

SWIFT & Connectivity: Änderungen im November 2015

Clearstream Banking Frankfurt¹ stellt in dieser Kundeninformation die geplanten Änderungen im Zusammenhang mit dem SWIFT Standard Release 2015 vor. Diese geplanten Änderungen werden mit Wirkung zum 23. November 2015 eingeführt.

Die im vorliegenden Dokument zusammengefassten Änderungen beziehen sich auf folgende Bereiche:

- SWIFT Standard Release
- CBF Connectivity
- Implementierungen im Rahmen der Securities Markets Practice Groups (SMPG)
- Vereinheitlichung der verschiedenen Nachrichtentypen.

Jedes Jahr veröffentlicht SWIFT Spezifikationen für die verschiedenen ISO[°] 15022 Nachrichtentypen. Diese geänderten bzw. erweiterten Spezifikationen beziehen sich auf die Anforderungen der National Market Practice Groups (NMPGs) und der SMPGs.

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 2015 werden die nachfolgend beschriebenen Änderungen von CBF umgesetzt.

Diese Änderungen gelten für Nachrichten im ISO 15022 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 und Settlement Services
- Custody Services

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

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.

1. Clearing und Settlement Services

Aufgrund vorbereitender Maßnahmen für TARGET2-Securities (T2S) für Welle 3 wird es Änderungen in der Kundenkommunikation im Bereich der Clearing und Settlement Services geben. Diese wurden bereits in der Kundeninformation [CBF Release im November 2015: Vorankündigung der Änderungen](#) im Juni 2015 veröffentlicht und werden hier nicht noch einmal erläutert.

2. Custody Services

In diesem Kapitel sind die Änderungen für den CBF Custody Service, die ab dem 23. November 2015 eingeführt werden, zusammengefasst. Die SWIFT-Nachrichten MT564/566/568 sind optionale Services und können durch den Kunden über die [Bestellformulare Nr. 83A/B](#) beantragt werden.

Die nachfolgend beschriebenen Änderungen in den SWIFT MT564 und MT566 Nachrichtenformaten erfolgen aufgrund fortlaufender Anpassungen der CBF Custody Services an die National Market Practice (NMPGs) und International Market Practice (SMPG) und beinhalten die folgenden Schwerpunkte:

- Anpassungen in den Optionen (E-Sequenzen) des MT564 zu Kapitalmaßnahmen, zu denen die CBF Weisungen ihrer Kunden erwartet (TA280 mit 22F::CAMV//CHOS) oder Kunden Weisungen erteilen können (TA280 mit 22F::CAMV//VOLU). Diese Anpassungen sind vom Kunden künftig dann auch bei Weisungserteilungen mittels MT565 zu beachten.
- Neuaufnahme des Indikators 22F::DISF zur Information über die Verarbeitung von Bruchstücken bei TA280 CHOS Events auf Basis von Interim-Gattungen
- Verlinkung von MT564 Nachrichten aus unterschiedlichen Abwicklungsprozessen (mit unterschiedlichen Corporate Action Referenzen), die dem gleichen Vorgang (Event) zuzuordnen sind
- Anzeige einer zusätzlichen E1-Subsequenz innerhalb der Cash-Option einer MT564 Income-Notifikation, falls mit der Barausschüttung auch eine Ausbuchung des zugrundeliegenden Wertpapiers erfolgt

2.1 MT564 Corporate Action Notification

2.1.1 Income Events (Erträge und Rückzahlungen)

Aufnahme einer zusätzlichen E1-SECMOVE-Sequenz zur Ankündigung der Ausbuchung des zugrundeliegenden Wertpapiers

Zukünftig wird bei solchen Erträgen und Rückzahlungen, bei denen die Geldgutschrift mit einer Ausbuchung des zugrundeliegenden Wertpapiers erfolgt, im MT564 durch eine zusätzliche E1-Secmove-Sequenz innerhalb der Cash-Option die Ausbuchung der Stücke avisiert. Die nachfolgenden KADI-Terminarten sind hiervon betroffen:

- TA120 DVOP – Auszahlungen auf Basis der Cash Line innerhalb einer Deutschen Wahldividende
- TA122 EXWA – Auszahlungen aufgrund von Ausübungen zu Optionsscheinen
- TA123 TEND – Auszahlungen aufgrund eines Squeeze Out
- TA124 EXOF – Abfindung oder Rückkauf von Aktien
- TA130 REDM / MCAL – Rückzahlungen zu Anleihen
- TA131 REDM / MCAL – Rückzahlungen zu Genussrechten
- TA132 REDM / MCAL – Rückzahlungen zu Zertifikaten
- TA133 LIQU – Liquidation von Fonds
- TA140 PCAL – Teilrückzahlungen mit Änderung des Nennwertes

Die nachfolgende Tabelle beschreibt das künftige Nachrichtenformat für den MT564 Income. Die zum November 2015 geplanten Änderungen und Erweiterungen sind darin hervorgehoben.

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

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	
22F	M	Mandatory/Voluntary Indicator	:CAMV//MAND	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	
25D	M	Processing Status	:PROC//4!c	

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]	

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

Repetitive Mandatory Subsequence B2 Account Information

16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	
93B	O	Total Eligible for CA	:ELIG//4!c/15d	
93B	O	Settlement Position	:SETT//4!c/15d	
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
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	
98C	0	Deadline for Tax Breakdown Instructions	:TAXB//8!n6!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	
92A	0	Reinvestment Discount Rate to Market	:RDIS//[N]15d	
36B	0	Minimum Quantity Sought	:QTSO//4!c/15d	
17B	0	Certification Flag	:CERT//Y	
22F	0	Additional Business Process Indicator	:ADDB//4!c	
22F	0	Offer Type Indicator	:OFFE//SQUE	
16S	M	End of Block	CADETL	

End of Sequence D Corporate Action Details

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	

Zusätzliche Subsequenz "E1 Securities Movement" zur Anzeige der Ausbuchung des der Ausschüttung zugrundeliegenden Wertpapiers

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	Debit – Das Wertpapier wird ausgebucht.
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	ISIN des auszubuchenden Wertpapiers = (35B ISIN in Sequenz B)
98A	M	Payment Date	:PAYD//8!n	Datum der Ausbuchung
98A	0	Last Trading Date	:LTRD//8!n	Letzter Handelstag des Wertpapiers – Anzeige nur bei den KADI-Terminarten TA122, TA123 und TA124.
16S	M	End of Block	SECMOVE	
End of Subsequence E1 Securities Movement				

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
97A	0	Cash Account	:CASH//35x	

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
19B	M	Entitled Amount	:ENTL//3!a15d	
19B	0	Gross Amount	:GRSS//3!a15d	
19B	0	Withholding Tax Amount	:TAXR//3!a15d	
19B	0	Withholding of Foreign Tax	:WITF//3!a15d	
19B	0	Additional Tax	:ATAX//3!a15d	
98A	M	Payment Date	:PAYD//8!n	
98A, B	M	Value Date	:VALU//8!n :VALU//UKWN	
92F	0	Gross Dividend Rate	:GRSS//3!a15d	
92J	0	Proportional Disbursement of Dividend - Domestic DE	:GRSS//INCO/3! a15d/ACTU	
92J	0	Proportional Disbursement of Interest	:GRSS//INTR/3! a15d/ACTU	
92J	0	Proportional Disbursement of Dividend - Abroad	:GRSS//SOIC/3! a15d/ACTU	
92J	0	Proportional Disbursement of Dividend - Real Estate	:GRSS//REES/3! a15d/ACTU	
92J	0	Tax Related Rate	:TAXE//WITL/3! a15d/ACTU	
92J	0	Taxable Portion	:GRSS//TXBL/3! a15d/ACTU	
92J	0	Tax Free Portion	:GRSS//TXFR/3! a15d/ACTU	
92A	0	Withholding of Tax Amount	:TAXR//[N]15d	
92A	0	Withholding of Foreign Tax	:WITF//[N]15d	
92A	0	Additional Tax	:ATAX//[N]15d	
92A	0	Applicable Rate	:RATE//[N]15d	
92A or 92F	0	Interest Rate Used for Payment	:INTP//[N]15d :INTP//3!a15d	
90A or 90B	0	Generic Cash Price Received per Product	:OFFR//PRCT/15 d :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	
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	

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

End of Sequence F Additional Information

Änderung des Corporate Action Event Indikators bei der Abwicklung der Barausschüttung im Rahmen von „Gratisaktien oder Bonusaktien, wahlweise in bar“

Die Verarbeitung der Barausschüttung zum Vorgang „Gratisaktien oder Bonusaktien, wahlweise in bar“ erfolgt heute durch die KADI-Terminart TA120 mit dem Corporate Action Event Indikator 22F::CAEV//BONU in der MT564 Notifikation. Künftig wird der CAEV „BONU“ durch „DVOP“ ersetzt.

2.1.2 2-Event Szenario: TA210 RHDl – TA280 EXRI

Im Rahmen des Zwei-Event-Szenarios „Kapitalerhöhung gegen Bareinzahlung“ werden im zweiten Event (TA280 EXRI – Bezugsrechtsangebot) folgende Änderungen vorgenommen:

- Die Option (E-Sequenz) „NOAC“ wird durch „LAPS ersetzt (22F::CAOP//LAPS).
- In der Option (E-Sequenz) „EXER“, Subsequenz E1 „Ausbuchten der Bezugsrechte“ wird das Feld 92D::NEWO entfernt. Das Feld wird weiterhin in der Subsequenz E1 „Einbuchten der bezogenen Wertpapiere“ angezeigt.

Die nachfolgende Tabelle beschreibt das künftige Nachrichtenformat für den MT564 in TA280 EXRI (zweiter Event im 2-Event Szenario TA210 RHDl – TA280 EXRI). Die zum November 2015 geplanten Änderungen und Erweiterungen sind darin hervorgehoben.

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

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//EXRI	
22F	M	Mandatory/Voluntary Indicator	:CAMV//CHOS	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	
25D	M	Processing Status	:PROC//4!c	

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

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
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]	

Repetitive Mandatory Subsequence B2 Account Information

16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	
93B	0	Total Eligible for CA	:ELIG//4!c/[N]15 d	
93B	0	Uninstructed Balance	:UNBA//4!c/[N]1 5d	
93B	0	Instructed Balance	:INBA//4!c/[N]15 d	
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information

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

End of Sequence B Underlying Securities

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (EXER)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	0	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//EXER	
22F	0	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	0	Early Response Deadline Date/Time	:EARD//8!n6!n	
98C	0	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
98C	0	Market Deadline Date/Time	:MKDT//8!n6!n	
69A	0	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
92D	0	New to Old	:NEWO//15d/15 d	Das Feld 92D::NEWO wird aus E1-Debit entfernt.
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
92D	O	New to Old	:NEWO//15d/15d	
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
98A	O	Dividend Ranking Date	:DIVR//8!n	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
97A	O	Cash Account	:CASH//35x	
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
90A, B	O	Generic Cash Price Paid per Product	:PRPP//4!c/15d :PRPP//4!c/3!a1 5d	
16S	M	End of Block	CASHMOVE	

End of Subsequence E2 Cash Movements

70E	O	Additional Text	:ADTX//10*35x	
16S	M	End of Block	CAOPTN	

End of Sequence E Corporate Action Options

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (BUYA)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//BUYA	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
69A	O	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
97A	O	Cash Account	:CASH//35x	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
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

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (SLLE)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//SLLE	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
69A	O	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
97A	O	Cash Account	:CASH//35x	
98AB	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
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

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (OVER)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//OVER	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	O	Early Response Deadline Date/Time	:EARD//8!n6!n	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
98C	0	Market Deadline Date/Time	:MKDT//8!n6!n	
69A	0	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
98B	M	Payment Date	:PAYD//UKWN	
98A	0	Dividend Ranking Date	:DIVR//8!n	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
97A	0	Cash Account	:CASH//35x	
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
90A, B	0	Generic Cash Price Paid per Product	:PRPP//4!c/15d :PRPP//4!c/3!a1 5d	
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

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (LAPS)				Die Option "NOAC" wird durch "LAPS" ersetzt.
16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	0	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//LAPS	LAPS anstatt NOAC
22F	0	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
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	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
98A	M	Payment Date	:PAYD//8!n	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

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

End of Sequence E Corporate Action Options

Optional Sequence F Additional Information

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
16R	M	Start of Block	ADDINFO	
70E	0	Additional Text	:ADTX// 10*35x	
16S	M	End of Block	ADDINFO	

End of Sequence F Additional Information

2.1.3 2-Event Szenario: TA211 BONU/DVSE/PINK/SPLF/SOFF – TA280 EXOF

Im Rahmen des Zwei-Event-Szenarios „Bonusaktien / Gratisaktien / Stock-Split / Spin-Off / Payment-in-Kind-Notes“ mit Ausschüttung von Interim-Stücken werden im zweiten Event (TA280 EXOF –Angebot auf Interim-Stücke) folgende Änderungen vorgenommen:

- In der Option (E-Sequenz) „SECU“ wird das Feld 22F::DISF//RDDN neu aufgenommen. Damit wird den Kunden das Settlement von Bruchstücken avisiert.

SWIFT 22F::DISF-Indikator	Bedeutung
22F::DISF//BUYU	Kauf von Bruchstücken / Spitzen
22F::DISF//CINL	Verkauf von Bruchstücken / Spitzen
22F::DISF//DIST	Verteilung von Bruchstücken / Spitzen
22F::DISF//RDDN	Abrunden
22F::DISF//RDUP	Aufrunden
22F::DISF//UKWN	Unbekannt

- In der Option (E-Sequenz) „SECU“, Subsequenz E1 „Ausbuchen der Interim-Stücke“ wird der Zahlbarkeitstag mit 98B::PAYD//ONGO angezeigt. Das Feld 92D::NEWO wird entfernt. Das Feld wird weiterhin in der Subsequenz E1 „Einbuchen der bezogenen Wertpapiere“ angezeigt.
- In der Option (E-Sequenz) „SECU“, Subsequenz E1 „Einbuchen der bezogenen Wertpapiere“ wird der Zahlbarkeitstag mit 98B::PAYD//ONGO angezeigt.
- Die Option (E-Sequenz) „NOAC“ wird aus der Nachricht entfernt, da die Option „SECU“ immer die Default-Option ist. Hierzu wird in der Option „SECU“ das Default-Flag gesetzt (17B::DFLT//Y).
- Die Option (E-Sequenz) „BUYA“ wird nur bei Handelbarkeit der Interim-Stücke angezeigt.
- Die Option (E-Sequenz) „SLE“ wird grundsätzlich angezeigt.

Die nachfolgende Tabelle beschreibt das künftige Nachrichtenformat für den MT564 in TA280 EXOF (zweiter Event im 2-Event Szenario TA211 BONU/DVSE/PINK/SPLF/SOFF – TA280 EXOF). Die zum November 2015 geplanten Änderungen und Erweiterungen sind darin hervorgehoben.

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

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//EXOF	
22F	M	Mandatory/Voluntary Indicator	:CAMV//CHOS	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	
25D	M	Processing Status	:PROC//4!c	

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]	

Repetitive Mandatory Subsequence B2 Account Information

16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	
93B	O	Total Eligible for CA	:ELIG//4!c/[N]15d	
93B	O	Uninstructed Balance	:UNBA//4!c/[N]15d	
93B	O	Instructed Balance	:INBA//4!c/[N]15d	
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information

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

End of Sequence B Underlying Securities

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (SECU)

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

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
22F	0	Disposition of Fractions Indicator	::DISF//4!c	Aufnahme des Fraction-Indikators. Siehe Erläuterung in der Einführung dieses Kapitels.
22F	0	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//Y	SECU ist die Default-Option.
98C	0	Early Response Deadline Date/Time	:EARD//8!n6!n	
98C	0	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
98C	0	Market Deadline Date/Time	:MKDT//8!n6!n	
69A	0	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
92D	0	New to Old	:NEW0//15d/15d	Das Feld 92D::NEW0 wird aus E1-Debit entfernt.
98B	M	Payment Date	::PAYD//ONGO	Anzeige von ONGO
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
92D	0	New to Old	:NEW0//15d/15d	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	Anzeige von ONGO
98A	0	Dividend Ranking Date	:DIVR//8!n	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

70E	0	Additional Text	:ADTX//10*35x	
16S	M	End of Block	CAOPTN	

End of Sequence E Corporate Action Options

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (BUYA)

Die Option (E-Sequenz) "BUYA" wird nur angezeigt, falls die Interim-Stücke handelbar sind.

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	0	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//BUYA	
22F	0	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	0	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
69A	0	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
97A	O	Cash Account	:CASH//35x	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
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

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (SLLE)

Die Option (E-Sequenz) "SLLE" wird generell angezeigt.

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//SLLE	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
69A	O	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
97A	O	Cash Account	:CASH//35x	
98AB	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
16S	M	End of Block	CASHMOVE	

End of Subsequence E2 Cash Movements

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
16S	M	End of Block	CAOPTN	

End of Sequence E Corporate Action Options

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (NOAC)

Die Option (E-Sequenz) "NOAC" wird entfernt.

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	Ø	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//NOAC	
22F	Ø	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	{[SIN1!e12!c] — [4*35x]}	
98A	M	Payment Date	:PAYD//8!n	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

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	
16S	M	End of Block	ADDINFO	

End of Sequence F Additional Information

2.1.4 2-Event Szenario: TA211 RHD1 – TA280 DVOP

Im Rahmen des Zwei-Event-Szenarios „Deutsche Wahldividende mit Ausschüttung einer Cash Line“ werden im zweiten Event (TA280 DVOP – Bezugsangebot zur Cash Line) folgende Änderungen vorgenommen:

- Die Option (E-Sequenz) „CASH“ wird durch eine Subsequenz E1 „Ausbuchen der Cash Line“ ergänzt. Damit wird die Ausbuchung der Cash Line avisiert, die nach der Geldausschüttung (KADI-Terminart TA120 DVOP) durch die KADI-Terminart TA222 DVOP erfolgt.
- In der Option (E-Sequenz) „SECU“, Subsequenz E1 „Ausbuchen der Cash Line“ wird das Feld 92D::NEWO entfernt. Das Feld wird weiterhin in der Subsequenz E1 „Einbuchen der Securities Line“ angezeigt.

Die nachfolgende Tabelle beschreibt das künftige Nachrichtenformat für den MT564 in TA280 DVOP (zweiter Event im 2-Event Szenario TA211 RHD1 – TA280 DVOP). Die zum November 2015 geplanten Änderungen und Erweiterungen sind darin hervorgehoben.

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

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//DVOP	
22F	M	Mandatory/Voluntary Indicator	:CAMV//CHOS	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	
25D	M	Processing Status	:PROC//4!c	

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]	

Repetitive Mandatory Subsequence B2 Account Information

16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	
93B	O	Total Eligible for CA	:ELIG//4!c/[N]15 d	
93B	O	Uninstructed Balance	:UNBA//4!c/[N]1 5d	
93B	O	Instructed Balance	:INBA//4!c/[N]15 d	
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

End of Subsequence B2 Account Information

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

End of Sequence B Underlying Securities

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (SECU)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//SECU	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//1!a	
98C	O	Early Response Deadline Date/Time	:EARD//8!n6!n	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
98C	O	Market Deadline Date/Time	:MKDT//8!n6!n	
69A	O	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
92D	Ø	New to Old	NEWO//15d/15d	Das Feld 92D::NEWO wird aus E1-Debit entfernt.
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
92D	O	New to Old	:NEWO//15d/15d	
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
98A	O	Dividend Ranking Date	:DIVR//8!n	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

70E	O	Additional Text	:ADTX//10*35x	
16S	M	End of Block	CAOPTN	

End of Sequence E Corporate Action Options

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (CASH – first currency)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//CASH	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//1!a	
98C	O	Early Response Deadline Date/Time	:EARD//8!n6!n	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
98C	O	Market Deadline Date/Time	:MKDT//8!n6!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

Neue Subsequenz E1 zur Avisierung der Ausbuchung der Cash Line bei Barbezug

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	ISIN der Cash Line (= ISIN In Sequenz B)
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	Ex Tag des Barbezuges (TA120 DVOP)
16S	M	End of Block	SECMOVE	
End of Subsequence E1 Securities Movement				

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
97A	O	Cash Account	:CASH//35x	
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
92F	O	Gross Dividend Rate	:GRSS//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

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (CASH – second, optional currency)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//CASH	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
11A	O	Currency Option	:OPTN//3!a	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	O	Early Response Deadline Date/Time	:EARD//8!n6!n	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
98C	O	Market Deadline Date/Time	:MKDT//8!n6!n	
16S	M	End of Block	CAOPTN	

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

End of Sequence E Corporate Action Options

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (BUYA)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//BUYA	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
69A	O	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
97A	O	Cash Account	:CASH//35x	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
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

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (SLLE)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//SLLE	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
69A	O	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
97A	O	Cash Account	:CASH//35x	
98AB	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
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	O	Additional Text	:ADTX// 10*35x	
16S	M	End of Block	ADDINFO	

End of Sequence F Additional Information

2.1.5 2-Event Szenario: TA211 RHDI – TA280 BONU

Im Rahmen des Zwei-Event-Szenarios „Gratisaktien oder Bonusaktien wahlweise in bar“ werden im zweiten Event (TA280 BONU – Bezugsangebot auf Basis der Interim-ISIN) folgende Änderungen vorgenommen:

- Der Corporate Action Event Indikator 22F::CAEV im MT564 des zweiten Events (TA280) wird von „BONU“ auf „DVOP“ geändert.

2.1.6 2-Event Szenario: TA232 DECR – TA280 EXOF

Im Rahmen des Zwei-Event-Szenarios „Kapitalherabsetzung bei Abwicklung über Interim-Stücke“ werden im zweiten Event (TA280 EXOF – Bezugsangebot auf Basis der Interim-Stücke) folgende Änderungen vorgenommen:

- In der Option (E-Sequenz) „SECU“ wird das Feld 22F::DISF//RDDN neu aufgenommen. Damit wird den Kunden das Settlement von Bruchstücken avisiert.

SWIFT 22F::DISF-Indikator	Bedeutung
22F::DISF//BUYU	Kauf von Bruchstücken / Spitzen
22F::DISF//CINL	Verkauf von Bruchstücken / Spitzen
22F::DISF//DIST	Verteilung von Bruchstücken / Spitzen
22F::DISF//RDDN	Abrunden
22F::DISF//RDUP	Aufrunden
22F::DISF//UKWN	Unbekannt

- In der Option (E-Sequenz) „SECU“, Subsequenz E1 „Ausbuchen der Interim-Stücke“ wird der Zahlbarkeitstag mit 98B::PAYD//ONGO angezeigt.
- In der Option (E-Sequenz) „SECU“, Subsequenz E1 „Einbuchen der finalen Wertpapiere“ wird der Zahlbarkeitstag mit 98B::PAYD//ONGO angezeigt.
- Die Option (E-Sequenz) „NOAC“ wird aus der Nachricht entfernt, da die Option „SECU“ immer die Default-Option ist. Hierzu wird in der Option „SECU“ das Default-Flag gesetzt (17B::DFLT//Y).

Die nachfolgende Tabelle beschreibt das künftige Nachrichtenformat für den MT564 in TA280 EXOF (zweiter Event im 2-Event Szenario TA232 DECR – TA280 EXOF). Die zum November 2015 geplanten Änderungen und Erweiterungen sind darin hervorgehoben.

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
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//EXOF	
22F	M	Mandatory/Voluntary Indicator	:CAMV//CHOS	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	
25D	M	Processing Status	:PROC//4!c	
Repetitive Optional Subsequence A1 Linkages				
16R	M	Start of Block	LINK	
13A	O	Linked Message	:LINK//232	
20C	M	Corporate Action Reference	:CORP//16x	Corporate Action Referenz der Terminart TA232
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]	ISIN der Interim-Stücke
Repetitive Mandatory Subsequence B2 Account Information				
16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	
93B	O	Total Eligible for CA	:ELIG//4!c/[N]15d	
93B	O	Uninstructed Balance	:UNBA//4!c/[N]15d	

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
93B	0	Instructed Balance	:INBA//4!c/[N]15d	
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information

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

End of Sequence B Underlying Securities

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (SECU)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	0	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//SECU	
22F	0	Disposition of Fractions	:DISF//4!c	Aufnahme des Fraction-Indikators. Siehe Erläuterung in der Einführung dieses Kapitels.
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//Y	SECU ist die Default-Option.
98C	0	Early Response Deadline Date/Time	:EARD//8!n6!n	
98C	0	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
98C	0	Market Deadline Date/Time	:MKDT//8!n6!n	
69A	0	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	Die Interim-Stücke werden ausgebucht
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	ISIN der Interim-Stücke
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	Anzeige von ONGO
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	Die finalen Stücke werden eingebucht
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	ISIN der finalen Stücke
92D	0	New to Old	:NEWO//15d/15d	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	Anzeige von ONGO
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

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

End of Sequence E Corporate Action Options

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (SLLE)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	0	CA Option Number	:CAON//3!c	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//SLLE	

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	0	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
69A	0	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	Die Interim-Stücke werden ausgebucht
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	ISIN der Interim-Stücke
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	Der Ausgleichsbetrag wird gutgeschrieben
97A	0	Cash Account	:CASH//35x	
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
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

End of Subsequence E1 Securities Movement

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

End of Sequence E Corporate Action Options

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (NOAC)

Die Option (E-Sequenz) "NOAC" wird entfernt.

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	0	CA Option Number	:CAON//3!e	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//NOAC	
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	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] — [4*35x]	
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!e	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

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

End of Sequence E Corporate Action Options

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
Optional Sequence F Additional Information				
16R	M	Start of Block	ADDINFO	
70E	O	Additional Text	:ADTX// 10*35x	
16S	M	End of Block	ADDINFO	

End of Sequence F Additional Information

2.1.7 2-Event Szenario: TA232 MRGR/SPLR – TA280 EXOF

Erweiterung des vorhandenen Zwei-Event-Szenarios „Kapitalherabsetzung bei Abwicklung über Interim-Stücke“ für weitere Umtauschgründe

Das vorhandene Zwei-Event-Szenario TA232 DECR / TA280 EXOF wird um weitere Umtauschgründe erweitert. Damit kommt das Zwei-Event-Szenario zum Beispiel auch bei der Abwicklung von Fusionen oder Reverse Splits über Interim-Stücke zur Anwendung:

- Der erste Event wird durch einen MT564 in der KADI-Terminart TA232 abgebildet mit 22F::CAMV//MAND und 22F::CAEV//MRGR oder 22F::CAEV//SPLR. Das Format der MT564-Notifikation ist im [CBF Connectivity Handbuch Part 3, Kapitel 2.18.1](#) beschrieben und wird unverändert übernommen.
- Der zweite Event wird durch einen MT564 in der KADI-Terminart TA280 auf Basis der ISIN-interim abgebildet mit 22F::CAMV//CHOS und 22F::CAEV//EXOF. Das Format der MT564-Notifikation entspricht dem Format wie im „DECR“-Fall (siehe Kapitel [2.1.6](#)).

2.1.8 1-Event Szenario: TA280 BIDS/BPUT/CONV/TEND/EXOF

Im Rahmen des Ein-Event-Szenarios „Angebote ohne Hinzuschalten einer Interim-ISIN“ werden im TA280 BIDS/BPUT/CONV/TEND/EXOF-Event folgende Änderungen vorgenommen:

- Die Optionen (E-Sequenz) „CASH“ und „SECU“ werden durch eine Subsequenz E1 „Ausbuchen der Underlying-ISIN / Parent Line“ ergänzt. Damit wird die Ausbuchung oder Separierung der Underlying-ISIN avisiert, die bei Partizipation am Angebot erfolgt.
- Für die KADI-Terminart TA280 mit Corporate Action Event Indikator „CONV“ (Conversion) wird in der Option (E-Sequenz) „SECU“ bzw. „EXER“ die Subsequenz E2-Cashmove entfernt. Der Wandlungspreis, dargestellt durch das Feld 90a::PRPP, wird künftig in der Subsequenz E1 „Einbuchen neue ISIN“ angezeigt.

Die nachfolgende Tabelle beschreibt das künftige Nachrichtenformat für den MT564 in TA280 BIDS/BPUT/CONV/TEND/EXOF (im 1-Event Szenario). Die zum November 2015 geplanten Änderungen und Erweiterungen sind darin hervorgehoben.

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

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	
22F	M	Mandatory/Voluntary Indicator	:CAMV//VOLU	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	
25D	M	Processing Status	:PROC//4!c	

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] [4*35x]	

Mandatory Subsequence B2 Account Information (Main Account)

16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	
93B	O	Uninstructed Balance	:UNBA//4!c/[N]1 5d	
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information (Main Account)

Repetitive Mandatory Subsequence B2 Account Information (Sub Accounts)

16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	
93B	O	Uninstructed Balance or Instructed Balance	:UNBA//4!c/[N]1 5d :INBA//4!c/[N]15 d	
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information (Sub Accounts)

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
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	Trading Suspended Date	:TSDT//8!n	
98A	O	Record Date	:RDTE//8!n	
36B	O	Quantity of Financial Instrument	:QTSO//4!c/15d :MQSO//4!c/15d	
16S	M	End of Block	CADETL	

End of Sequence D Corporate Action Details

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//001	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//4!a	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	O	Early Response Deadline Date/Time	:EARD//8!n6!n	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
98C	O	Market Deadline Date/Time	:MKDT//8!n6!n	
69A	O	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

Neue Subsequenz E1 innerhalb der Option (E-Sequenz) "SECU" und „CASH“ zur Avisierung der Ausbuchung bzw. Separierung der Underlying-ISIN"

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//DEBT	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	Underlying-ISIN (= ISIN in Sequenz B)
98B	M	Payment Date	:PAYD//ONGO	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c] [4*35x]	
90A, B	O	Generic Cash Price Paid per Product	:PRPP//4!c/15d :PRPP//4!c/3!a1 5d	Für 22F::CAEV//CONV wird hier der Wandlungspreis angezeigt.
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
92D	O	New to Old	:NEWO//15d/15d	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	Für 22F::CAEV//CONV wird die Subsequenz E2 entfernt.
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//4!c	
97A	O	Cash Account	:CASH//35x	
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
92B	O	Exchange Rate	:EXCH//3!a/3!a/1 5d	
90A, B	O	Generic Cash Price Received per Product	:OFFR//4!c/15d :OFFR//4!c/3!a1 5d	
90A, B	O	Generic Cash Price Paid per Product	:PRPP//4!c/15d :PRPP//4!c/3!a1 5d	
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

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (NOAC)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//002	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//NOAC	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//Y	
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	
16S	M	End of Block	ADDINFO	

End of Sequence F Additional Information

2.1.9 1-Event Szenario: TA280 CONS

Im Rahmen einer Consent Offer werden in der MT564-Notifikation zu KADI-Terminart TA280 CONS folgende Änderungen vorgenommen:

- In der Option (E-Sequenz) „CONY“ wird die Subsequenz E1 „Einbuchen Stücke“ entfernt.

Die nachfolgende Tabelle beschreibt das künftige Nachrichtenformat für den MT564 in TA280 CONS. Die zum November 2015 geplanten Änderungen und Erweiterungen sind darin hervorgehoben.

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
-----	--------	----------	--------	-----------------------

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//CONS	
22F	M	Mandatory/Voluntary Indicator	:CAMV//VOLU	
98C	O	Preparation Date	:PREP//8!n6!n	
25D	M	Processing Status	:PROC//4!c	

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]	

Mandatory Subsequence B2 Account Information (Main Account)

16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	
93B	O	Uninstructed Balance	:UNBA//4!c/[N]1 5d	
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information (Main Account)

Repetitive Mandatory Subsequence B2 Account Information (Sub Accounts)

16R	M	Start of Block	ACCTINFO	
97A	M	Safekeeping Account	:SAFE//35x	
93B	O	Uninstructed Balance or Instructed Balance	:UNBA//4!c/[N]1 5d :INBA//4!c/[N]15 d	
16S	M	End of Block	ACCTINFO	

End of Subsequence B2 Account Information (Sub Accounts)

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
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	Trading Suspended Date	:TSDT//8!n	
36B	O	Quantity of Financial Instrument	:QTSO//4!c/15d :MQSO//4!c/15d	
16S	M	End of Block	CADETL	

End of Sequence D Corporate Action Details

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//001	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//CONY	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
98C	O	Early Response Deadline Date/Time	:EARD//8!n6!n	
98C	O	Response Deadline Date/Time	:RDDT//8!n6!n	
98C	O	Market Deadline Date/Time	:MKDT//8!n6!n	
69A	O	Period of Action	:PWAL//8!n/8!n	

Repetitive Optional Subsequence E1 Securities Movement

Für CAEV = CONY wird die Subsequenz E1 "Einbuchen von Stücken" entfernt.

16R	M	Start of Block	SECMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//CRED	
35B	M	Identification of the Financial Instrument	[ISIN!e12!c] [4*35x]	
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
92D	O	New to Old	:NEWO//15d/15d	
16S	M	End of Block	SECMOVE	

End of Subsequence E1 Securities Movement

Repetitive Optional Subsequence E2 Cash Movements

16R	M	Start of Block	CASHMOVE	
22H	M	Credit/Debit Indicator	:CRDB//4!c	
97A	O	Cash Account	:CASH//35x	
98A, B	M	Payment Date	:PAYD//8!n :PAYD//4!c	
90A, B	O	Generic Cash Price Received per Product	:OFFR//4!c/15d :OFFR//4!c/3!a15d	
90A, B	O	Generic Cash Price Paid per Product	:PRPP//4!c/15d	

Tag	Status	Feldname	Format	Nov 2015 - Änderungen
			:PRPP//4!c/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

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//002	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//CONN	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//N	
16S	M	End of Block	CAOPTN	

End of Sequence E Corporate Action Options

Repetitive Optional Sequence E Corporate Action Options (NOAC)

16R	M	Start of Block	CAOPTN	
13A	O	CA Option Number	:CAON//003	
22F	M	CA Option Code	:CAOP//NOAC	
22F	O	Option Features Indicator	:OPTF//4!c	
17B	M	Default Processing Flag	:DFLT//Y	
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	
16S	M	End of Block	ADDINFO	

End of Sequence F Additional Information

2.1.10 TA232 Umtausch

TA232 DVOP in einer Deutschen Wahldividende

Innerhalb einer Deutschen Wahldividende erfolgt heute der Umtausch von der Securities Line in die finale Gattung durch Verarbeitung der KADI Terminart TA232. In der MT564 Notifikation zu TA232 wird als Corporate Action Event Indikator heute 22F::CAEV//DVOP verwendet. Künftig wird im MT564 der Indikator 22F::CAEV//EXOF ausgewiesen.

Für die Verarbeitung der Geldausschüttung auf Basis der Cash Line verwendet die CBF auch künftig unverändert die TA120 mit 22F::CAEV//DVOP.

TA232 CONV (Conversion)

Für bestimmte WSS-Umtauschgründe (UD008A) wird künftig im MT564 zu TA232 anstelle des Corporate Action Event Indicators 22F::CAEV//CONV die Indikatoren 22F::CAEV//EXOF oder 22F::CAEV//CHAN verwendet. Die nachfolgende Tabelle führt die Umtauschgründe auf, bei denen der heutige 22F::CAEV//CONV ersetzt wird.

Umtauschgrund (UD008A)	Beschreibung	Neuer 22F ::CAEV in MT564 für TA232
AM	Kündigung von Aktien	EXOF
CF, CG, CH, CI, CJ, CK, CL	Umtausch wegen ISIN-Änderung	EXOF
CM	Umtausch von/in Global Bearer Certificates (GBCs)	EXOF
CO	ISIN-Wechsel wegen Namensänderung	CHAN
CQ	ISIN-Wechsel wegen Bogenerneuerung durch Umtausch der Stücke	EXOF
CR	ISIN-Wechsel wegen Umstellung in Stückaktie	EXOF
CS	ISIN-Wechsel wegen Scheme of Arrangement/ Plan of Arrangement	EXOF
CT	ISIN-Wechsel wegen Umtausch in Bruchstücke	EXOF
CU	ISIN-Wechsel wegen Wiederbelegung der ISIN	EXOF
CV	Umtausch wegen Korrektur einer der WKN falsch zugeordneten ISIN (WKN bleibt unverändert)	EXOF
CX	Umtausch wegen Überkreuzkorrektur falscher ISIN/WKN-Zuordnung	EXOF

2.1.11 TA281 REDM für Andienungsrechte

Der MT564 in TA281 (22F::CAEV//REDM, 22F::CAMV//MAND) als Informationsevent für Aktien- und Rentenandienungsrechte wird bezüglich der Optionen (E-Sequenzen) neu strukturiert. Der Aufbau der Optionen erfolgt in Abhängigkeit der Belegung der beiden WSS-Felder Erfüllungsart 1 (UD061) und Erfüllungsart 2 (UD062). Die folgende Tabelle gibt einen Überblick über den Aufbau der E-Sequenzen. Falls die Anwendbarkeit einer Option (E-Sequenz) nicht von der Entscheidung des Kunden sondern von durch den Emittenten festgelegten Bedingungen (z. B. Kursabhängigkeiten) abhängt, so wird dies in der E-Sequenz durch den Indikator 22F::OPTF//CAOS zum Ausdruck gebracht.

Erfüllung durch Lieferung von Titeln

Sequenz E-SECU mit

17B::DFLT//Y

Subsequenz E1 - Ausbuchen der ISIN-Underlying

Subsequenz E1 - Einbuchen der neuen Titel

Erfüllung durch Zahlung eines Barausgleichs / Differenzenausgleichs

Sequenz E-CASH mit

17B::DFLT//Y

Subsequenz E1 – Ausbuchen der ISIN-Underlying

Subsequenz E2 – Einbuchen Barausgleich/Differenzenausgleich

Erfüllung durch Lieferung von Titeln oder Zahlung eines Barausgleichs / Differenzenausgleichs

1. Sequenz E-SECU mit

17B::DFLT//N

22F::OPTF//CAOS

Subsequenz E1 – Ausbuchen der ISIN-Underlying

Subsequenz E1 – Einbuchen der neuen Titel

2. Sequenz E-CASH mit

17B::DFLT//N

22F::OPTF//CAOS

Subsequenz E1 – Ausbuchen der ISIN-Underlying

Subsequenz E2 – Einbuchen Barausgleich/Differenzenausgleich

Erfüllung durch Lieferung von Titeln und/oder Zahlung eines Barausgleichs / Differenzenausgleichs

1. Sequenz E-CASH mit

17B::DFLT//N

22F::OPTF//CAOS

Subsequenz E1 - Ausbuchen der ISIN-Underlying

Subsequenz E2 - Einbuchen Barausgleich/Differenzenausgleich

2. Sequenz E-SECU mit

17B::DFLT//N

22F::OPTF//CAOS

Subsequenz E1 - Ausbuchen der ISIN-Underlying

Subsequenz E2 - Einbuchen der neuen Titel

3. Sequenz E-CASE mit

17B::DFLT//N

22F::OPTF//CAOS

Subsequenz E1 - Ausbuchen der ISIN-Underlying

Subsequenz E1 - Einbuchen der neuen Titel

Subsequenz E2 - Einbuchen Barausgleich/Differenzenausgleich

2.1.12 Erweiterung der Verlinkung von MT564 Notifikationen

Eine Verlinkung von MT564-Nachrichten erfolgt heute im Rahmen des 2-Event-Szenarios. Die nachfolgende Tabelle liefert eine Übersicht über die zusätzliche Verlinkung von MT564-Nachrichten, die aus unterschiedlichen Abwicklungsprozessen resultieren aber dem gleichen Vorgang zuzuordnen sind. Die Verlinkung erfolgt über eine zusätzliche Subsequenz A1 Linkages und wird in den MT564-Nachrichten ergänzt, die in der Spalte „Verlinkung von MT564“ aufgeführt sind.

Übergeordneter Vorgang	Verlinkung	
	Von MT564	Zu MT564
Parallele Abwicklung von Geld (TA124/TA125) und Stücke (TA232) nach einem Angebot (TA280). Die Barausschüttung und der Umtausch der Stücke erfolgt auf Basis des gleichen WSS-Umtausch-Segments.	TA124 / TA125	TA232
	TA232	TA124 / TA125
Tilgung in Wertpapieren (TA231) mit Barausgleich (TA134). Basis ist ein WSS-Tilgungs-Segment.	TA231	TA134
	TA134	TA231
Tilgung in Wertpapieren (TA231) mit oder ohne Barausgleich	TA134 und/oder TA231	TA281

Übergeordneter Vorgang	Verlinkung	
	Von MT564	Zu MT564
(TA134) bei einer vorausgegangenen Andienung (TA281)		
Barausschüttung zu einem Warrant (TA122) nach einem Angebot (TA280) oder einer Andienung (TA281)	TA122	TA280 / TA281
Tilgung eines Zertifikates (TA132) aufgrund einer Andienung (TA281)	TA132	TA281

Die Verlinkung wird immer durch einen Hinweis zum Nachrichtentyp „MT564“ und der Corporate Action Referenz des referenzierten MT564 dargestellt.

Beispiel für die Darstellung einer zusätzlichen A1 Linkages:

16R:LINK
13A::LINK//564
20C::CORP//1342015080158900
16S:LINK

2.2 MT566 Corporate Action Confirmation

TA232 DVOP in einer Deutschen Wahldividende

Innerhalb einer Deutschen Wahldividende erfolgt heute der Umtausch von der Securities Line in die finale Gattung durch Verarbeitung der KADI Terminart TA232. In der MT566 Bestätigung zu TA232 wird als Corporate Action Event Indikator heute 22F::CAEV//DVOP verwendet. Künftig wird im MT566 der Indikator 22F::CAEV//EXOF ausgewiesen.

Für die Bestätigung der Geldausschüttung auf Basis der Cash Line (TA120 DVOP) verwendet die CBF auch künftig unverändert den Corporate Action Event Indikator 22F::CAEV//DVOP.

Änderung des Corporate Action Event Indikators bei der Abwicklung der Barausschüttung im Rahmen von „Gratisaktien oder Bonusaktien, wahlweise in bar“

Die Verarbeitung der Barausschüttung zum Vorgang „Gratisaktien oder Bonusaktien, wahlweise in bar“ erfolgt heute durch die KADI-Terminart TA120 mit dem Corporate Action Event Indikator 22F::CAEV//BONU in der MT566 Bestätigung. Künftig wird der CAEV „BONU“ durch „DVOP“ ersetzt.

Die durch die Terminart TA120 angestoßene Ausbuchung der Interim-Stücke über TA222 wird heute ebenfalls durch einen MT566 mit CAEV „BONU“ bestätigt. Auch hier wird der CAEV auf „DVOP“ geändert.

TA232 CONV (Conversion)

Für bestimmte WSS-Umtauschgründe (UD008A) wird künftig in der MT566 Bestätigung zu TA232 anstelle des Corporate Action Event Indikators 22F::CAEV//CONV die Indikatoren 22F::CAEV//EXOF oder 22F::CAEV//CHAN verwendet. Die nachfolgende Tabelle führt die Umtauschgründe auf, bei denen der heutige 22F::CAEV//CONV ersetzt wird.

Umtauschgrund (UD008A)	Beschreibung	Neuer 22F ::CAEV in MT566 für TA232
AM	Kündigung von Aktien	EXOF
CF, CG, CH, CI, CJ, CK, CL	Umtausch wegen ISIN-Änderung	EXOF
CM	Umtausch von/in Global Bearer Certificates (GBCs)	EXOF
CO	ISIN-Wechsel wegen Namensänderung	CHAN
CQ	ISIN-Wechsel wegen Bogenerneuerung durch Umtausch der Stücke	EXOF
CR	ISIN-Wechsel wegen Umstellung in Stückaktie	EXOF
CS	ISIN-Wechsel wegen Scheme of Arrangement/ Plan of Arrangement	EXOF
CT	ISIN-Wechsel wegen Umtausch in Bruchstücke	EXOF
CU	ISIN-Wechsel wegen Wiederbelegung der ISIN	EXOF
CV	Umtausch wegen Korrektur einer der WKN falsch zugeordneten ISIN (WKN bleibt unverändert)	EXOF
CX	Umtausch wegen Überkreuzkorrektur falscher ISIN/WKN-Zuordnung	EXOF