

CBF SWIFT & Connectivity Änderungen – Updates

November 2011

| CBF SWIFT & Connectivity Änderungen – Updates

| August 2011

Dokumentennummer: F-CON20

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

© Copyright Clearstream Banking AG, Frankfurt (2011). Alle Rechte vorbehalten.

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

CBF SWIFT & Connectivity Änderungen im November 2011

Clearstream Banking Frankfurt (CBF) stellt in dieser Kundeninformation die Änderungen im Zusammenhang mit dem SWIFT Standard Release 2011 vor. Diese Änderungen werden mit Wirkung zum **21. November 2011** eingeführt.

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

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

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

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

Im Rahmen des SWIFT Release im November 2011 werden die nachfolgend beschriebenen Änderungen von Clearstream Banking Frankfurt umgesetzt.

Diese Änderungen gelten für Nachrichten im ISO15022 Format, die über das SWIFT Netzwerk, über IBM WebSphere MQ sowie über die File-Transfer Schnittstelle empfangen bzw. versendet werden.

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

Die Informationen sind in folgende Abschnitte gegliedert:

- Clearing und Settlement Services
- Custody Services

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

CBF SWIFT & Connectivity Änderungen – Updates

Leerseite

Inhalt

1. Clearing und Settlement Services

1.1	MT535 Statement of Holdings	1-1
1.2	MT536 Statement of Transactions	1-1
1.3	MT537 Statement of Pending Transactions	1-3
1.4	MT530 Transaction Processing Command	1-4
1.5	MT540-543 Settlement Instructions	1-4
1.6	MT544-547 Settlement Confirmations	1-5
1.7	MT548 Settlement Status and Processing Advice	1-6
1.8	MT578 Settlement Allegement	1-8
1.9	MT569 Tripartite Collateral and Exposure Statement	1-8
1.10	MT942 Interim Transaction Report/EUR Cash Clearing Report	1-8

2. Custody Services

2.1	MT564 Corporate Action Notification	2-2
2.2	MT566 Corporate Action Confirmation	2-8
2.3	MT568 Corporate Action Narrative	2-12

3. Kundenstammdaten

3.1	KUSTA Datenträger	3-1
-----	-------------------------	-----

CBF SWIFT & Connectivity Änderungen – Updates

Leerseite

1. Clearing und Settlement Services

Die neuen Clearing und Settlement Services und Änderungen, die ab dem 21. November 2011 im Rahmen des SWIFT Release eingeführt werden, sind in diesem Kapitel beschrieben.

1.1 MT535 Statement of Holdings

Keine Änderungen

1.2 MT536 Statement of Transactions

Teilsequenz B1a1 Linkages

:20C::POOL// Pool Reference

Aktuell wird die CASCADE- oder LION-Referenz des Lieferanten im Feld :20C::POOL gefüllt. Diese wird bei eigenen Lieferungen auch im Feld :20C::TRRF oder bei Erhalt in Feld :20C::PROC der Settlement Party DEAG gefüllt.

In Zukunft wird die Referenz des Liefernden nicht mehr in :20C::POOL gefüllt, sondern nur noch die Referenz von aggregierten Geschäften, falls diese vorhanden ist oder bei der Auftragsart 99¹, falls ein Bezug zu einem vorherigen Auftrag vorhanden ist. In allen anderen Fällen wird das Feld nicht gefüllt.

Kunden, die das Feld :20C::POOL verwenden, müssen in Zukunft die Referenz des Lieferanten entweder bei eigenen Lieferungen im Feld :20C::TRRF oder bei Erhalt in Feld :20C::PROC der Settlement Party DEAG auswerten.

Teilsequenz B1a1 Linkages

:20C::PREV// Previous Message Reference

Aktuell wird die eigene CASCADE- oder LION-Referenz im Feld :20C::PREV gefüllt. Diese wird auch im Feld :20C::TRRF gefüllt.

In Zukunft wird das Feld :20C::PREV nicht mehr gefüllt.

Kunden, die das Feld :20C::PREV verwenden, müssen in Zukunft die Referenz im Feld :20C::TRRF auswerten.

Teilsequenz B1 Financial Instrument

:94B::PRIC// Source of Price

1. Auftragsart 99 = Storno/Nachbuchung Depot-Umsatz

Teilsequenz B1a2 Transaction Details

:94B::TRAD// Place of Trade

Aktuell wird der Handelsplatz im Feld :94B::PRIC gefüllt. Für alle anderen CBF Nachrichtentypen (zum Beispiel MT541 etc.) wird der Preis in Feld :94B::TRAD gefüllt.

In Zukunft wird das Feld :94B::PRIC nicht mehr verwendet werden und stattdessen wie bei den anderen Nachrichten mit dem neuen Feld :94B::TRAD gefüllt.

Kunden, die das Feld :94B::PRIC verwenden, müssen in Zukunft das Feld :94B::TRAD auswerten.

Hierbei ist zu beachten, dass alle Handelsplätze vierstellig gefüllt werden. Zum Beispiel, wird der Handelsplatz Frankfurt heute im MT536 mit :94B::PRIC//LMAR/EDF und in Zukunft mit :94B::TRAD//EXCH/XEDF dargestellt. Allen dreistelligen Werten wird ein "X" vorangestellt. Alle Werte, die bereits vierstellig gefüllt werden, wie "ECAG", werden weiterhin in gleicher Weise gefüllt.

Für OTC Geschäfte wird das Feld 94B nicht mehr gefüllt, da es auch in anderen MT Nachrichten nicht geführt wird. Diese Geschäfte wurden bislang mit :94B::PRIC//LMAR/OTC gefüllt. In Zukunft entfällt für OTC Geschäfte eine Anzeige dieses Feldes.

Teilsequenz B1 Financial Instrument

:98A::PRIC// Price Quotation Date

Aktuell wird im Feld :98A::PRIC der Handelstag gefüllt. Dieser wird auch im Feld :98A::TRAD ausgewiesen.

In Zukunft wird das Feld :98A::PRIC nicht mehr gefüllt.

Kunden, die das Feld :98A::PRIC verwenden, müssen in Zukunft den Handelstag im Feld :98A::TRAD nutzen.

Teilsequenz B1a2 Transaction Details

:70D::TRDE// Transaction Details Narrative

Label /RERE - CASCADE Referenz des Gut-Kontos

Aktuell wird die CASCADE Referenz des Gut-Kontos für matchpflichtige Instruktionen im Feld :70E::TRDE mit dem Kennzeichen RERE gefüllt. Diese wird bei Erhalt von Stücken auch im Feld :20C::TRRF oder bei Lieferung in Feld :20C::PROC der Settlement Party REAG gefüllt.

In Zukunft wird das Label RERE im Feld :70E::TRDE nicht mehr gefüllt.

Kunden, die das Label RERE im Feld :70E::TRDE verwenden, müssen in Zukunft die Referenz bei Erhalt von Stücken im Feld :20C::TRRF oder bei Lieferungen in Feld :20C::PROC der Settlement Party REAG auswerten.

Label /TRDA - Handelstag

Aktuell wird im Feld :70E::TRDE mit dem Label TRDA der Handelstag gefüllt. Dieser wird auch im Feld :98A::TRAD ausgewiesen.

In Zukunft wird das Label TRDA im Feld :70E::TRDE nicht mehr gefüllt.

Kunden, die das :70E::TRDE mit dem Label TRDA verwenden, müssen in Zukunft den Handelstag im Feld :98A::TRAD auswerten.

1.3 MT537 Statement of Pending Transactions

OTC und Stock-Exchange (LION)

Teilsequenz C1 Linkages

:20C::PREV// Previous Message Reference

Aktuell wird die eigene CASCADE- oder LION-Referenz im Feld :20C::PREV gefüllt. Diese wird auch im Feld :20C::TRRF gefüllt.

In Zukunft wird das Feld :20C::PREV nicht mehr gefüllt.

Kunden, die das Feld :20C::PREV verwenden, müssen in Zukunft die Referenz im Feld :20C::TRRF auswerten.

OTC

Teilsequenz C2 Transaction Details

:70E::TRDE// Transaction Details Narrative

Label /CPRE - CASCADE Kontrahenten Referenz

Aktuell wird die CASCADE-Referenz des Kontrahenten für Match-Aufträge im Feld :70E::TRDE mit dem Label CPRE gefüllt. Diese wird auch im Feld :20C::PROC der Settlement Party DEAG oder REAG gefüllt.

In Zukunft wird die Referenz des Liefernden nicht mehr im Feld :70E::TRDE mit dem Label CPRE gefüllt.

Kunden, die das LABEL CPRE im Feld :70E::TRDE verwenden, müssen in Zukunft die Referenz des Kontrahenten im Feld :20C::PROC der Settlement Party DEAG oder REAG auswerten.

1.4 MT530 Transaction Processing Command

Keine Änderungen

1.5 MT540-543 Settlement Instructions

Teilsequenz E1 Settlement Parties

:95P::DEAG// Delivering Agent

:95P::REAG// Receiving Agent

Die Verwendung eines gültigen BIC für einen Kunden mit einem CASCADE Konto, kann ohne Angabe der Kontonummer im Feld 97a genutzt werden. CBF empfiehlt weiterhin die zusätzliche Angabe der CASCADE Kontonummer. Bei der Angabe des BIC ohne Kontonummer wird die Hauptkontonummer des Kontrahenten verwendet

Teilsequenz E1 Settlement Parties

:70E::DECL// Declaration Details Narrative

Label /SETR - Securities Transfer Reason

Folgende zusätzlichen Werte können für das Label - SETR verwendet werden:

- “210” = Iberclear Loan Opening in SCLV¹
- “211” = Iberclear Loan Closing in SCLV
- “212” = Iberclear Collateral Transfer, for example CCBM
- “213” = Iberclear Transfer without Change of Ownership

1. SLCV: Die Details der Erweiterung des Iberclear-Links werden in einer separaten Kundeninformation beschrieben und final bestätigt

1.6 MT544-547 Settlement Confirmations

Teilsequenz E1 Settlement Parties

:70E::DECL// Declaration Details Narrative

Label /SETR - Securities Transfer Reason

Folgende zusätzlichen Werte können für das Label - SETR gesendet werden:

- "210" = Iberclear Loan Opening in SCLV
- "211" = Iberclear Loan Closing in SCLV
- "212" = Iberclear Collateral Transfer, for example CCBM
- "213" = Iberclear Transfer without Change of Ownership

1.7 MT548 Settlement Status and Processing Advice

Teilsequenz B2b Settlement Transaction Details

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

Label /CPRE - CASCADE Kontrahenten Referenz

Aktuell wird die CASCADE-Referenz des Kontrahenten für Match-Aufträge im Feld :70E::SPRO mit dem Label CPRE gefüllt. Diese wird auch im Feld :20C::PROC der Settlement Party DEAG oder REAG gefüllt.

In Zukunft wird die Referenz des Liefernden nicht mehr im Feld :70E::TRDE mit dem Label CPRE gefüllt.

Kunden, die das LABEL CPRE im Feld :70E::TRDE verwenden, müssen in Zukunft die Referenz des Kontrahenten im Feld :20C::PROC der Settlement Party DEAG oder REAG auswerten.

Teilsequenz A2 Status and A2a Reason

:25D::MTCH//NMAT Matching Status // Unmatched

:24B::NMAT//CMIS Unmatched Reason // Matching Instruction Not Found

Reporting des Status NMAT/CMIS für den MT548

SWIFT und MQ

CBF führt ein schnittstellenübergreifendes Reporting für den Status NMAT//CMIS des MT548 ein.

Der Status NMAT/CMIS wird bislang nur an den Sender der Instruktion übermittelt. Ein Kunde, der über File-Transfer eine Instruktion sendet, erhält über SWIFT oder MQ mittels der Nachricht MT548 derzeit keinen Status NMAT/CMIS.

Die gleiche Funktionsweise gilt auch, wenn der Kunde über eine abweichende technische Adresse sendet. Wird die Instruktion z.B. von der SWIFT Adresse DAKVDEFF001 gesendet, erhält er über die Adresse DAKVDEFF002 mittels der Nachricht MT548 keine Statusmeldung NMAT/CMIS.

Zukünftig wird ein Kunde, der ein Reporting für das Life-Cycle-Produkt MT548 (Matching Informationen¹ über SWIFT) hat, den Status NMAT/CMIS erhalten, auch wenn die Instruktion über File-Transfer oder mit einer abweichenden technischen Adresse gesendet wurde.

Zusätzlich werden auch alle über CASCADE-Online eingestellten Instruktionen, die matchpflichtig sind, schnittstellenübergreifend angezeigt. Dies bedeutet, dass ein MT548 mit dem Status "unmatched" an SWIFT- oder MQ Kunden versendet wird, für die ein entsprechender Report aufgesetzt wurde.

Für File-Transfer wird dieser Service nicht eingeführt, da es sich hierbei nicht um eine Realtime Schnittstelle handelt.

Reporting für "Passive Matcher"

Mit der Einführung des aktiven und passiven Matching für Geschäfte frei von Zahlung wurde ein spezielles Reporting für "Passive Matcher" eingeführt. "Passive Matcher" erhalten derzeit keine Matching Informationen². Dieses gilt sowohl für den Erhalt (MT540) als auch für die Lieferung von Wertpapieren (MT542). Für den Erhalt wird das aktuelle Reporting beibehalten. Für die Lieferung werden in Zukunft Matching Informationen versandt.

In Zukunft wird bei Lieferung frei von Zahlung das gleiche Reporting für den MT548 bereitgestellt wie bei "Aktiven Matchern".

1. Das Produkt MTCHIN mit den Optionen "Nur Sender Aufträge" Nein und dem "Umfang" B muss dafür aufgesetzt sein.

2. Für eine MT542, die an CBF gesendet wird, erhält der Kunde nur den initialen Status aus dem Produkt "Matching Information", falls er dafür aufgesetzt ist. Sollte die Instruktion zunächst "unmatched" sein (NMAT/CMIS), würde der Kunde nicht über das spätere Matching informiert.

1.8 MT578 Settlement Allegement

Teilsequenz E1 Settlement Parties

:70E::DECL// Declaration Details Narrative

Label /SETR - Securities Transfer Reason

Folgende zusätzlichen Werte können für das Label - SETR gesendet werden:

- "210" = Iberclear Loan Opening in SCLV
- "211" = Iberclear Loan Closing in SCLV
- "212" = Iberclear Collateral Transfer, for example CCBM
- "213" = Iberclear Transfer without Change of Ownership

Reporting für "Passive Matcher"

Bislang erhalten "Passive Matcher" keine Allegements, auch wenn der Kontrahent ein Erhalt frei von Zahlung eingestellt hat und der "Passive Matcher" entsprechend eine MT542 Nachricht senden muss. Für den Erhalt wird das aktuelle Reporting beibehalten. Für die Lieferungen der Kontrahenten, die "Passive Matcher" sind, werden in Zukunft Matching Instruktionen versandt.

In Zukunft wird bei Lieferung frei von Zahlung das gleiche Reporting für den MT578 eingesetzt wie bei "Aktiven Matchern".

1.9 MT569 Tripartite Collateral and Exposure Statement

Keine Änderungen

1.10 MT942 Interim Transaction Report/EUR Cash Clearing Report

Keine Änderungen

2. Custody Services

In diesem Kapitel sind die Änderungen für den CBF Custody Service, die ab dem **21. November 2011** eingeführt werden, zusammengefasst.

Ein aktualisiertes CBF Connectivity Handbook Part III für das SWIFT SR 2011 mit der Beschreibung aller SWIFT-Nachrichten aus den Custody Services wird in Kürze ebenso veröffentlicht.

Bitte beachten Sie, dass es noch zu Änderungen und Ergänzungen der nachfolgend dargestellten SWIFT-Änderungen kommen kann vor dem Hintergrund laufender Planungen und Marktabstimmungen wegen der Umsetzung der OGAW-IV Richtlinie (Umstellung der Emittentensteuer auf Zahlstellensteuer für Dividendenzahlungen ab 2012).

2.1 MT564 Corporate Action Notification

Teilsequenz E2 Cash Movements

:19B::WITL/Withholding of Local Tax

Der Qualifier WITL für das Feld 19B wird nicht mehr in Teilsequenz E2 verwendet. Stattdessen werden in der Teilsequenz E2 die Qualifier TAXR bei Abzug der Deutschen Abgeltungsteuer und WITF bei Abzug ausländischer Quellensteuer angezeigt.

Teilsequenz B1 Financial Instrument Attributes

:22F::MICO//Method of Interest Computation Indicator

Für die Terminarten TA11x (Income-Zinszahlungen) wird die Zinsberechnungsmethode optional in Teilsequenz B1 aufgenommen. Die Anzeige erfolgt als Indikator im Format :22F::MICO//4!c. Die Schlüsselung des WM-Indikators F93 in den zulässigen SWIFT-Indikator erfolgt anhand der durch die German Market Practice festgelegten Mapping-Tabelle (veröffentlicht unter www.smpg.webexone.com).

Sequenz C Intermediate Securities, Trading Options

:22F::SELL, 69A::TRDP

Für die Terminart 211 mit Bezugsrechten (Non Income) werden heute in den MT564 Notifications keine Informationen zur Handelbarkeit des Rechtes geliefert. Nachfolgende Informationen werden bei Terminart 211 mit Bezugsrechten (ohne Wahldividende) in der C-Sequenz ergänzt.

Bezugsrecht ist handelbar:

:22F::SELL//RENO

:69A::TRDP//BEZUGSRECHTNOTIERUNG VON/-BIS

In diesem Fall werden die heutigen MT564 Notifications um zwei weitere Wiederholungen der E-Sequenz mit den Corporate Action Option Codes :22F::CAOP//BUYA und :22F::CAOP//SLLE ergänzt.

Bezugsrecht ist nicht handelbar:

:22F::SELL//NREN

Teilsequenz E1 Securities Movement

:36B:: Entitled Quantity of Financial Instrument

Für die Non Income Terminarten 211 (ohne Bezugsrecht), 213, 222, und 23x wird in der Teilsequenz E1 künftig auf Basis des ausgewiesenen Bestands die Anzahl der berechtigten Wertpapiere angezeigt (zum Beispiel Anzahl der neuen Aktien, Anzahl der auszubuchenden Stücke, etc.).

Sequenz F Additional Information

:70E::INCO

Für die Terminart 121 (Income-Fondsausschüttung) wird dieses Freitextfeld nicht mehr angezeigt. Die Informationen über die anteiligen Bemessungsgrundlagen werden jetzt in den strukturierten Feldern :92J::GRSS angezeigt.

Sequenz E Corporate Action Options und E2 Cash Movements

:90a::Price

Die nachfolgenden Qualifier werden nicht mehr in Sequenz E verwendet. Die Informationen, die zurzeit für diese Qualifier in Sequenz E angezeigt werden, stehen zukünftig in der Teilsequenz E2 zur Verfügung.

Qualifier	Beschreibung
EXER	Exercise Price
OFFR	Generic Cash Price Received per Product
PRPP	Generic Cash Price Paid per Product

Diese Änderungen betreffen die MT564 Notifications für Non Income Events und erfordern den Aufbau einer Teilsequenz E2 Cash Movements, die heute für Non Income-Nachrichten noch nicht angezeigt wird.

Bei den Terminarten 210 und 211 (mit Bezugsrechten) ändert sich der Qualifier zur Darstellung des Bezugspreises: statt OFFR wird künftig PRPP verwendet.

Teilsequenz E1 Securities Movement

:92D::NWRT/New Securities to Underlying Securities

Der Qualifier NWRT für das Feld 92D wird nicht mehr in Teilsequenz E1 verwendet. Stattdessen wird NEWO (New to Old) in der Teilsequenz E1 angezeigt.

Sequenz E Corporate Action Options und E2 Cash Movements

:92a::Rate

Die nachfolgenden Qualifier werden zukünftig nicht mehr in Sequenz E verwendet.

Qualifier	Definition	Belegung
ATAX	Additional Tax	Deutscher Solidaritätszuschlag
CHAR	Charges/Fees	Gebühren
GRSS	Gross Dividend Rate	Bruttodividende
INTP	Interest Rate Used for Payment	Zinssatz bezogen auf die aktuelle Zinszahlung
RATE	Applicable Rate	Rückzahlungsrate
WITL	Withholding of Local Tax	Deutsche Abgeltungsteuer oder ausländische Quellensteuer

Stattdessen werden künftig nachfolgende Qualifier in der Teilsequenz E2 angezeigt. Zu beachten ist, dass der Qualifier WITL durch die Qualifier TAXR und WITF ersetzt wird.

CBF SWIFT & Connectivity Änderungen – Updates

Diese beiden Tax-Felder werden künftig im Falle von Terminart 121 (Fondsausschüttung), wie heute schon bei den anderen Income-Terminarten, nur dann im MT564 angezeigt, wenn CBF bei der Kalkulation des Gutschriftbetrages vom Bruttobetrag Steuern abzieht.

Qualifier	Definition	Belegung
ATAX	Additional Tax	Deutscher Solidaritätszuschlag
CHAR	Charges/Fees	Gebühren
GRSS	Gross Dividend Rate	Bruttodividende
INTP	Interest Rate Used for Payment	Zinssatz bezogen auf die aktuelle Zinszahlung
RATE	Applicable Rate	Rückzahlungsrate
TAXR	Withholding Tax Rate	Deutsche Abgeltungsteuer
WITF	Withholding of Foreign Tax	Ausländische Quellensteuer

Teilsequenz E2 Cash Movements

:92J::GRSS//Proportional Disbursements

Im Falle der Terminart 121 (Income-Fondsausschüttung) werden optional bis zu 3 neue Felder angezeigt zur Darstellung der Bemessungsgrundlagen für die Kapitalertragssteuer bzw. Quellensteuer.

Feld / Format	Definition	Belegung
:92J::GRSS//INCO/3!a15d	Income Portion	Bemessungsgrundlage für die Kapitalertragssteuer aus inländischen (Deutschen) Dividenden
:92J::GRSS//INTR/3!a15d	Interest	Bemessungsgrundlage für die Kapitalertragssteuer oder Quellensteuer aus Zinsen
:92J::GRSS//SOIC/3!a15d	Sundry/Other Income	Bemessungsgrundlage für die Kapitalertragssteuer oder Quellensteuer aus ausländischen Dividenden

Sequenz E, Teilsequenz E2

:92a::Rückzahlungsrate, 90a::Rückzahlungspreis

Für die Terminarten 13x und 14x (Income-Rückzahlungen) wird im MT564 als auch im MT566 die Anzeige von Rückzahlungsrate bzw. -preis vereinheitlicht, wie in nachfolgender Tabelle für den MT564 aufgeführt.

Terminart	SWIFT-Belegung
130 - GESAMTRÜCKZAHLUNG	Anzeige des Rückzahlungspreises über
131 - RÜCKZAHLUNG GENUSSRECHT	:90A::OFFR//PRCT/15d bzw.
132 - RÜCKZAHLUNG ZERTIFIKAT	:90B::OFFR//ACTU/3!a15d in der Sequenz E
133 - LIQUIDATION FONDS	
134 - BARAUSGLEICH TILGUNG IN WERTPAPIEREN	
140 - TEILRÜCKZAHLUNG MIT ÄNDERUNG DES NENNWERTES	Anzeige der Rückzahlungsrate über
141 - TEILRÜCKZAHLUNG, GLEICHBLEIBENDER NENNWERT	:92A::RATE//15d bzw. :92F::RATE//3!a15d in der Sequenz E2

Sequenz D Corporate Action Details

:92A::RDIS//Reinvestment Discount Rate to Market

Für die Terminart 121 (Income-Fondsausschüttung) wird der Wiederanlagerabatt als optionales Feld neu in die Sequenz D aufgenommen. Die Anzeige erfolgt im Format :92A::RDIS//[N]15d.

Sequenz E Corporate Action Options

:98C::Deadlines

Die MT564 Notifications zeigen heute bei Non Income Events in den E-Sequenzen nur den Weisungstermin der CBF als 98A::RDDT (Datum, ohne Uhrzeit) an, soweit für den Event relevant. Künftig können bis zu vier Deadlines für Bezugsrechte und Umtäusche ausgewiesen werden, die generell mit der Formatoption C (Datum und Uhrzeit) angezeigt werden.

Deadline	98C-Qualifier	E-Sequenzen
Deadline Früh für Bezug und Umtausch	EARD	EXER, SECU, CASH, CASE
Deadline CBF für Bezug und Umtausch	RDDT	EXER, SECU, CASH, CASE
Deadline Markt für Bezug und Umtausch	MKDT	EXER, SECU, CASH, CASE
Deadline Handel für Bezugsrechte	RDDT	BUYA, SLLE

Damit ergeben sich auch neue Versandzeitpunkte für den MT564 Reminder.

Reminder	Beschreibung
1. Reminder	<ul style="list-style-type: none"> • 2 Arbeitstage vor "Deadline Früh" am Abend • 2 Arbeitstage vor "Deadline CBF" am Abend • 2 Arbeitstage vor "Deadline Handel" am Abend
2. Reminder	<ul style="list-style-type: none"> • Versand am Morgen der "Deadline Früh" nach RT-STD, falls dieser Weisungstermin vorhanden. • Versand am Morgen der "Deadline CBF" nach RT-STD, falls dieser Weisungstermin vorhanden. • Versand am Morgen der "Deadline Handel" nach RT-STD, falls dieser Weisungstermin vorhanden. <p>Diese Reminder-Nachrichten enthalten wie heute schon zusätzlich die aktuellen Pending Trades in Verbindung mit nachfolgenden MT568-Nachrichten.</p>

Sequenz D Corporate Action Details

:98A::XDTE//Ex-Dividend or Distribution Date

Für die Terminarten 13x und 14x (Income-Rückzahlungen) wird in Anlehnung an die German Market Practice und Securities Market Practice Group das Feld :98A::XDTE aus der Sequenz D entfernt.

Sequenz E Corporate Action Options (NOAC), E1 Securities Movement

:98C::PAYD/Write-off Date for Issue Rights

Diese Erweiterung betrifft die E-Sequenz NOAC für die Terminarten 210/280 und 211/280 mit Bezugsrechten. Die heute schon dargestellte E-Sequenz für "No Action" wird im Falle eines vorhandenen STICHTAG ABWICKLUNG um eine Teilsequenz E1 für die Ausbuchung der Rechte ergänzt. Als Payment Date (:98A::PAYD) wird der STICHTAG ABWICKLUNG (Datum Ausbuchung Bezugsrecht) angezeigt.

Teilsequenz E2 Cash Movements, Anzeige des Wandelpreises bei Wandelanleihen

Für die Terminarten 280 und 281 wird im Falle von Wandelanleihen der MT564 um die Anzeige des Wandelpreises ergänzt. Die nachfolgende Tabelle gibt einen Überblick über die Felder, die in der Teilsequenz E2 herangezogen werden.

Feld / Format	Definition	Belegung
:90A::PRPP//4!c/15d :90B::PRPP//4!c/3!a15d	Generic Cash Price Paid per Product	Betrag bzw. Prozentsatz der Zuzahlung durch den Kunden
:90A::OFFR//4!c/15d :90B::OFFR//4!c/3!a15d	Generic Cash Price Received per Product	Betrag bzw. Prozentsatz der Auszahlung an den Kunden
:90B::EXER//4!c/3!a15d	Exercise Price	Wandelpreis als Betrag pro bezogener Titel (ohne eventueller Zu- oder Auszahlungen)
:92B::EXCH//3!a/3!a/15d	Exchange Rate	Umrechnungskurs, falls Währung zum Wandelpreis Währung zum Nennwert

MT564 Tax Pre-Notification

Die nachfolgend dargestellten Erweiterungen des SWIFT MT564 Service beziehen sich auf die Custody Services der CBF zur Vorabbefreiung von Steuern für bestimmte Märkte und Terminarten.

Fachliche Erläuterungen sind in der Kundeninformation [F-CON29](#) "Information zum CBF Release 21. November 2011" enthalten. An dieser Stelle werden nur die Erweiterungen des MT564-Formates dargestellt.

Sequenz	Feld	Qualifier und Beschreibung
A	23G	Zusätzliche Verwendung des Function Codes RMDR für den Versand eines Reminders zu Income Events, die dem CBF-Service der Vorabbefreiung von Steuern unterliegen. Der Zeitpunkt des Versandes ist vom jeweiligen Emissionsland des zugrunde liegenden Wertpapiers abhängig.
D	98C	Neuer Qualifier TAXB (Deadline for Tax Breakdown Instruction) zur Anzeige des Weisungstermins für die Instruktionen des Kunden, soweit CBF für den Event den Vorabbefreiungsservice für Steuern anbietet.
D	17B	CERT//Y. Der Indikator wird nur angezeigt, wenn die CBF zu dem Income Event den Service der Vorabbefreiung von Steuern anbietet.

Einer MT564 Tax Pre-Notification kann ein verlinkter MT568 mit weiteren Tax-Informationen folgen. Erweiterungen des bestehenden MT568 sind im nachfolgenden Kapitel [MT568 Corporate Action Narrative](#) auf Seite 2-12 beschrieben.

Die Kunden, die heute schon MT564 Notifications beziehen, bekommen diese zusätzlichen Tax-Informationen automatisch zu ihren bestellten Income Terminarten mitgeliefert. Im Rahmen ihres "Customising" wird CBF ihren Kunden zusätzlich die Möglichkeit bieten, ausschließlich MT564 Tax Pre-Notifications zu allen Income Events zu beziehen, die dem CBF-Service der Vorabbefreiung unterliegen.

Automatisierung von Events mit Erträgen in NCSC-Titeln (Wertpapierrechnung)

Die CBF führt für Non Income Distribution Events mit neuer ISIN = NCSC-Titel die automatisierte Buchung von NCSC-Titeln auf der CBL-Creation-Plattform ein. Die Kunden erhalten dadurch künftig von CBF auch den MT564 REPE zu Trades und MT566 Bestätigungen zu Buchungen auf ihren 6-series Accounts. Die MT564 REPE-Nachrichten zu NCSC-Titeln enthalten nachfolgende abweichende Inhalte gegenüber den Nachrichten zu CSC-Titeln.

MT564 REPE auf Basis von Trades:

Sequenz	Feld	Belegung
B2 Account Information	:97A::Safekeeping Account	6-series Account des Kunden in Creation
F Additional Information	:70E::Additional Text	:70E:ADTX//ADVICE OF NCSC-CLAIM FOR BOOKING ON YOUR CBL-ACCOUNT"
	:70E::Additional Text/ Trade Referenzen	Im Falle des MT564 REPE zu geblockten FoP-Instruktionen enthält TRADE REF die :20C::SEME des MT542 PREA ^{a)} (FoP-Instruktion in Creation), SETTLEMENT DATE das Datum an dem der MT542 PREA gesettelt werden soll, COUNTERPART das CBL-Konto der Gegenpartei und TR RELA die Auftragsnummer des zugrundeliegenden Trades in CASCADE.

- a. Kunden, die den "Blocking"-Service für Market-Claims in CASCADE nutzen, erhalten diesen Service auch für NCSC-Titel. CBF stellt auf der CBL-Creation-Plattform einen Claim als geblockt durch einen MT542 PREA ein. Für eine Aufhebung der Sperre via SWIFT muss der Kunde eine MT542 NEWM an CBL übermitteln mit Referenzierung auf die MT542 PREA. Hierzu ist in der A1 Linkages unter :20C::PREV die :20C::SEME aus der MT542 PREA zusammen mit der Texterklärung :70E::SPRO///RELEASE/ in der B1-Sequenz anzugeben. Bitte beachten Sie hierzu auch die Kundeninformation [A09076](#) "Neue Hold/Release-Funktion für Instruktionen zur Wertpapierabwicklung", durch die CBL veröffentlicht am 29. Mai 2009.

Die von CBF an CBL übermittelten FoP-Instruktionen (MT540 und 542) können auf der CBL-Creation-Plattform eindeutig über das Feld :22F::SETR/CEDE/CORP in der E-Sequenz identifiziert werden.

Bitte beachten Sie hierzu auch das "Functional Concept CBF: Beseitigung der Giovannini-Barrier 3", [F-6520](#), zu dem es in Kürze eine Aktualisierung geben wird.

2.2 MT566 Corporate Action Confirmation

Teilsequenz D2 Cash Movements

:19B::WITL/Withholding of Local Tax

Der Qualifier WITL für das Feld 19B wird nicht mehr in Teilsequenz D2 verwendet. Stattdessen werden in der Teilsequenz D2 die Qualifier TAXR bei Abzug der Deutschen Abgeltungsteuer und WITF bei Abzug ausländischer Quellensteuer angezeigt.

Teilsequenz B1 Financial Instrument Attributes

:22F::MICO//Method of Interest Computation Indicator

Für die Terminarten TA11x (Income-Zinszahlungen) wird die Zinsberechnungsmethode optional in Teilsequenz B1 aufgenommen. Die Anzeige erfolgt als Indikator im Format :22F::MICO//4!c. Die Schlüsselung des WM-Indikators F93 in den zulässigen SWIFT-Indikator erfolgt anhand der durch die German Market Practice festgelegten Mapping-Tabelle (veröffentlicht unter www.smpg.webexone.com).

Sequenz E Additional Information

:70E::ADTX (Trade Referenzen)

Im Falle der Bestätigung von Kompensationszahlungen auf Basis von Trades wird heute in den Referenzfeldern zum Trade für "Trade Day" und "Actual Settlement Date" das Datumsformat YY-MM-DD verwendet. Zur Vereinheitlichung der Trade Referenz mit dem MT564 REPE wird das Datumsformat im MT566 geändert nach YYYYMMDD.

Sequenz E Additional Information

:70E::TXNR (Wertlose Ausbuchung)

Im Falle der Terminart 222 (Withdrawal-Non Income) wird in der Sequenz E die Textkonstante "WITHDRAWEL OF INVALID SECURITIES" angezeigt, falls die Ausbuchung ohne Geldzahlung (wertlos) erfolgt.

Sequenz C Corporate Action Details

:70E::INCO (Tax-Informationen)

Für die Terminart 121 (Income-Fondsausschüttung) wird dieses Freitextfeld nicht mehr angezeigt. Die Informationen über die anteiligen Bemessungsgrundlagen werden jetzt in den strukturierten Feldern :92J::GRSS angezeigt.

Sequenz D Corporate Action Options und D2 Cash Movements

:92a::Rate (Income Events)

Die nachfolgenden Qualifier werden für MT566 Bestätigungen zu Income Terminarten nicht mehr in Sequenz D verwendet.

Qualifier	Definition	Belegung
ATAX	Additional Tax	Deutscher Solidaritätszuschlag
CHAR	Charges/Fees	Gebühren
GRSS	Gross Dividend Rate	Bruttodividende
INTP	Interest Rate Used for Payment	Zinssatz bezogen auf die aktuelle Zinszahlung
RATE	Applicable Rate	Rückzahlungsrate
WITL	Withholding of Local Tax	Deutsche Abgeltungsteuer oder ausländische Quellensteuer

Stattdessen werden künftig nachfolgende Qualifier in der Teilsequenz D2 angezeigt. Zu beachten ist, dass der Qualifier WITL ersetzt wird durch die Qualifier TAXR und WITF.

Qualifier	Definition	Belegung
ATAX	Additional Tax	Deutscher Solidaritätszuschlag
CHAR	Charges/Fees	Gebühren
GRSS	Gross Dividend Rate	Bruttodividende
INTP	Interest Rate Used for Payment	Zinssatz bezogen auf die aktuelle Zinszahlung
RATE	Applicable Rate	Rückzahlungsrate
TAXR	Withholding Tax Rate	Deutsche Abgeltungsteuer
WITF	Withholding of Foreign Tax	Ausländische Quellensteuer

Teilequenz D2 Cash Movements

:92J::GRSS//Proportional Disbursements

Im Falle der Terminart 121 (Income-Fonds ausschüttung) werden optional bis zu 3 neue Felder angezeigt zur Darstellung der Bemessungsgrundlagen für die Kapitalertragssteuer bzw. Quellensteuer.

Feld / Format	Definition	Belegung
:92J::GRSS//INCO/3!a15d	Income Portion	Bemessungsgrundlage für die Kapitalertragssteuer aus inländischen (Deutschen) Dividenden
:92J::GRSS//INTR/3!a15d	Interest	Bemessungsgrundlage für die Kapitalertragssteuer oder Quellensteuer aus Zinsen
:92J::GRSS//SOIC/3!a15d	Sundry/Other Income	Bemessungsgrundlage für die Kapitalertragssteuer oder Quellensteuer aus ausländischen Dividenden

Sequenz D Corporate Action Options

:92A::RATE (Non Income Events)

Der Qualifier RATE wird als Rückzahlungsrate in MT566 Bestätigungen zu Non Income Terminarten nicht mehr in Sequenz D verwendet. Dies betrifft die Terminarten 220 (Ausbuchung w/ Gesamt rückzahlung), 222 (Ausbuchung wertloser Stücke) und 260 (Zusammenführung auf Lead Manager Konto).

Sequenz C Corporate Action Details

:92A::RDIS//Reinvestment Discount Rate to Market

Für die Terminart 121 (Income-Fonds ausschüttung) wird der Wiederanlage rabatt als optionales Feld neu in die Sequenz C aufgenommen. Die Anzeige erfolgt im Format :92A::RDIS//[N]15d.

Sequenz D, Teilsequenz D2

:92a::Rückzahlungsrate, 90a::Rückzahlungspreis

Für die Terminarten 13x und 14x (Income - Rückzahlungen) wird im MT564 als auch im MT566 die Anzeige von Rückzahlungsrate bzw. -preis vereinheitlicht, wie in nachfolgender Tabelle für den MT566 aufgeführt.

Terminart	SWIFT-Belegung
130 - GESAMTRÜCKZAHLUNG	Anzeige des Rückzahlungspreises über
131 - RÜCKZAHLUNG GENUSSRECHT	:90A::OFFR//PRCT/15d bzw.
132 - RÜCKZAHLUNG ZERTIFIKAT	:90B::OFFR//ACTU/3!a15d in der Sequenz D
133 - LIQUIDATION FONDS	
134 - BARAUSGLEICH TILGUNG IN WERTPAPIEREN	
140 - TEILRÜCKZAHLUNG MIT ÄNDERUNG DES NENNWERTES	Anzeige der Rückzahlungsrate über
141 - TEILRÜCKZAHLUNG, GLEICHBLEIBENDER NENNWERT	:92A::RATE//15d bzw. :92F::RATE//3!a15d in der Sequenz D2

Sequenz C Corporate Action Details

:98A::XDTE//Ex-Dividend or Distribution Date

Für die Terminarten 13x und 14x (Income-Rückzahlungen) wird in Anlehnung an die German Market Practice und Securities Market Practice Group das Feld :98A::XDTE aus der Sequenz C entfernt.

Automatisierung von Events mit Erträgen in NCSC-Titeln (Wertpapierrechnung)

Die CBF führt für Non Income Distribution Events mit neuer ISIN = NCSC-Titel die automatisierte Buchung von NCSC-Titeln auf der CBL-Creation-Plattform ein. Die Kunden erhalten dadurch künftig von CBF auch den MT564 REPE zu Trades und MT566 Bestätigungen zu Buchungen auf ihren 6-series Accounts. Die MT566 Nachrichten zu NCSC-Titeln enthalten nachfolgende abweichende Inhalte gegenüber den Nachrichten zu CSC-Titeln.

MT566 Bestätigungen auf Basis des Bestands:

Sequenz	Feld	Belegung
D1 SECMOVE für Gutschrift neue ISIN (NCSC-Titel): Neue Teilsequenz D1b Receiver/Deliverer	:95P::Place of Settlement :97A::Safekeeping Account	:95P::PSET//CEDELULL :97A::SAFE//CBL 6-series Account des Kunden im Format 35x
E Additional Information	:70E::Additional Text	:70E::ADTX//10*35x mit Zeile 1: "KADI-LFNR" + " " + 5-stellige KADI-Laufnummer Zeile 2: "COL TRN" + Transaction Number (Inhalt der SEME-Sender's Message Reference) der MT544-Instruktion von CBL and CBF zur Bestätigung der Einbuchung neuer Titel.

MT566 Bestätigungen auf Basis von Market oder Reverse Claims:

Sequenz	Feld	Belegung
B Underlying Securities	:97A::Safekeeping Account	:97A::SAFE//CBL 6-series Account des Kunden im Format 35x
	:94F::Place of Safekeeping – Financial Instrument held at an International Central Securities Depository	:94F::SAFE//ICSD/CEDELULL
E Additional Information	:70E::Additional Text	:70E::ADTX//10*35x mit der Trade Referenz: Zeile 1: COMPENSATION OF S/E TRADE oder COMPENSATION OF OTC TRADE Zeile 2: TRADE REF + COL Transaction Number (SEME) der MT544/546, erstellt durch CBL Zeile 3: TR RELA + CASCADE Underlying Trade Number Zeile 4: TRADE DAY RELA + CASCADE Underlying Trade Date Zeile 5: COUNTERPART + CBL account number der Gegenpartei Zeile 6: KADI-LFNR + " " + KADI-Laufnummer

Neben den MT564 REPE und MT566 Nachrichten der CBF erhalten Kunden zu den auf der CBL-Creation-Plattform abgewickelten FoP-Instruktionen das bei der CBL bestellte Reporting zum Settlement. Die von CBF an CBL übermittelten FoP-Instruktionen (MT540 und 542) können auf der CBL-Creation-Plattform eindeutig über das Feld :22F::SETR/CEDE/CORP in der E-Sequenz identifiziert werden.

Bitte beachten Sie hierzu auch das "Functional Concept CBF: Beseitigung der Giovannini-Barrier 3", [F-CON29](#), zu dem es in Kürze eine Aktualisierung geben wird.

2.3 MT568 Corporate Action Narrative

Sequenz C Additional Information

:70E::TAXE

Wird eine MT568 Nachricht zu einer MT564 Tax Pre-Notification versendet, so werden unter :70E::TAXE (Taxation Conditions) zusätzliche Tax-Informationen angezeigt, die in den strukturierten Feldern des MT564 nicht abgebildet werden können.

3. Kundenstammdaten

In diesem Kapitel sind die Änderungen zum KUSTA Datenträger für ICP Teilnehmer beschrieben. Der Satzaufbau für CBF-Kunden bleibt unverändert.

3.1 KUSTA Datenträger

Satzaufbau für ICP Teilnehmer – Datenfelder

Folgende Datenfelder werden sich im KUSTA Datenträger ändern:

- Feld 4: Ausländische Konten. Das Feld wird von 15 auf 35 Zeichen erweitert.
- Feld 10: Postfach. Das Feld Postfach entfällt, dadurch ändert sich die "Field number" der folgenden Felder in der Tabelle unten.
- Feld 17: Füller. Das Feld wird von 71 auf 62 Zeichen verkürzt, um die bisherige Satzlänge zu erhalten.

Field number	Field name	Format
1	Satztyp	N(3)
2	Status	A(1)
3	KV/CL	N(3)
4	Ausländische Kontonr.	A(35)
5	Name Kurzform	A(35)
6	Name aktuell	A(35)
7	Name Fortsetzung	A(35)
8	Name Zusatz	A(35)
9	Strasse	A(30)
10	Postfach	A(10)
11	Länderkennzeichen	A(3)
12	Postleitzahl	A(5)
13	Ort	A(30)
14	Kontotyp	N(3)
15	CBF-ID	N(8)
16	SWIFT-Adresse	A(12)
17	Füller	A(62)

CBF SWIFT & Connectivity Änderungen – Updates

Cut Over

Die Delta-Datei am Montag nach dem Releaseeinsatz wird wie üblich nur Einträge mit inhaltlichen Änderungen enthalten.

Zusätzliche Gesamt – Datei

Kunden, die einmalig eine komplette Datei im neuen Format benötigen, können dies über den bestehenden Weg beantragen:

Formula [Nr. 46](#) "KUSTA Datenträger" auf der Clearstream Website www.clearstream.com unter Publications & Downloads \ Connectivity \ CASCADE \ Formulare.

Leerseite

Kontakt

inquiries@clearstream.com

www.clearstream.com

Veröffentlicht von

Clearstream Banking Frankfurt

Eingetragene Adresse:

Clearstream Banking AG, Frankfurt
Mergenthalerallee 61
D-65760 Eschborn

Postanschrift:

Clearstream Banking
D-60485 Frankfurt am Main

August 2011

Dokumentnummer: F-CON20
