Eingabe möglich ist.

Mit diesem Release im November 2015 wird die Eingabe für den Partial Settlement Indikator und der ISO Transaction Codes in den Auftragsarten AA01 / AA02 sowohl im Online (HOST / PC) als auch im automatisierten Nachrichtenverkehr möglich sein.

Diese Änderungen betreffen die CASCADE Online Transaktionen KVEE WE, KVEE MI und KVEA. Die über CASCADE Online erfassten Werte sowie über den automatisierten Nachrichtenverkehr übermittelten Daten werden in den CASCADE Online Transaktionen KVEK, KVAI, KVEI, KVA A und KVDU angezeigt.

```

TRAN: KVEE FC: WE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG-2          ERFASSUNGSSTATUS

          PRIMANOTE:          AUFTNR: 6999999          WKN: I DE0008404005

UEB-GRUND  :

EXT SET-DAY:          RUECKUEBERTRAG (J/N) : N
ALREADY MATCHED(J/ ) :          PARTIAL SETTL INDICATOR: ____
ISO TRANSACTION CODE: ____

BELEGSCHAFT-SP: N          SP-DATUM: _____
KUPONINFO/RECORD-DATE: _____

TEXT: _____

-- ID-KZ: 9999999999 -- PW:          ----- B999988S -- 11/12/13 -- 09:09:09 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück  PF8:Vor

```

Die eingegebenen Werte werden im CASCADE Auftragsbestand gespeichert und können in den genannten Anzeigen eingesehen werden. Die zugehörige Settlementfunktionalität wird jedoch erst mit Migration in Welle 3 zur Verfügung stehen. Die Möglichkeit, die vorbenannten Werte ab diesem Release einzugeben, ermöglicht eine T2S-konforme Eingabe von Instruktionen, damit eine Migration von schwebenden Instruktionen am Implementierungswochenende der T2S Welle 3 gewährleistet ist.

In allen anderen T2S spezifischen Feldern ist bis zur Migration in Welle 3 keine Eingabe möglich. Dies betrifft die folgenden Felder:

- Deviating DCA (DCA/REF)
- Linkages/Pools
- Already matched
- BATM/ADEA
- Modifications of PSI

#### **Partial Settlement Indikator**

Partial Settlement ist eine Funktionalität der Settlement Plattform T2S, die von CBF ab Migration in Welle 3 vollumfänglich unterstützt wird. Weitere Details zu dieser Funktionalität finden sich auch in unserer Detailed Functional Description (DFD) „Domestic OTC Settlement“.



| Partial Settlement Indikator | Beschreibung   |
|------------------------------|--|
| NPAR                         | Kein Partial Settlement erlaubt.<br>Die Instruktion wird beim Partial Settlement nicht berücksichtigt.   |
| PART                         | Partial Settlement ist erlaubt.<br>Die Instruktion wird beim Partial Settlement berücksichtigt.  |
| PARQ                         | Partial Settlement ist erlaubt, muss aber einen minimalen Wertpapierbetrag erfüllen.<br>Die Instruktion kann beim Partial Settlement nur berücksichtigt werden, wenn der in den T2S Wertpapierstammdaten angegebene minimale Abwicklungsschwellenwert überschritten wird. Der Schwellenwert wird von T2S geprüft.                          |
| PARC                         | Partial Settlement ist erlaubt, muss aber einen minimalen Geldgegenwert erfüllen.<br>Die Instruktion kann beim Partial Settlement nur berücksichtigt werden, wenn der in den T2S Stammdaten definierte Wert überschritten wird. Der Wert hängt von der ISIN und der Währung des Geldgegenwerts ab. Der Schwellenwert wird von T2S geprüft. |

Die Informationen zum Partial Settlement Indikator können von unseren Kunden unter Nutzung des Nachrichtentyps MT548 (Business Validation Feedback und Lifecycle Information, Produkt „Processing Information“) bezogen werden. Alternativ stehen diese Informationen auch im Nachrichtentyp MT537 (Statement of Pending Transactions) zur Verfügung.

Der Partial Settlement Indikator ist in folgendem Beispiel blau markiert:

| Beispiel – Message Fields and Contents   |
|--|
| {1: F01XXXXDEFFBXXX0000001046}<br>{2: I548DAKVDEFFADOMN}<br>{4:  |
| :16R: GENL<br>:20C::SEME//C3C62026185B50BJ<br>:23G: INST<br>:98C::PREP//20131206202618<br>:16R: LINK<br>:13B::DAKV/TESTDEFFXXX<br>:20C::RELA//123456<br>:16S: LINK<br>:16R: LINK<br>:20C::TRRF//KP44440130810730<br>:16S: LINK<br>:16R: LINK<br>:13B::DAKV/TESTDEFFXXX<br>:20C::PCTI//T2SactorRef123<br>:16S: LINK<br>:16R: LINK<br>:20C::MITI//T2SRef123<br>:16S: LINK<br>:16R: STAT<br>:25D::MTCH//MACH<br>:16S: STAT<br>:16S: GENL<br>:16R: SETTRAN |

### Beispiel – Message Fields and Contents

```
:35B: ISIN DE0005190003
:36B::SETT//UNIT/3397,
:19A::SETT//EUR3000,
:97A::SAFE//44440000
:22F::SETR//TRAD
:22H::REDE//DELI
:22H::PAYM//APMT
:22F::STCO//PART
:98A::SETT//20131213
:98A::TRAD//20131213
:70E::SPRO///FREE Text
:16R: SETPRTY
:95Q::SELL//UNKNOWN
:97A::SAFE//12345678
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95Q::DECU//UNKNOWN
:97A::SAFE//123456
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95P::DEAG//DEAGDEFFXXX
:97A::SAFE//44440000
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95P::PSET//DAKVDEFFXXX
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95P::REAG//REAGDEFFXXX
:97A::SAFE//77770000
:20C::PROC//KP77770230810730
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95Q::RECU//UNKNOWN
:97A::SAFE//789456
:16S: SETPRTY
:16R: SETPRTY
:95P::BUYR//UNKNOWN
:97A::SAFE//BIC-BUYRDEFFXXX
:16S: SETPRTY
:16S: SETTRAN
-}
```

### ISO Transaction Code

Eine Übersicht aller zukünftig unterstützten ISO Transaction Codes findet sich im Anhang 5.2.

Die Eingabe der neuen ISO Transaction Codes in CASCADE Online (HOST / PC) hat bis zur Migration in Welle 3 keine Auswirkung auf das Settlement. Die bestehende Verarbeitung der heute genutzten ISO Transaction Codes über den automatisierten Nachrichtenverkehr bleibt erhalten.

### 4.2.3. Kennzeichen für Ex-Coupon und Cum-Coupon

Im Rahmen der Corporate Action Verarbeitung berücksichtigt CBF das Kennzeichen EX-TRD (SPEX) zur Ermittlung, ob eine Transaktion mit einem bezugsberechtigten Kupon durchgeführt wurde. In T2S erfolgt diese Angabe mittels des Trade Transaction Condition Indicator („TTCO Indikator“). Dieser Indikator ist in T2S ein zusätzliches („additional“) Match-Kriterium, und ein Settlement für diese Instruktionen ist nur möglich, wenn beide Kontrahenten den gleichen Wert angeben.

#### Definition für die Eingabe in Settlement Instruktionen

Bisher war die Eingabe des Kennzeichen für „Ex-Coupon“ oder „Cum-Coupon“ im Feld EX-TRD mit den Werten J(a), N(ein) oder blank (leer) möglich. Die bisherigen Werte in der CASCADE Online Erfassung werden abgelöst. Die neuen Werte entsprechenden Angaben, die auch im automatisierten Nachrichtenverkehr an CBF gesendet werden.

- blank (leer) bleibt in seiner Bedeutung unverändert.
- CCPN entspricht dem jetzigen Wert „N(ein)“; d.h., dass das Geschäft inklusive des letzten Kupons geliefert wird. Diese Ausprägung kommt bis zur Migration in Welle 3 im Domestic Markt nicht zum Tragen und hat im Domestic Markt auch keinen Einfluss auf das Matching.
- XCPN entspricht dem jetzigen Wert „J(a)“; d.h., dass das Geschäft exklusive des letzten Kupons geliefert wird. Diese Ausprägung kommt bis zur Migration in Welle 3 im Domestic Markt nicht zum Tragen und hat im Domestic Markt auch keinen Einfluss auf das Matching.
- SPEX entspricht dem jetzigen Wert „J(a)“; d.h., dass das Geschäft exklusive des letzten Kupons geliefert wird und kommt ab November 2015 ausschließlich im Domestic Markt und in den T2S Out-CSD Märkten<sup>5</sup> zum Tragen.

Bitte beachten Sie, dass der Wert SPEX bis zur Migration in Welle 3 parallel mit XCPN verwendet wird und danach abgelöst wird. Im Rahmen der T2S Match-Logik kann der Wert SPEX nicht berücksichtigt werden. Das bedeutet, dass bei Cross-border Instruktionen mit Monte Titoli ab dem November Release und mit den ESES Märkten ab Welle 2, der vom Kunden erfasste Wert SPEX von CBF im Rahmen des Mapping in den Wert „blank (leer)“ geändert wird. Wir bitten unsere Kunden, sich mit deren Kontrahenten bezüglich der Belegung des neuen Matchkriteriums abzustimmen.

Im Dezember 2014 hatte CBF ihre Kunden gebeten, im Rahmen der Implementierung von Cross-border Instruktionen mit dem italienischen Markt ab T2S Welle 1 keine Angaben für die Werte Ex-Coupon und Cum-Coupon einzugeben. Diese Regelung entfällt mit der Implementierung des Releases im November 2015.

Unabhängig davon ist das Feld in CASCADE bis zur Einführung der T2S Welle 3 kein Match-Kriterium. Betroffen sind die CASCADE Online Transaktionen KVEE WE, KVEE MI und KVEA für die Eingabe, sowie die Transaktionen KVEK, KVAI, KVEI, KVAA und KVDU zur Anzeige der zuvor benannten Werte.

#### Hinweise zur Verarbeitung von Corporate Actions

Im Rahmen der Verarbeitung von Corporate Actions („KADI“) gelten bis zur Migration in Welle 3 die bisherigen Regeln für Domestic Instruktionen für die Erstellung von Market und Reverse Claims, das heißt, weiterhin wird der Werte „SPEX“ in der Verarbeitung berücksichtigt. Die Werte „XCPN“, „CCPN“ und „blank (leer)“ werden bei Corporate Actions nicht berücksichtigt.

Mit der Migration der Märkte Monte Titoli und ESES auf T2S verändert sich die Verarbeitung und die neuen Werte „XCPN“ und „CCPN“ werden berücksichtigt.

---

5. Für den CSD SIX/SIS gilt die heutige Verarbeitung.

Am Wochenende des Releasewechsels werden die Werte folgendermaßen umgestellt:

- EX-TRD = J → SPEX
- EX-TRD = N → <leer>
- EX-TRD = <leer> → <leer>

#### 4.2.4. Kennzeichen für OPT-OUT Verarbeitung

Das Kennzeichen „OPT-OUT“ ist in T2S ein zusätzliches Match-Kriterium, das bisher von CBF nicht genutzt wird. Mit diesem Kennzeichen kann eine Instruktion von Transformationen im Rahmen von Corporate Action Verarbeitungen ausgeschlossen werden. Weitere Details zu dieser Funktionalität finden sich auch in unserer DFD „Custody“.

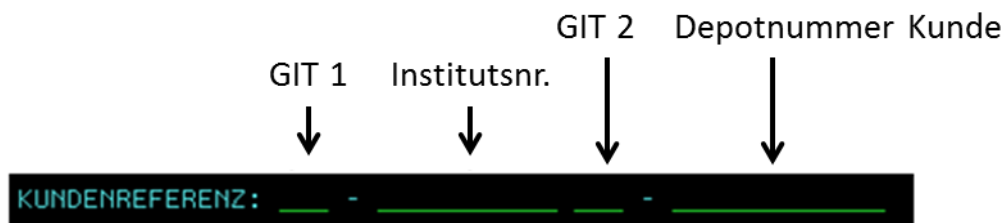
Die nachstehenden Werte sind für das Kennzeichen „OPT-OUT“ möglich:

- J(a); die Instruktion wird von der KADI-Verarbeitung ausgeschlossen
- blank (leer); es gelten die generellen Verarbeitungsregeln von KADI.

Dieses Kennzeichen ist nach der Migration auf T2S ein zusätzliches („additional“) Match-Kriterium und ein Settlement für diese Instruktionen ist nur möglich, wenn beide Kontrahenten den gleichen Wert angeben. Unabhängig davon ist das Feld in CASCADE derzeit kein Match-Kriterium. Betroffen sind die CASCADE Online Transaktionen KVEE WE, KVEE MI und KVEA für die Eingabe, sowie die Transaktionen KVEK, KVAI, KVEI, KVAA und KVDU zur Anzeige der zuvor benannten Werte.

#### 4.2.5. Befüllung Kundenreferenz

Bei Ein- und Auslieferungsaufträgen (AA16/AA18) in der CASCADE Transaktion KVEW sowie in der CASCADE Transaktion KVEE und den Transaktionen KVCE, KVUCU, KVCA und KVCB von CASCADE RS müssen CSDs zurzeit die Felder GIT1 und Institutsnummer in der Kundenreferenz als Pflichtfelder befüllen.



Diese Felder sind für alle CBF-Kunden in Zukunft nur noch optional zu befüllen.

Die Felder „Einlieferung-von Name“ und „Adresse“ auf den Erfassungsmasken der Transaktion KVEW respektive die Adressfelder der anderen genannten Eingabemasken werden nicht mehr automatisch aus der GIT1 und Institutsnummer abgeleitet, können aber optional von den Kunden befüllt werden.

Für die Korrektheit der Institutsnummer ist ausschließlich der erfassende Kunde verantwortlich. Es erfolgt keine Prüfung mehr durch CBF.

Die Nutzung der Felder GIT2 und „Depotnummer Kunde“ bleibt unverändert.

```

TRAN: KVEW FC: EL SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG      EINLIEFERUNG / EINZELERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                          LFD.EINLIEFERUNG
PRIMANOTE: _____      AUFTNR: _____      HLG: 01 GS
LAST-KTO : _____
GUT-KTO  : _____
WKN      : I _____
NOMINALE : _____      EINHEIT: _____      ST-ART:
NOM-URK  : _____      EINLIEF-ART : 1      LFD. EINLIEFERUNG
                          EINLIEF-GRUND: _____
KUNDENREFERENZ : _____      KZ-BST:
EINLIEFERUNG-VON NAME: _____
ADRESSE : _____
WKN-STAMMRECHT: I _____
BEARB-STATUS:

```

Die beschriebenen Änderungen betreffen sowohl die Erfassung in genannten Online Eingabemasken als auch die automatisierte Übermittlung via LIMA/SPOC.

#### 4.2.6. Validierung von BICs gegen das BIC Directory

Im Rahmen des T2S Party Identification Konzepts (BIC11) wird es erforderlich, dass CBF sowohl in den Kundenstammdaten als auch in den Instruktionen die Zulässigkeit des übermittelten BIC11 prüft. Derzeit erfolgt die Prüfung ausschließlich bei der Erfassung von T2S Party Informationen für Kundenstammdaten. BICs werden in den Feldern Party Level 2 bis Party Level 5 bisher nicht validiert.

Mit dem Release im November 2015 wird die Validierung des BIC im Instruktionsmanagement ergänzt. Die Prüfung des BIC erfolgt auf allen Party-Ebenen in einer Instruktion; d.h. sie wird für die Levels 1 bis 5 einheitlich durchgeführt. Alle Werte, die zum Kennzeichen "BIC" eingetragen wurden, werden gegen das SWIFT BIC Directory validiert. Findet sich der Wert dort nicht, wird die Instruktion abgelehnt. Im CASCADE Online (HOST / PC) wird eine der folgenden Fehlermeldungen ausgegeben:

| Wert    | Beschreibung (Deutsch)                               | Description (English)   |
|---------|--|---|
| KV6188F | BIC in LIEF. P1-BIC nicht im BIC-Directory vorhanden | The BIC in the field DELI P1-BIC cannot be found in the BIC directory |
| KV6189F | BIC in LIEF. P2-BIC nicht im BIC-Directory vorhanden | The BIC in the field DELI P2-BIC cannot be found in the BIC directory |
| KV6190  | BIC in LIEF. P3-BIC nicht im BIC-Directory vorhanden | The BIC in the field DELI P3-BIC cannot be found in the BIC directory |
| KV6191F | BIC in LIEF. P4-BIC nicht im BIC-Directory vorhanden | The BIC in the field DELI P4-BIC cannot be found in the BIC directory |
| KV6192F | BIC in LIEF. P5-BIC nicht im BIC-Directory vorhanden | The BIC in the field DELI P5-BIC cannot be found in the BIC directory |
| KV6193F | BIC in EMPF. P1-BIC nicht im BIC-Directory vorhanden | The BIC in the field RECE P1-BIC cannot be found in the BIC directory |
| KV6194F | BIC in EMPF. P2-BIC nicht im BIC-Directory vorhanden | The BIC in the field RECE P2-BIC cannot be found in the BIC directory |
| KV6195F | BIC in EMPF. P3-BIC nicht im BIC-Directory vorhanden | The BIC in the field RECE P3-BIC cannot be found in the BIC directory |
| KV6196F | BIC in EMPF. P4-BIC nicht im BIC-Directory vorhanden | The BIC in the field RECE P4-BIC cannot be found in the BIC directory |
| KV6197F | BIC in EMPF. P5-BIC nicht im BIC-Directory vorhanden | The BIC in the field RECE P5-BIC cannot be found in the BIC directory |

Im automatisierten Nachrichtenverkehr erhält der Kunde die Ablehnung als MT548 „Rejection“ mit dem Wert und der englischen Beschreibung gemäß obiger Tabelle im Feld :70D::REAS, beispielsweise wie folgt:

| Message Fields and Contents  |
|--|
| (...)  |
| :25D::IPRC//REJT   |
| :16R:REAS  |
| :24B::REJT//NARR   |
| :70D::REAS//KV6188FThe BIC in the field DELI P1-BIC cannot be found in the BIC directory |
| :16S:REAS  |
| (...)  |

CBF empfiehlt den Kunden die derzeit etablierten BIC Informationen in deren Systemen (z. B. Standing Settlement Instructions) schon vor Implementierung dieses Releases auf Aktualität zu prüfen, um mögliche Ablehnungen aufgrund von fehlerhaften oder nicht mehr aktuellen BIC11 auszuschließen.

Darüber hinaus werden die vom Kunden mitgeteilten T2S Party BIC Informationen in den Kundenstammdaten regelmäßig gegen das oben genannte Verzeichnis abgeglichen. Im Falle einer Fehlermeldung wird der CBF Relationship Manager den betroffenen Kunden aktiv ansprechen.

Die T2S Party BIC Informationen müssen ab dem November Release in Vorbereitung auf T2S die folgenden Kriterien erfüllen:

- Active
- Connected
- Published

#### 4.2.7. Anpassung von Status Texten

Die Anpassungen der nachstehenden Status Texte betreffen alle CASCADE Online Transaktionen, in denen der jeweilige Status angezeigt wird, wie beispielsweise KVAI und KVAA.

##### Party Hold Status

Mit dem November Release wird CBF die Texte der verschiedenen Hold Status mit den T2S Beschreibungen angleichen. Dazu werden die Texte des Party Hold Status folgendermaßen angepasst. Die Werte des Party Hold Status sowie deren Bedeutung bleiben davon unverändert.

| Status Party Hold |                        |                       |
|-------------------|------------------------|-----------------------|
| Wert              | Beschreibung (Deutsch) | Description (English) |
| 0                 | FREIGEgeben            | Released              |
| 1                 | GESPERRT AUFTRAGGEBER  | Blocked deliverer     |
| 2                 | GESPERRT EMPFAENGER    | Blocked receiver      |
| 3                 | GESPERRT BEIDE SEITEN  | Blocked on both sides |

Die Änderungen betreffen alle Auftragsarten mit einem Party Hold Status, Wertpapierübertrag in Auftragsart AA01 / AA02 und LION Lieferbestand AA10.

## CBF Dispo Status

Analog zu den textlichen Anpassungen für den Party Hold werden die Beschreibungen des Dispo Status für alle Auftragsarten folgendermaßen angepasst. Die Werte des Dispo Status sowie deren Bedeutung bleiben davon im Wesentlichen unverändert<sup>6</sup>.

| Dispo Status |  |  |
|--------------|--|--|
| Wert         | Beschreibung (Deutsch)                                     | Description (English)                                      |
| 410          | ABGELEHNT WEGEN SETTLEMENT-SPERRE (LIEFERER)               | Pending due to blocking (deliverer)                        |
| 411          | OFFEN WG. STAMMDATEN, SIEHE LISTE .NICHT ZUR DISPO UBERN.' | Pending due to master data, s. list 'not trans to process' |
| 412          | OFFEN WEGEN VERLINKTER INSTRUKTION                         | Pending due to linked instruction                          |
| 413          | OFFEN, GEGENSEITE FEHLT                                    | Pending, no counterpart                                    |
| 414          | OFFEN, GEGENSEITE SETZTE MATCH-STATUS .FEHLERHAFT'         | Pending, faulty matching stage entry by counterpart        |
| 415          | OFFEN WEGEN SETTLEMENT-SPERRE (EMPFAENGER)                 | Pending due to blocking (receiver)                         |
| 416          | OFFEN, GELD NICHT AUSREICHEND                              | Pending, lack of cash                                      |
| 417          | OFFEN, DA KEIN AUSREICHENDER BESTAND                       | Pending, lack of securities                                |
| 418          | OFFEN MANGELS STUECKEN UND MANGELS GELD                    | Pending, positions and cash not sufficient                 |
| 419          | TEILBESTAND OFFEN  | Partially pending  |
| 430          | OFFEN WEGEN SETTLEMENT-SPERRE (EINGEBER)                   | Pending due to blocking (instr.)                           |
| 431          | OFFEN WEGEN STAMMDATEN                                     | Pending due to master data                                 |
| 432          | OFFEN WEGEN FEIERTAG                                       | Pending due to holiday                                     |
| 433          | OFFEN, GEGENSEITE FEHLT                                    | Pending, no counterpart                                    |
| 434          | OFFEN, GEGENSEITE SETZTE MATCH-FEHLER                      | Pending, matching error of counterpart                     |
| 435          | OFFEN, KEIN SETTLEMENT MOEGlich                            | Pending, no settlement possible                            |
| 437          | OFFEN, DA KEIN AUSREICHENDER BESTAND                       | Pending, positions not sufficient                          |
| 440          | OFFEN WEGEN SETTLEMENT-SPERRE (EINGEBER), GELD OFFEN       | Pending due to blocking (instr.), cash open                |
| 441          | OFFEN WEGEN STAMMDATEN, GELD OFFEN                         | Pending due to master data, cash open                      |
| 442          | OFFEN WEGEN FEIERTAG, GELD OFFEN                           | Pending due to holiday, cash open                          |
| 443          | OFFEN, GEGENSEITE FEHLT, GELD OFFEN                        | Pending, no counterpart, cash open                         |
| 444          | OFFEN, GEGENSEITE SETZTE MATCH-FEHLER, GELD OFFEN          | Pending, matching error of counterpart, cash open          |
| 445          | OFFEN, KEIN SETTLEMENT MOEGlich, GELD OFFEN                | Pending, no settlement possible, cash open                 |
| 447          | OFFEN, DA KEIN AUSREICHENDER BESTAND, GELD OFFEN           | Pending, positions not sufficient, cash open               |
| 448          | OFFEN, TEILDISPONIERT, GELD OFFEN                          | Pending, partially in process, cash open                   |

6. Ausnahme ist Status 412, bisher „ABLEHNUNG WEGEN FEIERTAG“.

| Dispo Status |  |   |
|--------------|--|---|
| Wert         | Beschreibung (Deutsch)                                 | Description (English)                                     |
| 449          | TEILBESTAND OFFEN, GELD OFFEN                          | Partially pending, cash open                              |
| 450          | SETTLEMENTPROBLEM, CLEARSTREAM PRUEFT                  | Settlement problem, clearstream checks                    |
| 451          | OFFEN WEGEN STAMMDATEN                                 | Pending due to static data                                |
| 453          | OFFEN, GELD NICHT BEREITGESTELLT                       | Settlement pending, cash was not provided                 |
| 454          | OFFEN, KEIN AUSREICHENDER BESTAND                      | Settlement pending, lack of securities                    |
| 456          | OFFEN, GELD NICHT BEREITGESTELLT                       | Settlement pending, cash was not provided                 |
| 457          | OFFEN, KEIN AUSREICHENDER BESTAND                      | Settlement pending, lack of securities                    |
| 471          | OFFEN WEGEN GELDREGULIERUNG                            | Pending due to cash clearing                              |
| 480          | OFFEN WEGEN SETTLEMENT-SPERRE (EINGEBER), DECKUNG GELD | Pending due to blocking (instr.), cash cover              |
| 481          | OFFEN WEGEN STAMMDATEN, DECKUNG GELD                   | Pending due to master data, cash cover                    |
| 482          | OFFEN WEGEN FEIERTAG, DECKUNG GELD                     | Pending due to holiday, cash cover                        |
| 483          | OFFEN, GEGENSEITE FEHLT, DECKUNG GELD                  | Pending, no counterpart, cash cover                       |
| 484          | OFFEN, GEGENSEITE SETZTE MATCH-FEHLER, DECKUNG GELD    | Pending, matching err. Entered by counterpart, cash cover |
| 485          | OFFEN, KEIN SETTLEMENT MOEGlich, DECKUNG GELD          | Pending, no settlement possible, cash cover               |
| 487          | OFFEN, DA KEIN AUSREICHENDER BESTAND, DECKUNG GELD     | Pending due to lack of securities, cash cover             |
| 488          | OFFEN, TEILDISPONIERT, DECKUNG GELD                    | Pending, partially in process, cash cover                 |
| 489          | TEILBESTAND OFFEN, DECKUNG GELD                        | Partially pending, cash cover                             |
| 490          | BEI CSD GEBUCHT. OFFEN WEGEN SETTLEMENTSPERRE (EING.)  | Accounting with CSD, pending due to blocking (instr.)     |
| 491          | BEI CSD GEBUCHT. OFFEN WEGEN STAMMDATEN                | Accounting with CSD, pending due to master data           |
| 492          | BEI CSD GEBUCHT. OFFEN WEGEN FEIERTAG                  | Accounting with CSD, pending due to holiday               |
| 493          | BEI CSD GEBUCHT. OFFEN, GEGENSEITE FEHLT               | Accounting with CSD, pending, no counterpart              |
| 494          | BEI CSD GEBUCHT. OFFEN, MATCH-STATUS 'FEHLERHAFT'      | Accounting with CSD, pending, invalid matching stage.     |
| 495          | BEI CSD GEBUCHT. OFFEN, KEIN SETTLEMENT MOEGlich       | Accounting with CSD, pending, no settlement possible.     |
| 496          | BEI CSD GEBUCHT. OFFEN. GELD NICHT AUSREICHEND         | Accounting with CSD, pending, lack of cash                |
| 497          | BEI CSD GEBUCHT. OFFEN, DA KEIN AUSREICHENDER BESTAND  | Accounting with CSD, pending due to lack of securities    |
| 498          | BEI CSD GEBUCHT. OFFEN, TEILDISPONIERT                 | Accounting with CSD, pending, partially in process        |
| 499          | BEI CSD GEBUCHT. TEILBESTAND OFFEN                     | Accounting with CSD, partially pending                    |



#### 4.2.8. Verarbeitung von OTC Instruktionen auf Reg-Über Konten

Mit der Migration nach T2S in Welle 3 werden Reg-Über Konten nicht nach T2S migriert. Das bedeutet, dass zukünftig keine Wertpapierinstruktionen auf diesen Konten erfasst werden können, da ein Settlement nicht mehr möglich ist. Damit einhergehend werden die zugehörigen CBF-Unterkonten nicht mehr benötigt und im Rahmen der Vorbereitung auf T2S gelöscht. Kunden, die von dieser Maßnahme betroffen sind, wurden bereits im März 2015 informiert. Das bedeutet auch, dass Positionen von Reg-Über Unterkonten auf andere bestandsführende Konten transferiert werden müssen.

Kunden, die noch Positionen auf Reg-Über Unterkonten halten, müssen die Position daher **vor** dem kommenden Release im November 2015 auf andere Konten verschieben.

Damit sichergestellt ist, dass diese Konten zum Migrationszeitpunkt in Welle 3 keine Positionen halten, sind ab dem kommenden Release im November 2015 keine OTC Instruktionen von oder zu Reg-Über Konten mehr möglich.

#### 4.2.9. Abwicklung von Domestic Instruktionen von SIX-SIS emittierten Wertpapieren in CHF

Mit dem November Release erfolgt eine Harmonisierung der Abwicklung von Fremdwährungsgeschäften im Domestic Markt. Das bedeutet, dass die Geldabwicklung von allen Zahlungs-Lieferungs-Instruktionen (Delivery versus Payment - DvP / Receive versus Payment - RvP Geschäfte) in Fremdwährung ausschließlich über Clearstreams Creation Plattform zur Abwicklung gelangen. Daher werden zukünftig Instruktionen in SIX-SIS emittierten Wertpapieren gegen Schweizer Franken (CHF) auf diese Standardabwicklung für Fremdwährungsgeschäfte umgestellt. Das bedeutet, dass diese Instruktionen nicht wie bisher als Cross-border Geschäft in Zentralbankgeld über SIX-SIS / SNB abgewickelt werden, sondern in Geschäftsbankengeld (Commercial Bank Money - CoBM) über Creation. Von dieser Änderung sind ausschließlich Domestic Instruktionen betroffen, Cross-border Instruktionen gegen CHF sind davon unberührt.

Die Abwicklung der Geldseite aus Kompensationszahlungen wird zukünftig von KADI ebenfalls an Creation geschickt.

#### 4.2.10. Ablösung von CBF Reporting

Die folgenden Services/Reports werden mit dem Release im November 2015 aus dem operativen Betrieb genommen:

- Versand holiday  
Dieser Service informiert Kunden über Feiertage eines fremden CSDs, an denen kein Settlement mit diesem CSD stattfinden kann. Mit der Migration auf T2S unterliegen CBF und alle migrierten Link Partner dem T2S Holiday Kalender. Dadurch ist mit zunehmender Harmonisierung der Europäischen Märkte dieser Service nicht mehr notwendig.
- Automatisierte Umstellung der Gegenwertwährung  
Mit der Einführung des Euros hatte CBF diesen Service etabliert und dieser kann nun ersatzlos entfallen. Daher werden auch die zugehörigen proprietären Reports deaktiviert:
  - CASCADE Liste der Aufträge im Auftragsstatus, deren Gegenwert umgestellt wurde
  - LION Liste der auf Euro umgestellten Geschäfte

### 4.3 Anpassungen im Settlement Reporting

In Vorbereitung auf die geplante Migration in Welle 3 erweitert CBF mit diesem Release das Settlement und Dispo Bund Reporting.

#### 4.3.1. Neue Felder in der Anzeige vom Depotumsätzen für Auftragsart AA10

Die Depotumsatzanzeige (KVDU ID) wird bei Auftragsart AA10 um die folgenden Felder erweitert und damit das Layout der Maske angepasst:

| Feldname        | Beschreibung   | Gültig ab/Gefüllt ab  |
|-----------------|--|-----------------------|
| T2S Actor BIC   | T2S Party BIC der instruierenden Party   | Migration in Welle 3  |
| T2S Actor Ref   | Die vom Kunden eingegebene Referenz, sonst die OneClearstream ID <sup>a</sup>  | Migration in Welle 3  |
| PSI             | Partial Settlement Indikator: <ul style="list-style-type: none"><li>• NPAR – kein Partial Settlement</li><li>• PART – Partial Settlement erlaubt</li><li>• PARQ – Partial Settlement mit einem Schwellenwert an Stücken</li><li>• PARC – Partial Settlement mit einem Schwellenwert des Geldgegenwerts</li></ul> | November Release 2015 |
| Dispo-Priorität | Anzeige der Werte zur Priorität <ul style="list-style-type: none"><li>• 3 – hoch</li><li>• 4 – normal</li></ul>  | November Release 2015 |
| T2S Party BIC   | BIC11 zum angegebenen Kontostamm   | November Release 2015 |
| T2S MITI        | Die von T2S zugewiesene Referenz, wenn die Instruktion in T2S angenommen wird  | Migration in Welle 3  |

a. Von CBF vergebene, eindeutige, 16-stellige Referenz zu einer Instruktion



### 4.3.3. Depotbuch persönlich

In diesem Report wird im Feld „SET-ART“ der Batch Zyklus angegeben, in dem eine Instruktion abgewickelt wurde. Da die Abwicklung mit der Migration in Welle 3 nicht mehr den CBF Batches sondern dem T2S Geschäftstag folgt, wird dieses Feld nicht mehr benötigt. Das Feld wird daher mit diesem Release im November 2015 bereits entfernt.

| DEPOTBUCH PERSOENLICH VOM 01.10. BIS 31.10.2016            |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
|--|-----------|----------|----------|-----------|---------|---------|---------|--------|---------|-------------|---------------|---------------|-----------|-----------|------|
| KONTO-NR: 1/234/000 TESTBANK AG                            |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| T2S SAC : DAKV1234000                                      |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| ISIN / WKN DE000LBB11H0 / LBB11H LBB BAER INDEX 12T 17 DAX |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| BUCH-  | MB-       | SET-DAY  | SCHLUSST | LASTKTO   |         | GUTKTO  |         | AUFTR. |         | EING        |               |               |           |           |      |
|  |           |          | TAG      | ÜBERG     | LASTKTO |         | NIEDERL | GUTKTO | NIEDERL | AA          | BS            | GES-NR        | EIN       | NOMINALE  |      |
| WRG  | GEGENWERT |          | MAKL     | BEMERKUNG |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| ALTER SALDO  |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| 05.10  | 19:35     | 05.10.16 | 03.10.16 | 1234000   | 5678000 | 10      | 41      | 94     | ST      | 993.113,000 |               |               |           |           |      |
|  |           |          |          |           |         |         |         |        |         | 10,000-EUR  |               | 507,70        | 5678      |           |      |
| 07.10  | 19:38     | 07.10.16 | 05.10.16 | 1234000   | 5678001 | 5678099 | 10      | 41     | 9015764 | ST          | 400,000-EUR   |               | 20.456,00 | 5678      |      |
| 06.10  | 20:22     | 06.10.16 | 05.10.16 | 5678000   | 1234000 |         | 10      | 41     | 9033423 | ST          | 1.200,000     | EUR           | 61.116,00 | 1234      |      |
| 13.10  | 20:22     | 13.10.16 | 11.10.16 | 1234000   | 7999000 |         | 10      | 41     | 9025768 | ST          | 1.200,000-EUR |               | 60.648,00 | 5678      |      |
| 14.10  | 19:40     | 14.10.16 | 13.10.16 | 1234000   | 3456000 |         | 10      | 41     | 9017696 | ST          | 1.500,000-EUR |               | 73.995,00 | 1234      |      |
| 24.10  | 20:13     | 24.10.16 | 21.10.16 | 1234000   | 5678000 | 5678099 | 10      | 41     | 9031307 | ST          | 13,000-EUR    |               | 629,33    | 5678      |      |
| 26.10  | 20:36     | 26.10.16 | 24.10.16 | 5678000   | 5678000 | 5678099 | 10      | 41     | 1000712 | ST          | 13,000        | EUR           | 640,12    | 1234      |      |
| 26.10  | 20:36     | 26.10.16 | 24.10.16 | 3456000   | 1234000 |         | 10      | 41     | 9029507 | ST          | 1.500,000     | EUR           | 74.550,00 | 2345      |      |
| 28.10  | 19:36     | 28.10.16 | 25.10.16 | 1234000   | 1234008 | 5678000 | 5678012 | 10     | 41      | 1001665     | ST            | 1.225,000-EUR |           | 59.951,50 | 3456 |
| NEUER SALDO  |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
|  |           |          |          |           |         |         |         |        |         | 991.478,000 |               |               |           |           |      |
| ISIN / WKN AT0000A0JH15 / RCB6P6 RAIF.CENTRO. CALL12 AZ2   |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| ALTER SALDO  |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
|  |           |          |          |           |         |         |         |        |         | ST          | 0,000         |               |           |           |      |
| NEUER SALDO  |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| KEINE UMSAETZE SEIT DEM 25.09.2016                         |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |

### 4.3.4. Depottagesauszug

In diesem Report wird im Feld „SET-ART“ der Batch Zyklus angegeben, in dem eine Instruktion abgewickelt wurde. Da die Abwicklung mit der Migration in Welle 3 nicht mehr den CBF Batches sondern dem T2S Geschäftstag folgt, wird dieses Feld mit diesem Release im November 2015 durch das neue Feld MB\_ÜBERG (Mitbesitz-Übergang) ersetzt, das den Buchungszeitstempel (Uhrzeit) angibt.

| DEPOTBUCH PERSOENLICH VOM 01.10. BIS 31.10.2016            |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
|--|-----------|----------|----------|-----------|---------|---------|---------|--------|---------|-------------|---------------|---------------|-----------|-----------|------|
| KONTO-NR: 1/234/000 TESTBANK AG                            |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| T2S SAC : DAKV1234000                                      |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| ISIN / WKN DE000LBB11H0 / LBB11H LBB BAER INDEX 12T 17 DAX |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| BUCH-  | MB-       | SET-DAY  | SCHLUSST | LASTKTO   |         | GUTKTO  |         | AUFTR. |         | EING        |               |               |           |           |      |
|  |           |          | TAG      | ÜBERG     | LASTKTO |         | NIEDERL | GUTKTO | NIEDERL | AA          | BS            | GES-NR        | EIN       | NOMINALE  |      |
| WRG  | GEGENWERT |          | MAKL     | BEMERKUNG |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| ALTER SALDO  |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| 05.10  | 19:35     | 05.10.16 | 03.10.16 | 1234000   | 5678000 | 10      | 41      | 94     | ST      | 993.113,000 |               |               |           |           |      |
|  |           |          |          |           |         |         |         |        |         | 10,000-EUR  |               | 507,70        | 5678      |           |      |
| 07.10  | 19:38     | 07.10.16 | 05.10.16 | 1234000   | 5678001 | 5678099 | 10      | 41     | 9015764 | ST          | 400,000-EUR   |               | 20.456,00 | 5678      |      |
| 06.10  | 20:22     | 06.10.16 | 05.10.16 | 5678000   | 1234000 |         | 10      | 41     | 9033423 | ST          | 1.200,000     | EUR           | 61.116,00 | 1234      |      |
| 13.10  | 20:22     | 13.10.16 | 11.10.16 | 1234000   | 7999000 |         | 10      | 41     | 9025768 | ST          | 1.200,000-EUR |               | 60.648,00 | 5678      |      |
| 14.10  | 19:40     | 14.10.16 | 13.10.16 | 1234000   | 3456000 |         | 10      | 41     | 9017696 | ST          | 1.500,000-EUR |               | 73.995,00 | 1234      |      |
| 24.10  | 20:13     | 24.10.16 | 21.10.16 | 1234000   | 5678000 | 5678099 | 10      | 41     | 9031307 | ST          | 13,000-EUR    |               | 629,33    | 5678      |      |
| 26.10  | 20:36     | 26.10.16 | 24.10.16 | 5678000   | 5678000 | 5678099 | 10      | 41     | 1000712 | ST          | 13,000        | EUR           | 640,12    | 1234      |      |
| 26.10  | 20:36     | 26.10.16 | 24.10.16 | 3456000   | 1234000 |         | 10      | 41     | 9029507 | ST          | 1.500,000     | EUR           | 74.550,00 | 2345      |      |
| 28.10  | 19:36     | 28.10.16 | 25.10.16 | 1234000   | 1234008 | 5678000 | 5678012 | 10     | 41      | 1001665     | ST            | 1.225,000-EUR |           | 59.951,50 | 3456 |
| NEUER SALDO  |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
|  |           |          |          |           |         |         |         |        |         | 991.478,000 |               |               |           |           |      |
| ISIN / WKN AT0000A0JH15 / RCB6P6 RAIF.CENTRO. CALL12 AZ2   |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| ALTER SALDO  |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
|  |           |          |          |           |         |         |         |        |         | ST          | 0,000         |               |           |           |      |
| NEUER SALDO  |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |
| KEINE UMSAETZE SEIT DEM 25.09.2016                         |           |          |          |           |         |         |         |        |         |             |               |               |           |           |      |







Die geänderte Hilfe-Maske zeigt die folgenden Bemerkungen, die neuen Einträge sind in rot markiert:

```

----- ANZEIGE DER BEMERKUNGEN UND IHRE ERLAEUTERUNGEN -----
AS - AUFGABENSCHLIESSUNG          AU - AUFGABE
AW - AUFGABENWEITERGABE          DP - DISPOSITIONS-PRIORITAET GEAENDERT
FW - FREMDWAHRUNG                KO - KOMPENSATION
LB - LOESCHUNG DURCH BEIDE KONTRAHENT.  LC - LOESCHUNG DURCH CBF
LG - LOESCHUNG DURCH CBF VOM VORTAG  LI - LINKED
LK - LOESCHUNG DURCH KAEUFER      LS - LOESCHUNG DURCH T2S
LT - LOESCHUNG DURCH BEIDE VOM VORTAG  LV - LOESCHUNG DURCH VERKAEUFER
ME - MAKLER ERHEBT                MU - MAKLER UEBERWEIST
OD - OHNE DECKUNG STUECKE        OG - GELD NICHT BEREITGESTELLT
PI - PART.SETTL.INDICATOR GEAENDERT  PP - TEILWEISE OFFEN
RJ - ABGELEHNT                       RQ - BEANTRAGT
R3 - REG S, KATEGORIE 3          SA - SONDRPRO-AENDERUNG (CORP. ACTIONS)
SP - GATTUNGSSPERRE              ST - LIEFERPOSITION STORNIERT
SZ - ZUSATZRECHT EINGERICHTET    TB - TEILBELIEFERUNG
VE - EMISSIONS-VALUTA            VZ - VALUTA ZUG-UM-ZUG
XE - XETRA-GESCHAEFT            ZR - GESCHAEFT ALS ZUSATZRECHT EINGER.
-                                  -
-- ID-KZ: 7999690042 - PW:      ----- B79075MO - 30/03/15 - 14:41:35 -
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch

```

Wird die Löschung eines LION Geschäftes aus KADI im Zuge eines Transformationsprozesses initiiert, so wird die Bemerkung LC "Loeschung durch CBF" angefügt, statt wie bisher LB "Loeschung durch beide Kontrahenten". Am folgenden Geschäftstag wird die Bemerkung LC geändert auf LG "Loeschung durch CBF vom Vortag".

## 4.5 Connectivity

### 4.5.1. Zusätzliche Felder in der Client Connectivity

Mit diesem Release werden die folgenden Felder in der ausgehenden und eingehenden Kundenkommunikation für den Wertpapierauftrag in Auftragsart AA01 / AA02 W im automatisierten Nachrichtenverkehr (SWIFT, MQ Series und File Transfer) unterstützt:

- OPT-OUT Kennzeichen im Feld :22F::STCO//NOMC
- CCPN / XCPN Kennzeichen im Feld :22F::TTCO  
Das Kennzeichen SPEX wird nur noch bis zur Migration in Welle 3 genutzt und anschließend nicht mehr weiter unterstützt. Das Kennzeichen SPEX wird von bereits nach T2S migrierten Märkten nicht mehr unterstützt. Dadurch verhindert die Eingabe SPEX in diesen Märkten das Matching, siehe auch Kapitel 4.2.3.
- Partial Settlement Indicator in einem der folgenden Felder:

| Bemerkung              | Beschreibung                                      |
|------------------------|---|
| :22F::STCO//NPAR       | Kein Partial Settlement                           |
| :22F::STCO//PART       | Partial Settlement                                |
| :22F::STCO//COEX//PARQ | Partial Settlement mit minimalem Wertpapierbetrag |
| :22F::STCO//COEX//PARC | Partial Settlement mit minimalem Geldgegenwert    |

- ISO Transaction Code im Feld :22F::SETR

Für Cross-border Instruktionen wird so ermöglicht, dass beispielsweise auch die Felder belegt werden können, die in T2S Match-Kriterien sind.



#### 4.5.2. Erweiterte Status Information in MT548 und MT537

Mit dem November Release wird CBF das derzeitige Status Reporting in der Sequenz „Repetitive Subsequence A2 Status“ im Nachrichtentyp MT548 („Business Validation Feedback und Lifecycle Information“) und in der Sequenz „Repetitive Subsequence C3 Status“ im Nachrichtentyp M537 („Statement of Pending Transactions“) erweitern. Die Änderung gilt für die matchpflichtigen Auftragsarten AA01 / AA02 und kommt in den Statusnachrichten der CASCADE Matching und Processing Informationen zum Tragen. Die Nutzung der weiteren Sequenz durch unsere Kunden ist optional, wenn derzeit durch den Kunden die Statusinformationen ausschließlich aus der Sequenz 1 verarbeitet werden. Durch die Implementierung der weiteren Sequenz, wird Information, die derzeit in der Sequenz 2 ausgegeben wird, in die Sequenz 3 verlagert.

Auch zukünftig wird in der Sequenz 1 der Auftragszustand ausgegeben. Wie bisher steht die Information zum CASCADE Auftragsstatus im Feld :70D::REAS (beispielsweise mit „MATS“, „SETS“ oder „PROS“) zur Verfügung. Ebenso ist das heutige Reporting zur Löschung von Aufträgen („Cancellation Reporting“) von dieser Änderung nicht betroffen. Weiterhin ist gewährleistet, dass der bisherige Nachrichtenfluss und die vom Kunden eingerichtete Konfiguration der Nachrichten hiervon unberührt bleiben. Im Detail bedeutet dies im Vergleich zu heute, dass durch die Änderung des Formats mit der Einführung einer weiteren Sequenz, keine zusätzlichen Nachrichten übermittelt werden oder Nachrichten entfallen.

Mit der Erweiterung der Statussequenz bietet CBF vielmehr den Kunden die Möglichkeit, den von CBF aktuell ermittelten Auftragszustand als Auftragsstatus im standardisierten ISO 15022 Format zu beziehen. Der von CBF gewählte Implementierungsansatz wird über die Migration der T2S Wellen 3 und 4 bestehen bleiben. Erst mit einem weiteren CBF Release nach der T2S Welle 4 wird die Umsetzung der Statussequenzen für die Nachrichtentypen MT548 und MT537 für alle unsere Kunden verpflichtend.

| Instruktionsstatus |   |   |  |   |
|--------------------|---|---|--|---|
| Relevant für MT    | 548 und 537   | Nur 548   | 548 und 537  |   |
| Sequenz            | Nicht gematcht  | Neu gematcht  | Gematcht und schwebend <sup>a</sup>                  | Auswirkungen auf den Kunden   |
| 1 <sup>b</sup>     | MTCH//NMAT  | MTCH//MACH  | Party Hold oder Settlement Failure Status            | Keine Veränderung zur derzeitigen Verarbeitung  |
| 2                  | Party Hold Status   | Party Hold oder Settlement Failure Status                               | Löschanfrage vorhanden (Cancellation Pending Status) | Einführung der Sequenz 2; optionale Nutzung   |
| 3                  | Optional, nur wenn Löschanfrage vorhanden (Cancellation Pending Status) | Optional, nur wenn Löschanfrage vorhanden (Cancellation Pending Status) | Kommt nicht zur Anwendung                            | Durch die Einführung der Sequenz 2 kann bei heutiger Nutzung dieser Sequenz ein Anpassungsbedarf möglich sein |

a. Kommt auch zur Anwendung bei den nicht-matchpflichtigen Auftragsarten AA03 sowie AA16 / AA18.

b. In unseren Produkten „Business Validation Feedback (BVF)“ und in der Cancellation (Status) Information wird stets nur die Sequenz 1 ausgegeben.

Die nachstehenden Tabellen zeigen den Vergleich des heutigen und zukünftigen Formats der Nachrichtentypen der zuvor beschriebenen Instruktionstypen:

- a) Der Auftrag ist nicht gematcht und der Status zum Party Hold wird ausgegeben:  
 Beispiel für: Erste Statusmeldung, Änderung des Hold Status oder Matchfehler

| IST-Situation: MT548               |            |                         |  |
|------------------------------------|------------|-------------------------|--|
| <u>Sequence 1:</u>                 |            |                         |  |
| 25D:                               | MTCH//NMAT |                         |  |
| 24B:                               | NMAT//XXXX | XXXX=CMIS, match errors |  |
| <u>Sequence 2 (if applicable):</u> |            |                         |  |
| 25D:                               | IPRC//CANP |                         |  |
| 24B:                               | CANP//CONF |                         |  |

| IST-Situation: MT537               |            |                           |  |
|------------------------------------|------------|---------------------------|--|
| <u>Sequence 1:</u>                 |            |                           |  |
| 25D:                               | MTCH//NMAT |                           |  |
| 24B:                               | NMAT//XXXX | XXXX = CMIS, match errors |  |
| <u>Sequence 2 (if applicable):</u> |            |                           |  |
| 25D:                               | IPRC//CANP |                           |  |
| 24B:                               | CANP//CONF |                           |  |

| Änderung mit dem November Release 2015: MT548 |            |                         |  |
|---|------------|-------------------------|--|
| <u>Sequence 1:</u>                            |            |                         |  |
| 25D:  | MTCH//NMAT |                         |  |
| 24B:  | NMAT//XXXX | XXXX=CMIS, match errors |  |
| <u>Sequence 2:</u>                            |            |                         |  |
| 25D:  | SETT//PEND |                         |  |
| 24B:  | PEND//XXXX | XXXX = PREA, FUTU       |  |
| <u>Sequence 3 (if applicable):</u>            |            |                         |  |
| 25D:  | IPRC//CANP |                         |  |
| 24B:  | CANP//CONF |                         |  |

| Änderung mit dem November Release 2015: MT537 |            |                           |  |
|---|------------|---------------------------|--|
| <u>Sequence 1:</u>                            |            |                           |  |
| 25D:  | MTCH//NMAT |                           |  |
| 24B:  | NMAT//XXXX | XXXX = CMIS, match errors |  |
| <u>Sequence 2:</u>                            |            |                           |  |
| 25D:  | SETT//PEND |                           |  |
| 24B:  | PEND//XXXX | XXXX = PREA, FUTU         |  |
| <u>Sequence 3 (if applicable):</u>            |            |                           |  |
| 25D:  | IPRC//CANP |                           |  |
| 24B:  | CANP//CONF |                           |  |

- b) Der Auftrag ist gematcht und schwebend:

| IST-Situation: MT548                          |            |                               |  |
|---|------------|-------------------------------|--|
| <u>Sequence 1:</u>                            |            |                               |  |
| 25D:  | SETT//PEND |                               |  |
| 24B:  | PEND//XXXX | XXXX = PRCY, PREA, BOTH, FUTU |  |
| <u>Sequence 2 (if applicable): <b>[1]</b></u> |            |                               |  |

| IST-Situation: MT537                          |            |  |  |
|---|------------|--|--|
| <u>Sequence 1:</u>                            |            |  |  |
| 25D:  | SETT//PEND |  |  |
| 24B:  | PEND//XXXX | XXXX = PRCY, PREA,<br>BOTH, FUTU, LACK, MONY |  |
| <u>Sequence 2 (if applicable): <b>[1]</b></u> |            |  |  |

| Änderung mit dem November Release 2015: MT548 |            |                               |  |
|---|------------|-------------------------------|--|
| <u>Sequence 1:</u>                            |            |                               |  |
| 25D:  | SETT//PEND |                               |  |
| 24B:  | PEND//XXXX | XXXX = PRCY, PREA, BOTH, FUTU |  |
| <u>Sequence 2 (if applicable): <b>[1]</b></u> |            |                               |  |

| Änderung mit dem November Release 2015: MT537 |            |  |  |
|---|------------|--|--|
| <u>Sequence 1:</u>                            |            |  |  |
| 25D:  | SETT//PEND |  |  |
| 24B:  | PEND//XXXX | XXXX = PRCY, PREA,<br>BOTH, FUTU, LACK, MONY |  |
| <u>Sequence 2 (if applicable): <b>[1]</b></u> |            |  |  |

(1) Mögliche Ausprägungen:

|                 |                           |
|-----------------|---------------------------|
| :25D:           | IPRC//CPRC                |
| :25D: und :24B: | IPRC//CANP und CANP//CONF |
| :25D:           | IPRC//CANP                |

c) Auftrag wurde neu gemacht und Information zum Party Hold:

| IST-Situation: MT548               |            |  |  |
|------------------------------------|------------|--|--|
| <b>Sequence 1:</b>                 |            |  |  |
| 25D:                               | MTCH//MACH |  |  |
| 24B:                               | -          |  |  |
| <b>Sequence 2 (if applicable):</b> |            |  |  |
| 25D:                               | IPRC//CANP |  |  |
| 24B:                               | CANP//CONF |  |  |



| Änderung mit dem November Release 2015: MT548 |            |                               |  |
|---|------------|-------------------------------|--|
| <b>Sequence 1:</b>                            |            |                               |  |
| 25D:  | MTCH//MACH |                               |  |
| 24B:  | -          |                               |  |
| <b>Sequence 2:</b>                            |            |                               |  |
| 25D:  | SETT//PEND |                               |  |
| 24B:  | PEND//XXXX | XXXX = PRCY, PREA, BOTH, FUTU |  |
| <b>Sequence 3 (if applicable):</b>            |            |                               |  |
| 25D:  | IPRC//CANP |                               |  |
| 24B:  | CANP//CONF |                               |  |

Das folgende Beispiel zeigt eines MT548 für das oben benannte Scenario c)

Die Statussequenzen sind blau markiert:

| Message Fields and Contents                  |
|--|
| {1: F01XXXXDEFFBXXX0000001046}               |
| {2: I548DAKVDEFFADOMN}                       |
| {4:  |
| :16R: GENL                                   |
| :20C: :SEME//C54M093417423410                |
| :23G: INST                                   |
| :98C: :PREP//20150422093417                  |
| :16R: LINK                                   |
| :20C: :RELA//NONREF                          |
| :16S: LINK                                   |
| :16R: LINK                                   |
| :20C: :TRRF//KT79070200106100                |
| :16S: LINK                                   |
| :16R: STAT                                   |
| :25D: :MTCH//MACH                            |
| :16S: STAT                                   |
| :16R: STAT                                   |
| :25D: :SETT//PEND                            |
| :16R: REAS                                   |
| :24B: :PEND//FUTU                            |
| :70D: :REAS///SETS 000/MATS 002/PROS 100     |
| :16S: REAS                                   |
| :16S: STAT                                   |
| :16S: GENL                                   |
| :16R: SETTRAN                                |
| :35B: ISIN DE000GSW1111<br>GSW IMMOBILIEN AG |

| Message Fields and Contents   |
|-------------------------------|
| :36B: :SETT//UNIT/463,        |
| :97A: :SAFE//98760000         |
| :22F: :SETR//TRAD             |
| :22H: :REDE//RECE             |
| :22H: :PAYM//FREE             |
| :22F: :RTGS//NRTG             |
| :98A: :SETT//20150422         |
| :98A: :TRAD//20150422         |
| :16R: SETPRTY                 |
| :95P: :DEAG//TESTBICFXXX      |
| :97A: :SAFE//44440000         |
| :20C: :PROC//KT44440185285910 |
| :16S: SETPRTY                 |
| :16R: SETPRTY                 |
| :95P: :PSET//DAKVDEFFXXX      |
| :16S: SETPRTY                 |
| :16R: SETPRTY                 |
| :95P: :REAG//TESTDEFFXXX      |
| :97A: :SAFE//99990000         |
| :16S: SETPRTY                 |
| :16S: SETTRAN                 |
| -}                            |

Neben den vorbenannten Änderungen wird CBF das Reporting für gemachte Aufträge anpassen, wenn am Intended Settlement Date (ISD) die Abwicklung nicht durchgeführt werden konnte. Bisher erhalten unsere Kunden in der Sequenz „Optional Repetitive Subsequence A2a Reason“ die Information mittels der Ausprägung „PENF“ (Pending / Failing Reason). Zukünftig wird in allen Fällen ein „PEND“ (Pending Reason) anstelle eines „PENF“ gesendet.

#### 4.6 Änderungen bei den Endfälligkeiten dänischer Anleihen

In Vorbereitung auf T2S passt VP Securities das aktuelle Modell für Endfälligkeiten/Teilfälligkeiten an, um eine Harmonisierung mit dem europäischen Gesamtmarkt zu erreichen. Der nach heutigem Modell am Beginn der Verlosungsperiode, im Zeitraum von 4 ½ bis 1 ½ Monaten vor Fälligkeit liegende Stichtag wird hierzu auf das Ende der Verlosungsperiode gezogen.

Die Bekanntgabe der finalen Verlosungsrate erfolgt im Laufe des Record Tag. Diese Änderungen ergehen für alle Anleihen mit Fälligkeitstag nach dem 21. September 2015. Der erste Veröffentlichungstermin der betroffenen Anleihen ist der 22. Mai 2015.

## 5. Anhang

### 5.1 KUSTA Datenträger – Format

#### 5.1.1. KUSTA Datenträger – CBF Kunden

| Field no. | Field name            | Beschreibung   | Description  | Format |
|-----------|-----------------------|--|--|--------|
| 1         | Satztyp               | Kennzeichen, ob es sich um den Datensatz für „CBF Inland“ – Kontoinhaber handelt   | Indicator, whether this data set contains information about a „CBF Inland“ (domestic) account owner  | N(3)   |
| 2         | Status                | Kennzeichen, ob es sich bei dem gesendeten Satz um eine Änderung, einen Zugang oder eine Löschung handelt / Übertragung des vollständigen Bestandes erfolgt immer als Zugang | Indicator, whether this data set provides information on a modification, deletion or new account / if a full file is provided the indicator refers always to a new account | A(1)   |
| 3         | CBF-ID                | CBF-Nummer/Banknummer<br>Ortskennzeichen N(3)<br>Hauptkonto-Nr. N(5)<br>Bsp. CBF-ID: 7002 → 00700002   | CBF number / bank number<br>Location N(3)<br>Main account number N(5)<br>For example CBF-ID: 7002 → 00700002   | N(8)   |
| 4         | Veröffentlichung      | Kennzeichen, welche Daten enthalten sind<br>Grunddaten (Name, Ort und Börsenplatz)<br>Gesamtdaten (Alle Felder, soweit vorhanden, werden gefüllt)                            | Indicator, which data is provided<br>Basic information (name, city, place of stock exchange)<br>Entire information (all fields will be provided, if available)             | N(1)   |
| 5         | Name                  |  | Name   | A(35)  |
| 6         | Name Fortsetzung      | Ggf. Fortsetzung des Namens  | Name - continuation if necessary   | A(35)  |
| 7         | Ort                   |  | City   | A(30)  |
| 8         | Börsenplatz           | Börsenplatz der CBF-ID   | Place of Stock Exchange indicated by CBF-ID  | N(3)   |
| 9         | AWV-Gebiet            |  | German foreign trade regulations – Area  | N(3)   |
| 10        | AWV-Land              |  | German foreign trade regulations – Country   | N(5)   |
| 11        | Kontengruppe          |  | Account group  | N(3)   |
| 12        | Strasse               |  | Street   | A(30)  |
| 13        | Postfach              |  | P.O. Box   | A(10)  |
| 14        | Postleitzahl Strasse  |  | Postal Code Street   | A(5)   |
| 15        | Postleitzahl Postfach |  | Postal Code P.O. Box   | A(5)   |
| 16        | Postleitzahl          |  | Postal Code Key Account  | A(5)   |

| Field no. | Field name         | Beschreibung   | Description  | Format |
|-----------|--------------------|--|--|--------|
|           | Großkunde          |  |  |        |
| 17        | Telefon            |  | Telephone  | A(20)  |
| 18        | Telefax-Nummer     |  | Fax  | A(20)  |
| 19        | SWIFT-Adresse      |  | SWIFT Address  | A(12)  |
| 20        | Börsen-Teilnehmer  |  | Stock Exchange Participant   | N(3)   |
| 21        | Auslandsteilnehmer |  | Foreign Participant  | N(3)   |
| 22        | EUREX-Teilnehmer   |  | EUREX Participants   | N(3)   |
| 23        | Buchungsart        |  | Posting Type   | N(3)   |
| 24        | CBF-Verrechnung    | 11-stelliger BIC   | BIC11 for CBF Clearing   | A(11)  |
| 25        | Bankleitzahl       |  | Bank Code Number   | N(8)   |
| 26        | BIC-RTS            | 11-stelliger BIC   | BIC11 for RTS  | A(11)  |
| 27        | Reg-Ueber          | CBF-ID der Clearing Zentrale<br>Ortskennzeichen N(3)<br>Hauptkonto-Nr. N(5)<br>Bsp. CBF-ID: 7002 → 00700002  | Third Party Head Office<br>Location N(3)<br>Main account number N(5)<br>For example CBF-ID: 7002 →<br>00700002                             | N(8)   |
| 28        | T2S Relevant       | Kennzeichen, ob es sich um einen<br>Kontostamm handelt, der in T2S<br>abgebildet wird. Ausprägungen<br>J (ja)<br>N (nein)<br>NK (nur Konto, nur Securities<br>Account (SAC)) | Indicator, whether the account<br>master will be mapped to T2S<br>J (yes)<br>N (no)<br>NK (account only; only Securities<br>Account (SAC)) | A(2)   |
| 29        | T2S Party BIC      | 11-stelliger BIC   | BIC 11 provided for processing at<br>T2S   | A(11)  |
| 30        | Filler             |  |  | A(26)  |

### 5.1.2. KUSTA Datenträger – Markt

| Field no. | Field name            | Beschreibung  | Description   | Format |
|-----------|-----------------------|---|---|--------|
| 1         | Satztyp               | Kennzeichen, ob es sich um den Datensatz der Teilnehmerkonten des ausländischen Markts handelt  | Indicator, whether this data set contains information about a participant of a foreign market   | N(3)   |
| 2         | Status                | Kennzeichen, ob es sich bei dem gesendeten Satz um eine Änderung, einen Zugang oder eine Löschung handelt / Übertragung des vollständigen Bestandes erfolgt immer als Zugang. | Indicator, whether this data set provides information on a modification, deletion or new account / if a full file is provided the indicator refers always to a new account. | A(1)   |
| 3         | Markt                 | Markt-Code des Clearing Partners bei CBF  | Market code of clearing partner at CBF  | N(3)   |
| 4         | Ausländische Kontonr. | Ausländische Kontonr.   | Foreign account number  | A(35)  |
| 5         | Name Kurzform         | Kurzform des Namens   | Name – short name   | A(35)  |
| 6         | Name aktuell          | Vollständiger Name  | Name – long name  | A(35)  |
| 7         | Name Fortsetzung      | Ggf. Fortsetzung des Namens   | Name – continuation if necessary  | A(35)  |
| 8         | Name Zusatz           | Ggf. Namenszusatz   | Name – add on   | A(35)  |
| 9         | Strasse               |   | Street  | A(30)  |
| 10        | Länderkennzeichen     |   | Country Code  | A(3)   |
| 11        | Postleitzahl          |   | Postal Code   | A(5)   |
| 12        | Ort                   |   | City  | A(30)  |
| 13        | Kontotyp              |   | Account type  | N(3)   |
| 14        | CBF-ID                |   | CBF-ID  | A(8)   |
| 15        | SWIFT-Adresse         | CBF-Nummer/Banknummer<br>Ortskennzeichen N(3)<br>Hauptkonto-Nr. N(5)<br>Bsp. CBF-ID: 7002 → 00700002  | SWIFT Address / CBF-Number<br>Location N(3)<br>Main account number N(5)<br>For example CBF-ID: 7002 → 00700002  | A(12)  |
| 16        | Filler                |   |   | A(62)  |

## 5.2 ISO Transaction Codes

Anbei die von T2S genutzten und von CBF unterstützten ISO Transaction Codes.

| ISO Transaction Codes | Beschreibung   |
|-----------------------|--|
| BSBK                  | Buy sell back transaction  |
| CNCB <sup>a</sup>     | Collateral delivery/receipt to a national central bank for central bank credit operations  |
| COLI                  | Collateral transaction, from the point of view of the collateral taker or its agent  |
| COLO                  | Collateral transaction, from the point of view of the collateral giver or its agent  |
| ETFT                  | ETF creation or redemption   |
| FCTA                  | Factor update  |
| INSP                  | Movement of shares into or out of a pooled account   |
| MKDW                  | Decrease of positions held by an International Central Securities Depository (ICSD) at the common depository due to custody operations (repurchase, pre-release, proceed of corp. event realigned)     |
| MKUP                  | Increase of positions held by an International Central Securities Depository (ICSD) at the common depository due to custody operations (repurchase, pre-release, proceed of corporate event realigned) |
| NETT                  | Netting of settlement instructions   |
| NSYN                  | Relates to the issue of medium and short term paper (CP, CD, MTN, notes etc.) under a program and without syndication arrangement.   |
| OWNE                  | Account transfer involving more than one instructing party (messages sender) and/or account servicer (messages receiver)   |
| OWNI                  | Account transfer involving one instructing party (messages sender) at one account servicer (messages receiver)   |
| PAIR                  | Pair-off: The transaction is paired off and netted against one or more previous transactions.  |
| PLAC                  | Placement/new issue of a financial instrument  |
| REDM                  | Redemption of funds (funds industry only)  |
| RELE                  | Release (into/from local) of depository receipt operation  |
| REPU                  | Repurchase agreement transaction   |
| RODE                  | Return of financial instruments resulting from a rejected delivery without matching operation  |
| RVPO                  | Reverse repurchase agreement transaction   |
| SBBK                  | Sell buy back transaction  |
| SECB                  | Securities borrowing operation   |
| SECL                  | Securities lending operation   |
| SUBS                  | Subscription to funds (funds industry only)  |
| SYND                  | Issue of financial instruments through a syndicate of underwriters and a lead manager  |
| TBAC                  | To Be Announced [TBA] closing trade  |
| TRAD                  | Settlement of a trade  |
| TRPO                  | Tri-party repurchase agreement   |
| TRVO                  | Tri-party reverse repurchase agreement   |
| TURN                  | Turnaround: The same security is bought and sold to settle the same day, to or from different brokers.   |

- a. This code is dedicated to the use by central banks.