

CBF Release Mai 2010

**Aktualisierte Information zum Release
am 31. Mai 2010**

CBF Release Mai 2010

Mai 2010

Dokumentennummer: F-CON25

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 (2010). Alle Rechte vorbehalten.

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

Vorwort

Clearstream Banking¹ hat Sie am 9. März 2010 mit der ‚vorläufigen Release Information F-CON027‘ über die geplanten Verbesserungen im Rahmen des Mai 2010 Releases informiert.

Die nun vorliegende ‚Upgrade Information‘ stellt Ihnen umfassend und detailliert die Neuerungen vor, die am 31. Mai 2010 für folgende Servicebereiche eingeführt werden:

- Clearing und Settlement Services
- Connectivity Services
- Custody Services
- Global Securities Financing Services

Wir bitten Sie, das Dokument an alle betreffenden Stellen in Ihrem Hause weiterzuleiten.

Ansprechpartner

Bitte wenden Sie sich an unseren Customer Service Domestic oder Customer Service Connectivity bei weiteren Informationsbedarf oder Fragen.

Clearstream Banking Frankfurt

Customer Service Domestic Tel: +49 - (0) 69 - 211 - 1 11 77
(Allgemeine Anfragen) Fax: +49 - (0) 69 - 211 - 61 11 77
E-Mail: csdomestic@clearstream.com

Customer Service Connectivity Tel: +49 - (0) 69 - 211 - 1 15 90
(Connectivity Services) Fax: +49 - (0) 69 - 211 - 61 15 90
E-Mail: connectfrankfurt@clearstream.com

Wir weisen unsere Kunden an dieser Stelle darauf hin, dass Telefongespräche mit Clearstream Banking - wie in der Finanzbranche üblich - in einigen Bereichen aufgezeichnet werden. Dies soll gewährleisten, dass sowohl die Interessen der Clearstream Banking als auch die ihrer Kunden bei Missverständnissen oder Fehlübertragungen geschützt sind.

Zu den Bereichen, in denen die Telefongespräche aufgezeichnet werden, gehören der Customer Service, der Treasury Dealing Room und das Back Office. Die betreffenden Telefonleitungen unterliegen einer stetigen Wartung, um einen einwandfreien Betrieb sicherzustellen.

1. Clearstream Banking bezieht sich in dieser Upgrade Information auf Clearstream Banking AG, Frankfurt (CBF). CBF ist ein Unternehmen der Gruppe Deutsche Börse.

Vorwort

Leerseite.

Inhalt

| | |
|--|------------|
| 1 Clearing und Settlement | 1-1 |
| 1.1 CASCADE | 1-1 |
| 1.1.1 Zusätzliche Fremdwährungen in CASCADE | 1-1 |
| 1.1.2 Global Bearer Certificates (GBC) - Plausibilitätsprüfung auf Feldebene | 1-2 |
| 1.2 EUR-Geldverrechnung | 1-5 |
| 1.2.1 Geldreporte (Geldtagesauszug, Kontoinformation, Geldumsatzliste, Nettingliste) | |
| 1.2.2 Erweiterung der Geldinformationen-Anzeige unter KNZI | 1-6 |
| 1.2.3 Änderung bei Dauerreservierungsaufträgen auf Basis Cash Forecast mit zusätzlicher Anpassung | 1-9 |
| 1.2.4 Erweiterter Euro Cash Clearing Report (ECC) / MT 942 | 1-10 |
| 1.3 Monatskontoblatt | 1-10 |
| 1.3.1 Zusätzliche Information im Monatskontoblatt/Depotbuch vereinfacht die historische Recherchen | |
| 2 Connectivity Services | 2-1 |
| 2.1 Versand von Fehlermeldungen für ISO15022 Nachrichten in englischer Sprache | 2-1 |
| 2.2 Weitere Funktionen für Nachrichten aus dem Bereich Namensaktien im Format ISO15022 | 2-1 |
| 2.2.1 Angabe des Grundes bei RS-Bestandsüberträgen | 2-1 |
| 2.2.2 Zusätzliches Feld "Postleitzahl" bei RS-Nachrichtentypen | 2-1 |
| 2.2.3 Besonderheit bei der Postleitzahl ausländischer Adressen | 2-2 |
| 2.2.4 Anpassungen bei der Prüfung des Eintragungs-Grundes im MT500 | 2-2 |
| 2.2.5 Zusätzliches Sonderzeichen für RS-Aufträge | 2-2 |
| 2.2.6 Bestandsabfrage Namensaktien in ISO15022-fähigem Format | 2-2 |
| 2.3 Änderungen für Nachrichten aus dem Bereich Namensaktien im Format ISO7775 | 2-3 |
| 2.3.1 Besonderheit bei der Postleitzahl ausländischer Adressen | |
| 2.4 Wegfall der MT548 "Receive Free Information" für Geschäfte ohne Matchpflicht | 2-3 |
| 2.5 Standardisierung von "UNMATCH-Nachrichten" mittels MT548 | 2-3 |
| 2.6 Anzeige der originalen Auftrags-Referenz in den Settlement Bestätigungen für die Auftragsarten 16 und 18 | 2-3 |
| 3 Custody Services | 3-1 |
| 3.1 Rückzahlung von Wertpapieren | 3-1 |
| 3.2 MT564, MT566 für Ausschüttung von Genussrechten (Terminart 126) | 3-1 |
| 3.3 Neue Anforderungen für Steuerbescheinigungen | 3-1 |
| 4 Global Securities Financing Services | 4-1 |
| 4.1 Erweiterte Re-Use Funktionalität in Xemac | 4-1 |
| 4.2 Verbesserte Referenzierung von Leihe-Geschäften im CASCADE-Reporting | 4-1 |

Inhalt

1 Clearing und Settlement

1.1 CASCADE

1.1.1 Zusätzliche Fremdwährungen in CASCADE

Die neuen Fremdwährungen sind Hongkong Dollar, Ungarische Forint und Singapur Dollar. Kunden der CBF können zukünftig Geschäfte in diesen Währungen instruieren.

Die zusätzlichen zugelassenen Währungen werden in der CASCADE Online-Maske unter TRAN: KVAV FC: IW angezeigt.

```

TRAN: KVAV FC: IW SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          WAHRUNGSPARAMETER          VEROFFENTLICHUNGEN

AKTUELLE DEADLINE/WAEHRUNG FUER VALUTAGERECHTE GELDANSCHAFFUNGEN UND
AUSZAHLUNGEN: www.clearstream.com

WRG  WAHRUNGSPARAMETER          MATCH-TOLERANZGRENZE BEI GEGENWERT
-----
AUD  Australien                  30,00
CAD  Kanada                      35,00
CHF  Schweiz                     25,00
CZK  Tschechien                   900,00
DKK  Dänemark                     175,00
EUR  EWWU                        25,00
GBP  Großbritannien              15,00
HKD  Hongkong                    280,00
HUF  Ungarn                      6.600
JPY  Japan                       3.500
MKN  Mexiko                      200,00
NOK  Norwegen                    180,00
PLN  Polen                       100,00

-- ID-KZ: XXXXXXXXXX -- PW:          ----- B79074MX -- 08/02/10 -- 13:59:09 --

PF3:Ruecksprung  PF4:Abbruch  PF6:Vor

```

Online Maske mit zusätzlicher Währung

```

TRAN: KVAV FC: IW SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG           WAHRUNGSPARAMETER           VEROFFENTLICHUNGEN

AKTUELLE DEADLINE/WAEHRUNG FUER VALUTAGERECHTE GELDANSCHAFFUNGEN UND
AUSZAHLUNGEN: www.clearstream.com

WRG  WAHRUNGSRAUM           MATCH-TOLERANZGRENZE BEI GEGENWERT
---  -----
SEK  Schweden                200,00
SGD  Singapur                50,00
TRY  Türkei                  35,00
USD  USA                     25,00
ZAR  Sudafrrika             120,00

-- ID-KZ: XXXXXXXXXXXX -- PW:          ----- B79074MX -- 08/02/10 -- 14:00:10 --
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
    
```

Online Maske mit zusätzlicher Währung

1.1.2 Global Bearer Certificates (GBC) - Plausibilitätsprüfung auf Feldebene

Die CASCADE Eingabemasken der Transaktion KVEE mit den Funktionscodes UT und RT für den Umtausch und Rücktausch von "Global Bearer Certificates"-Wertpapieren werden mit zusätzlichen Plausibilitätsprüfungen auf Feldebene versehen.

Bei der Online Erfassung von Umtausch und Rücktausch müssen für bestimmte Wertpapiere aus dem Markt Grossbritannien Angaben zur Stamp Duty erfolgen. Einzelheiten können unter www.clearstream.com unter Publications & Downloads/CASCADE Market Guide/Exchange and Re-exchange of Global Bearer Certificates Guide entnommen werden.

Bei der Erfassung einer UMTAUSCH Instruktion für Wertpapiere, die in WSS mit LGL/LGS 271/001 verschlüsselt sind, wird eine Prüfung im Feld "LIEFERUNG-VON NAME" auf den CREST-Code des Kontrahenten (abhängig vom jeweiligen GBC-Markt bzw. GBC-Lagerstelle) durchgeführt.

Die Angaben zum Kontrahenten (CREST Konto Nr.) müssen bei der Instruktionsart 07 in einem speziellen Format erfolgen.

Verschlüsselung der ISIN in WSS mit LGL/LGS 271/001

Die Instruktionseingabe muss mit dem Wert "CRST/" eingegeben werden. Danach ist nur noch die Eingabe von bis zu 5 Stellen (alphanumerisch) möglich. Alle anderen Angaben werden je nach erfasster ISIN mit einer Fehlermeldung abgelehnt.

Verschlüsselung der ISIN in WSS ohne LGL/LGS 271/001

Die Instruktionseingabe bezieht sich ebenfalls auf Global Bearer Certificates. Die Instruktionseingabe muss ohne den Wert "CRST/" eingegeben werden. Stattdessen wird das Feld "LIEFERUNG-VON-NAME" geprüft. Das entsprechende Feld "LIEFERUNG-VON-NAME" muss den Wert "BIC/" und den

dazugehörenden 8stelligen BIC aufweisen. Es wird geprüft, dass die ersten 6 Stellen nur Großbuchstaben und die letzten 2 Stellen Großbuchstaben oder Zahlen enthalten. Alle anderen Angaben werden mit Fehlerhinweis "FÜR DIESE ISIN NUR BIC DES KONTRAHENTEN MÖGLICH" abgelehnt.

```

TRAN: KVEE FC: UT SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      UMTAUSCH / ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: _____  AUFTNR: _____      VWA:
LAST-KTO : 7961 000
GUT-KTO  : _____
WKN      : I _____
NOMINALE : _____      EINHEIT:      ST-ART:
TRADE-DATE: _____      EXT.SET-DAY: _____
CBF-LAG  :
KUNDENREFERENZ: ___ - ___ - ___
LIEFERUNG-VON NAME: CRST/XXXXX
TEXT: _____

-- ID-K2: 7999260001 -- FW:      ----- B79074MX -- 22/03/10 -- 13:23:17 --
PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
    
```

Online Maske mit Beispiel für Instr. Art 07 Umtausch mit hervorgehobenem Kontrahentenfeld

Analog dazu wird bei der Erfassung der RÜCKTAUSCH Instruktion eine Prüfung auf das Feld "LIEFERUNG-AN NAME" stattfinden.

Bei der Erfassung einer RÜCKTAUSCH Instruktion für Wertpapiere, die in WSS mit LGL/LGS 271/001 verschlüsselt sind, wird eine Prüfung im Feld "LIEFERUNG-AN NAME" auf den CREST-Code des Kontrahenten (abhängig vom jeweiligen GBC-Markt bzw. GBC-Lagerstelle) durchgeführt.

Die Angaben zum Kontrahenten (CREST Konto Nr.) müssen bei der Instruktionsart 09 im Feld "LIEFERUNG-AN NAME" hinter der Eingabe von "CRST/" erfolgen.

Verschlüsselung der ISIN in WSS mit LGL/LGS 271/001

Die Instruktionseingabe muss mit dem Wert "CRST/" eingegeben werden. Danach ist nur noch die Eingabe von bis zu 5 Stellen (alphanumerisch) möglich. Alle anderen Angaben werden je nach erfasster ISIN mit einer Fehlermeldung abgelehnt.

Verschlüsselung der ISIN in WSS ohne LGL/LGS 271/001

Die Instruktionseingabe bezieht sich ebenfalls auf Global Bearer Certificates. Die Instruktionseingabe muss ohne den Wert "CRST/" eingegeben werden. Stattdessen wird das Feld "LIEFERUNG-AN-NAME" geprüft. Das entsprechende Feld "LIEFERUNG-AN-NAME" muss den Wert "BIC/" und den dazugehörenden 8stelligen BIC aufweisen. Es wird geprüft, dass die ersten 6 Stellen nur Großbuchstaben und die letzten 2 Stellen Großbuchstaben oder Zahlen enthalten. Alle anderen Angaben werden mit Fehlerhinweis ("FÜR DIESE ISIN NUR BIC DES KONTRAHENTEN MÖGLICH") abgelehnt.

```

TRAN: KVEE FC: RT SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      RUECKTAUSCH / ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: _____      AUFTNR: _____      VWA:
LAST-KTO : _____
GUT-KTO  : 7961 000
WKN      : I _____

NOMINALE : _____      EINHEIT:      ST-ART:
SET-DAY  : 23.03.2010
TRADE-DATE: _____      EXT.SET-DAY: _____
CBF-LAG  :

KUNDENREFERENZ: ____ - ____ - ____
LIEFERUNG-AN NAME : CRST/KXXXXX_____
ADRESSE: _____
BEGUENSTIGTER NAME: _____
ADRESSE: _____
TEXT    : _____

-- ID-KZ: 7999260001 -- PW:      ----- B79074MX -- 22/03/10 -- 13:24:17 --
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch
    
```

Online Maske mit Beispiel für Instr. Art 09 Umtausch mit hervorgehobenem Kontrahenten Feld

Für folgende Instruktionsarten kann im Feld "TEXT" die ergänzende Information, bezüglich der steuerlichen Behandlung des entsprechenden Wertpapiers in dem vorgegebenen Feld hinzugefügt werden. Die Angabe zur Stamp Duty muss ebenfalls erfolgen. Dazu muss im Feld "Text" die Eingabe des Codewortes "GBTX" erfolgen.

```

TRAN: KVEE FC: UT SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      UMTAUSCH / ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: _____      AUFTNR: _____      VWA:
LAST-KTO : 7961 000
GUT-KTO  : _____
WKN      : I _____

NOMINALE : _____      EINHEIT:      ST-ART:
TRADE-DATE: _____      EXT.SET-DAY: _____
CBF-LAG  :

KUNDENREFERENZ: ____ - ____ - ____
LIEFERUNG-VON NAME: _____
TEXT: /GBTX/ _____

-- ID-KZ: 7999260001 -- PW:      ----- B79074MX -- 22/03/10 -- 13:00:00 --
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch
    
```

Online Maske mit Beispiel für Instr. Art 07 Umtausch mit hervorgehobenem Textfeld

```

TRAN: KVEE FC: RT SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      RUECKTAUSCH / ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: _____      AUFTNR: _____      VWA:
LAST-KTO : _____
GUT-KTO  : 7961 000
WKN      : I _____

NOMINALE : _____      EINHEIT:      ST-ART:
SET-DAY  : 22.03.2010
TRADE-DATE: _____      EXT.SET-DAY: _____
CBF-LAG  :

KUNDENREFERENZ: ____ - ____ - ____
LIEFERUNG-AN NAME : _____
ADRESSE: _____
BEGUENSTIGTER NAME: _____
ADRESSE: _____
TEXT    : /GBTX/ _____

-- ID-K2: 7999260001 -- PW:      ----- B79074MX -- 22/03/10 -- 13:05:46 --

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch

```

Online Maske mit Beispiel für Instr. Art 09 Rücktausch mit hervorgehobenem Textfeld

Löschung von Aufträgen mit Auftragsart 07 und 09:

Für UMTAUSCH Instruktionen mit Auftragsart 07 gilt, dass diese Aufträge nach der erfolgreichen Auftragserteilung nicht gelöscht werden können. Wenn eine Löschung oder Änderung eines Auftrages mit Auftragsart 07 erfolgen soll, ist der Customer Service (Tel. 11177) zu kontaktieren oder eine Free Format MT599 Nachricht an die Abteilung OSG / PSG zu senden.

Für RÜCKTAUSCH Instruktionen mit Auftragsart 09 erfolgen keine Änderung, d. h. diese können wie bisher nicht gelöscht werden.

Die generellen Anforderungen aus der Veröffentlichung "Exchange and Re-Exchange of Global Bearer Certificates Guide" (verfügbar über die Clearstream Homepage) und die Eingabemasken in CASCADE bleiben unverändert bestehen.

1.2 EUR-Geldverrechnung

1.2.1 Geldreporte (Geldtagesauszug, Kontoinformation, Geldumsatzliste, Nettingliste)

Die Geldreporte werden zukünftig statt derzeit ab 18:00 Uhr bereits um 15:00 Uhr übertragen. Sollte sich in Ausnahmefällen der Abschluss der DD2-Geldverrechnung über 15:00 Uhr hinaus verzögern, wird die Übertragung der v. g. Geldreporte ebenfalls später erfolgen.

In der Übertragung enthalten sind:

- Ein Geldtagesauszug jeweils für die DD1- und DD2-Verrechnung. Darin sind bis zu 9 Salden, die jeweils mit TARGET2 verrechnet werden, ausgewiesen

- Eine Kontoinformation pro Geldverrechnungskonto mit den zusammengefassten Umsätzen aus allen 8 Vorfinanzierungszyklen
- Eine Geldumsatzliste pro CBF-Konto mit den zusammengefassten Umsätzen aus allen 8 Vorfinanzierungszyklen
- Nettinglisten werden für jeden einzelnen Verrechnungssaldo erstellt (2 oder mehr pro DD-Zyklus)

Alle Geldumsätze können darüber hinaus auch online in CASCADE über die Transaktion KNZI IN / ID eingesehen werden.

1.2.2 Erweiterung der Geldinformationen-Anzeige unter KNZI

Über diese Transaktion werden die einzelnen Salden bzw. die Einzelumsätze aufgerufen, die mit TARGET2 gemäß der ASI Prozedur 3 innerhalb der DD1 und DD2-Geldverrechnungsprozesse verrechnet werden.

Nutzt ein Kunde die Netting-Funktion, d.h. werden über sein CBF-Konto die Salden für mehrere CBF Konten in einer Summe akkumuliert über TARGET2 verrechnet, werden die einzelnen Beträge pro CBF-Konto separat ausgewiesen.

Zur Ermittlung des tatsächlich gutgeschrieben oder belasteten Betrages über alle Soll- und Habensalden hinweg, wurden die Selektionskriterien der CASCADE Online-Anzeige KNZI wie folgt erweitert:

- Selektion auf Soll/ bzw. Haben-Umsätze (gültig für KNZI IN und ID)
- Selektion per ISIN (nur gültig für KNZI ID)
- Instruktions-ID [jeder Umsatz unter KNZI IN oder KNZI ID erhält eine eindeutige Instruktions-ID, nach der bei einer Selektionsauswahl ebenfalls selektiert werden kann]

Für CASCADE-PC-Nutzer ist diese Funktionalität mit dem CASCADE PC Release im November 2010 geplant.

```

TRAN: KNZI FC: ID SB: ##01.06.2010

      KAPITALDIENSTE UND SONSTIGE GELDUMSÄTZE  I N F O R M A T I O N

      IK  KAPITALDIENSTE FÜR STD
      IN  GENETTETE INSTRUKTIONEN FÜR DD-VERARBEITUNG
      ID  DETAIL INSTRUKTIONEN FÜR DD-VERARBEITUNG

ZUSÄTZLICHE AUSWAHL
GELDKONTO          : 7930 ____
RTGS-KONTO         :                SOLL/HABEN (S/H/ ) :
TAG DER GELDVERRECHNUNG: _____ ( BIS: _____ )
VERARBEITUNGSLAUF : _____ PAKET-NR.           : ____
BUCHUNGSTEXT       : _____ LAUF-NR.           : _____
VALUTA              : _____ TERMINART         : _____
STATUS              : _____ HAUPTZAHLSTELLE (MPA) : _____
URSPRUNG            : _____ ISIN                : _____
                    : _____ INSTRUKTIONS-ID    : _____

-- ID-KZ: 7930260001 - PW:          ----- B793050I -- 01/06/10 -- 09:45:57 --

PF3:Rucksprung  PF4:Abbruch
    
```

In den entsprechenden Listenanzeigen für die Funktionen IN und ID wurden im Rahmen der Selektion nach Soll und Haben ebenfalls weitere Felder in der Kopfzeile eingefügt, die erweiterte Informationen über die jeweiligen Salden bei entsprechender Selektion ausweisen. Für KNZI / IK werden die erweiterten Informationen ebenfalls in der Kopfzeile angezeigt; eine Selektion nach Soll und Haben ist hier jedoch nicht notwendig und wird daher nicht ermöglicht.

Beispiel für Funktion IN bei Selektion über Konto, Lauf und Soll/Haben = leer:

```

TRAN: KNZI FC: IN SB: 7930##01.06.2010#DD1

GENETTETE INSTRUKTIONEN FÜR DD-VERARBEITUNG / I N F O R M A T I O N
ANE. AUFTRÄGE: 4 1 SEITE 1
83.642,25 S 67.995,29 H SALDO: 15.646,96 S

K GELDVERR. LAUF RTGS-KONTO KTS WG. PAKET BETRAG IN EUR ZA C VS
-----
- 01.06.2010 DD1 HABADEFFXXX 7930 9 3.788,21 S N 350
- 01.06.2010 DD1 HABADEFFXXX 7930 3030 9 67.995,29 H J 350
- 01.06.2010 DD1 HABADEFFXXX 7930 3031 9 13.250,18 S N 350
- 01.06.2010 DD1 HABADEFFXXX 7930 3032 9 66.076,80 S J 350
- 01.06.2010 DD1 HABADEFFXXX 7930 3033 9 527,06 S N 350

-- ID-KZ: 7930000138 -- PW: ----- B79305JA -- 01/06/10 -- 13:15:50 --
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF7:Zurück PF8:Vor
    
```

Die Detailinformationen zu den Einzelumsätzen unter Funktion ID wurden umgruppiert und erweitert. Die Informationen werden über zwei Seiten verteilt und um folgende Felder erweitert:

- Referenz (wird im Falle der durch CBF manuell erfassten Geldumsätze angezeigt)
- Genettet Kontostamm (zeigt den zugehörigen Kontostamm im Falle der Netting-Funktion an)
- ISIN
- Instruktions-ID (eindeutige Kennung für den Detailumsatz unter Funktion ID)
- Instr.-ID genettet (eindeutige Kennung für den dazugehörigen, genetteten Umsatz unter Funktion IN)

Beispiel für Funktion ID (Seite 1):

```
TRAN: KNZI FC: ID SB: 3030#000#01.06.2010#  
  
DETAIL INSTRUKTION FÜR DD-VERARBEITUNG / I N F O R M A T I O N SEITE 1  
  
TAG DER GELDVERRECHNUNG : 01.06.2010  
VERARBEITUNGSLAUF : DD1 PAKET-NR : 1  
  
RTGS-KONTO (SOLL) : BIC DAKVDEFFA2  
RTGS-KONTO (HABEN) : BIC HARADEFFMXX  
KONTO-SOLL : 7750 000 CBF-GEGENKONTO  
KONTO-HABEN : 2030 000 HANDELSBANK  
BETRAG : 4.000.906,02 EUR  
  
BUCHUNGSTEXT : 300 ZINSEN  
REFERENZ :  
VALUTA : 03.03.2009 GENETTET KONTOSTAMM : 7930  
CUSTODY : J ISIN : DE1234567890  
T2-RELEVANT : J INSTRUKTIONS-ID : 123  
URSPRUNG : KADI INSTR-ID GENETTET : 53  
STATUS : 350 VERARBEITET  
  
-- ID-KZ: 3030000138 -- FW: ----- B30305JA -- 01/06/10 -- 13:03:10 --  
  
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF8:Vor
```

Auf Seite 2 der Detailinformationen werden folgende neue custody-relevante Informationen zur Verfügung gestellt:

- Endbegünstigter (entspricht dem Kundenkonto auf das sich die Gutschrift oder die Belastung bezieht)
- Nominale
- Verarbeitungsart (liefert Information, ob Buchung im Rahmen einer Stornierung oder einer regulären Verarbeitung erfolgte)
- BID (Bezugsidentifikator)
- Tag der Fälligkeit

```

TRAN: KNZI FC: ID SB: 3030#000#01.06.2010#
DETAIL INSTRUKTION FÜR DD-VERARBEITUNG / I N F O R M A T I O N      SEITE 2

ENGBEGÜNSTIGTER      : 3030 000

NOMINALE              : 123456789012,34 EUR

LAUF-NR./ORIG-LAUF-NR : 48105 / 48100
TERMINART             : 110
HAUPTZAHLSTELLE     : 2007
ISIN                  : DE1234567890
VERARBEITUNGSART     : 000 NORMALLAUF
BID                   : 1234567890123
TAG D.FÄLLIGKEIT     : 01.06.2010

-- ID-KZ: 3030000138 -- PW:          ----- B30305JA -- 01/06/10 -- 13:03:10 --
PF3:Rucksprung  PF4:Abbruch  PF7:ZURÜCK  PF8:Vor

```

1.2.3 Änderung bei Dauerreservierungsaufträgen auf Basis Cash Forecast mit zusätzlicher Anpassung

Bisher wurde für die Erteilung eines Dauerreservierungsauftrages, für den im Cash Forecast ein Dispositionsbetrag von 0 EUR errechnet wurde, der vom Kunden vorgegebene Festbetrag, nicht berücksichtigt. Zukünftig wird der im Feld Festbetrag hinterlegte EUR-Betrag als Dispositionspuffer berücksichtigt.

Diese Dauerreservierungsaufträge bieten Ihnen die Möglichkeit, den im Cash Forecast errechneten Liquiditätsbedarf (=Akt. Dispositionsbetrag) mit zusätzlichen "Sicherheitsmargen" für automatisch generierte Reservierungsaufträge zu kombinieren. Somit verringert sich das Risiko von Regulierungsausfällen auf Grund mangelnder Liquiditätsbereitstellung bei größeren Abweichungen vom Cash Forecast.

Bisher wurde für die Erteilung eines Dauerreservierungsauftrages, für den im Cash Forecast ein Liquiditätsbedarf von 0 EUR errechnet wurde, der vom Kunden vorgegebene Festbetrag, bei der Option "Cash Forecast errechneter Liquiditätsbedarf plus zusätzliche Anpassung (Festbetrag) nur bis zur Höhe des Festbetrages berücksichtigt.

Zukünftig wird der im Feld Festbetrag hinterlegte EUR-Betrag als genereller Dispositionspuffer berücksichtigt, auch wenn der Cash Forecast einen positiven Betrag ausweist, der höher als die zusätzliche Anpassung ist.

Folgende Tabelle erläutert die neue Regel in einem Beispiel

| Zusätzliche Anpassung (Festbetrag) | Cash Forecast | Aktueller Dispositions-betrag | Angeforderter Betrag (ALT) | Angeforderter Betrag (NEU) |
|------------------------------------|---------------|-------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 100 | 120 | 0 | 0 | 100 |
| 100 | 30 | 0 | 70 | 100 |
| 100 | 0 | 0 | 100 | 100 |
| 100 | -20 | 20 | 20 + 100 = 120 | 20 + 100 = 120 |

Bitte berücksichtigen Sie diese geänderte Kalkulierungsregel bei Ihrer Gelddisposition und den bereits erteilten Dauerreservierungsaufträgen.

1.2.4 Erweiterter Euro Cash Clearing Report (ECC) / MT 942

Der im November 2009 eingeführte Euro Cash Clearing Report (ECC), der alle Geldumsätze anzeigt, die auf CBF-Seite über TARGET2 verrechnet werden, wird um folgende Daten erweitert:

- "Nominale" bei Income Events und den zugehörigen Kompensationen in TAG 86, subfield 1 "Nominale"
- "Kontrahent" bei Kompensationen in TAG 61 subfield 9 "Kontrahent"
- "Corporate Action Referenz" in TAG 61 subfield 8 "CORP"

Bei Dividendenkompensationen für sicherungsübereignete Bestände in Xemac (Buchungstextschlüssel 425 - 427) wird statt der "Trade Reference" nunmehr die "Forderungsnummer" in TAG 61 subfield 7 mitgeliefert. Geldumsätze für KADI Events, die einen Stichtag vor dem CBF Einsatztermin hatten, werden noch im alten MT942 Format übermittelt.

Eine ausführliche Beschreibung des Datenformats ist im Connectivity Handbuch veröffentlicht, das über unsere Homepage (Publications & Downloads - Connectivity - CASCADE) abgerufen werden kann.

1.3 Monatskontoblatt

1.3.1 Zusätzliche Information im Monatskontoblatt/Depotbuch vereinfacht die historische Recherchen

Mit zusätzlichen Informationen im Monatskontoblatt/Depotbuch können Kunden zukünftig schneller, gezielter und einfacher in historischen Daten recherchieren. Zu diesen Informationen gehören der Schlusstag und der Abwicklungstag, die sowohl für die Umsätze aus OTC- als auch Börsengeschäften dokumentiert werden. Informationen wie der Schlusstag spielen insbesondere bei der Anwendung von grenzüberschreitenden Kompensationsregeln für Ertragszahlungen eine wichtige Rolle.

Derzeit wird im Monatskontoblatt/Depotbuch die Information zum ‚Schlusstag‘ (Trade Day) für Umsätze aus Börsengeschäften ausgewiesen, für OTC Umsätze ist es der ‚Abwicklungstag‘ (Settlement Day).

2 Connectivity Services

2.1 Versand von Fehlermeldungen für ISO15022 Nachrichten in englischer Sprache

Für alle ISO15022 Nachrichten, auf die eine Fehlermeldung (MT548 Negatives Business Validation Feedback) erzeugt wird, werden unabhängig von der Schnittstelle nur noch englische Fehlermeldungen im Textfeld 70D versendet.

2.2 Weitere Funktionen für Nachrichten aus dem Bereich Namensaktien im Format ISO15022

2.2.1 Angabe des Grundes bei RS-Bestandsüberträgen

CBF bietet ab dem Mai-Release im ISO15022-Format dem Kunden bei Bestandsüberträgen per MT542 die Möglichkeit, einen entsprechenden Grund für den Übertrag anzugeben. Dabei sind folgende Werte erlaubt:

- **000 = STANDARD** (der Aktionär verkauft seine Anteile)
- **001 = WERTPAPIER-LEIHE** (der Aktionär verleiht seine Anteile)

Die Umsetzung erfolgt, indem der Kunde über den Settlement Indicator im Feld :22F:: der Sequenz E "Settlement Details" und dem Qualifier OWNI (für den Bestandsübertrag in Namensaktien) zusätzlich im Feld :70E::DECL// der Sequenz E "Settlement Details" (Sub-Sequenz E1 "Settlement Parties") den Qualifier SETR mit einem dreistellig-numerischen Schlüssel für den Grund des RS-Bestandsübertrages mitgibt. Dort kann dann einer der oben genannten Werte eingefügt werden.

CBF wird den Übertraggrund dann auch in der entsprechenden Settlement Confirmation MT546 in der Sequenz E "Settlement Details" im Feld :70E::DECL//SETR berichten. Hier können dann folgende Werte erscheinen:

- **000 = STANDARD**
- **001 = WERTPAPIER-LEIHE**
- **002 = WERTPAPIER-ENTNAHME** (kann nur durch CBF eingegeben werden)
- **003 = AUTOMATISCH GENERIERT** (durch das System generiert)

2.2.2 Zusätzliches Feld "Postleitzahl" bei RS-Nachrichtentypen

CBF wird dem Kunden die Möglichkeit geben, auch per DFÜ sowohl eine Postleitzahl (PLZ) für den Ort als auch eine Postleitzahl für das Postfach anzugeben (bei der online Eingabe bereits möglich). Damit sind folgende Kombinationen erfassbar:

- **PLZ (ORT) + ORT** oder
- **PLZ (POSTFACH) + POSTFACH** oder
- **PLZ (ORT) + ORT** und **PLZ (POSTFACH) + POSTFACH**

Dies wird dargestellt über das Feld :13B::POST und :13B::PBOX der Sequenz C "Client Details" in der Sub-Sequenz C1 "Address". Das Feld "Postal Code" enthält zukünftig immer die PLZ des Wohnortes (Syntax:5 x) und das Feld "Post Box" enthält zukünftig immer sowohl die PLZ des Postfachs als auch

das Postfach (Syntax:5x++10x). Dabei ist zu beachten, dass der Wohnort weiterhin über das Feld :94D::CITY/// mit anzugeben ist.

Darüber hinaus gelten wie für CASCADE RS Online bei der Beauftragung per MT500 folgende Regeln:

- Nur für deutsche Adressen müssen die Felder POST und/oder PBOX ausgefüllt sein
- Das Feld POST ist mit dem Feld CITY verknüpft und dient nur zur Angabe der Postleitzahl eines Wohnortes. Die Postleitzahl, die zu einer Postfach-Adresse gehört, muss in das Feld PBOX eingegeben werden
- Das Feld CITY muss immer gefüllt sein, auch wenn ein Postfach als Adresse angegeben werden soll

2.2.3 Besonderheit bei der Postleitzahl ausländischer Adressen

Da ausländische Postleitzahlen oftmals nicht in das Formatfeld der Anwendung bei CBF passen, sollen bei RS-Aufträgen mit einem anderen Ländercode als "DE" (für Deutschland) die Felder :13B::POST// und :13B::PBOX// der Sequenz C "Client Details" (Sub-Sequenz C1 "Address") nicht mehr gefüllt werden. Auch hierbei ist zu beachten, dass der Wohnort weiterhin über das Feld :94D::CITY/// mit anzugeben ist. Andernfalls werden diese Aufträge von CBF per MT548 und einer entsprechenden Fehlermeldung abgelehnt.

2.2.4 Anpassungen bei der Prüfung des Eintragungs-Grundes im MT500

Momentan ist es möglich, bei einem MT500 mit dem Kennzeichen "Eintragung" im Feld :22F::RREA der Sequenz B "Registration Details" neben den fachlich gültigen Werten:

- INCR =increase of the share capital
- BONU =capitalisation issue
- EXWA =warrant exercise

auch ungültige Werte einzugeben. Die Eingabe ungültiger Werte wird zukünftig von CBF abgelehnt und per MT548 mit einer entsprechenden Fehlermeldung angezeigt.

2.2.5 Zusätzliches Sonderzeichen für RS-Aufträge

CBF wird für RS-Nachrichtentypen in der Sequenz C "Client Details" und der Sub-Sequenz C1 "Address" im Feld :94G::EMAI// (für e-Mail-Adresse) neben dem Sonderzeichen "@" ab dem Mai-Einsatz zusätzlich das Sonderzeichen "_" zulassen. Dies wird über die Maskierung "??6D" des hexadezimalen EBCDIC Codes erreicht.

2.2.6 Bestandsabfrage Namensaktien in ISO15022-fähigem Format

Bestandsabfragen des zugeteilten Bestandes in Namensaktien werden mit dem Mai-Release von CBF in einem ISO15022-fähigen Format zur Verfügung gestellt. Bisher gab es diese Möglichkeit nur im ISO7775 Format. CBF wird zukünftig den Inhalt des MT571 per MT598 Nachricht über die Schnittstellen File Transfer, SWIFT und IBM WebSphere MQ versenden (MT598-571). Dabei werden die Angaben aus dem MT571 komplett in das Feld :77E: des MT598-571 eingefügt.

Bei Interesse an dieser neuen Report-Funktionalität können sich die Kunden wie gewohnt an den Customer Service wenden.

2.3 Änderungen für Nachrichten aus dem Bereich Namensaktien im Format ISO7775

2.3.1 Besonderheit bei der Postleitzahl ausländischer Adressen

Da ausländische Postleitzahlen oftmals nicht in das Formatfeld der Anwendung bei CBF passen, dürfen bei RS-Aufträgen mit einem anderen Ländercode als „DE“ (für Deutschland) im ISO-Etikett 77E die Felder (LIMA-Etikett) A66 und A67 (PLZ Straße und PLZ Postfach) nicht mehr gefüllt werden. Auch hierbei ist zu beachten, dass der Wohnort weiterhin mit anzugeben ist. Andernfalls werden diese Aufträge von CBF mit einer entsprechenden Fehlermeldung abgelehnt.

2.4 Wegfall der MT548 "Receive Free Information" für Geschäfte ohne Matchpflicht

Im Rahmen der Nachrichten-Standardisierung wird der MT548 "Receive Free Information" für Geschäfte ohne Matchpflicht nicht mehr zur Verfügung gestellt. Matchpflichtige Geschäfte werden heute bereits über die ‚Settlement Allegements‘ und die ‚Matching Information‘ angezeigt. Abgewickelte Geschäfte werden somit gemäß Market Practice nur noch über die ‚Settlement Confirmation‘ bzw. das ‚Clearing and Settlement Statement‘ angezeigt.

2.5 Standardisierung von "UNMATCH-Nachrichten" mittels MT548

UNMATCH-Informationen (MT548 MTCH//NMAT) werden nur noch auf Basis des Matchprozesses erzeugt. Sofern der Status unverändert bleibt, werden diese Geschäfte nicht mehr bei Erreichen des Settlement Tages wiederholt.

2.6 Anzeige der originalen Auftrags-Referenz in den Settlement Bestätigungen für die Auftragsarten 16 und 18

Heute wird in Settlement-Bestätigungen für Vaults Ein- und Auslieferungsaufträge im Feld :20C::RELA der Wert NONREF angezeigt. In Zukunft wird die Referenz eines Vaults Auftrages, die per :20C::SEME gesendet wurde, in der entsprechenden Settlement-Bestätigung (MT544/MT546) im Feld :20C::RELA angezeigt. Bei Online erteilten Aufträgen wird in der Settlement-Bestätigung weiterhin im Feld :20C::RELA die Eingabe NONREF ausgewiesen.

Diese Änderung gilt nur für Settlement-Bestätigungen von Aufträgen, die vom Kunden selbst eingestellt wurden. Die Änderung gilt nicht für Settlement-Bestätigungen von Aufträgen, die vom CBF System automatisch generiert worden sind.

Leerseite.

3 Custody Services

3.1 Rückzahlung von Wertpapieren

Für einige Wertpapiere der Produktsegmentgruppen "WM-GD198B = 2000" (Renten und rentenähnliche Wertpapiere) und "WM-GD198B = 2800" (Anleihen mit zertifikatsähnlichen Strukturen) ändert sich die Zuordnung zu der Rückzahlungsterminart. Diese Änderung erfolgt aufgrund der Veröffentlichung von neuen Instrumentenarten durch die Wertpapier-Mitteilungen.

Endfällige Rückzahlungen von Produkten in den folgenden Instrumentenarten werden zukünftig nicht mehr in der Terminart 130 "Gesamtrückzahlung", sondern in der Terminart 132 "Rückzahlung endfälliges Zertifikat" verarbeitet:

2031 - "Anleihen mit Andienungsrecht",

2821 - "Linked Bonds mit zertifikatsähnlicher Struktur"

2896 - "Linked Bonds mit zertifikatsähnlicher Struktur und Mindestrückzahlung von weniger als 80 % des eingesetzten Kapitals (Grundlage Emissionskurs)"

3.2 MT564, MT566 für Ausschüttung von Genussrechten (Terminart 126)

Derzeit erfolgt die Meldung der TA126 "Ausschüttung Genussrechte" in den Message Types MT564 und MT566 mit dem Qualifier:

22F: :CAEV/DVCA

Zukünftig erfolgt die Meldung mit dem Qualifier:

22F: :CAEV//INTR

3.3 Neue Anforderungen für Steuerbescheinigungen

In der Funktion als inländische Wertpapiersammelbank im Sinne von § 1 Abs. 3 DepotG ist die CBF regelmäßig an der Zahlung von Erträgen der bei CBF verwahrten Wertpapiere beteiligt.

Hierdurch ergeben sich für die CBF gesetzliche, vertragliche sowie faktische Pflichten und Rechte in Bezug auf die Ausstellung von Steuerbescheinigungen.

Die Anforderungen für die Ausstellung von Steuerbescheinigungen in Form und Inhalt haben sich geändert. CBF wird diese Änderungen aufgrund des Gesetzesstandes und der einschlägigen Veröffentlichungen, die sich bis zum 18. Dezember 2009 ergeben haben, umsetzen.

Leerseite.

4 Global Securities Financing Services

4.1 Erweiterte Re-Use Funktionalität in Xemac

Der Umfang der Re-Use Funktionalität in Xemac verbessert sich für die Verpfändung von erhaltenen GC Pooling Wertpapieren.

Sicherheiten, die im Rahmen von GC Pooling (ECB Classic Basket) Transaktionen erhalten wurden, können zu Gunsten unterschiedlicher Kontrahenten weiter verpfändet werden.

Die jeweilige Forderung, für die die Sicherheiten weiterverwendet werden, muss auf dem Vertragsdefinitionstyp "Dt. Bbk" und dem Allokationstyp "Verpfändung" basieren. Eine weitere Voraussetzung für die Weiterverwendung der Sicherheiten ist das Zugrundelegen von Zulässigkeitskriterien wie in GC Pooling.

Für die jeweilige Forderung, in der eine Weiterverpfändung erfolgen soll, ist in Xemac entsprechend der "Re-Use von übereigneten EGCP Sicherheiten" zu aktivieren.

Um optimal von dieser Verbesserung zu profitieren, ist es für Kunden notwendig, den Sicherheitenpool ausreichend mit zulässigen Sicherheiten zu bestücken, so dass GC Pooling Transaktionen reibungslos abgewickelt und Re-Use Substitutionen erfolgreich durchgeführt werden können.

4.2 Verbesserte Referenzierung von Leihe-Geschäften im CASCADE-Reporting

Zukünftig werden die Referenzierungsmöglichkeiten von Leihe-Geschäften im CASCADE Reporting verbessert. Für Wertpapier-Leihengeschäfte wird das Reporting momentan durch das CBF Leihesystem erzeugt. In Zukunft wird die Leihe-Geschäftsnummer auch im CASCADE Clearing and Settlement Statement (MT536) und den Settlement Bestätigungen (MT544 bzw. MT546) angezeigt. Hierdurch wird eine vereinfachte Abstimmung zwischen dem Leihe- und dem Settlement-Reporting ermöglicht.

Da eine Wertpapierleihe immer eine eindeutige Geschäftsnummer sowohl für den Entleiher als auch den Verleiher hat, ergibt sich folgender Ausweis im CASCADE Reporting:

- Bei Eröffnungen erhalten Entleiher und Verleiher jeweils ihre eigene Geschäftsnummer
- Bei Rückführungen erhalten Entleiher und Verleiher jeweils ihre eigene Geschäftsnummer
- Bei Sicherheitenbuchungen in CASCADE (Übertrag zwischen dem 000 Hauptkonto und dem 680 CBF-Pfandkonto) wird ausschließlich auf den Entleiher bzw. den Pfandgeber referenziert

Im MT536 Clearing & Settlement Statement wird die Leihe-Referenz zukünftig in der Sequenz TRAN über eine weitere Sequenz LINK mit Feld :20C::COMM eingefügt.

Konzeptionelles Beispiel:

```
:16R:LINK  
:20C::COMM//12345678  
:16S:LINK
```

CBF Release Mai 2010

Auch in den Settlement Confirmations (MT544 / 546) ist die Sequenz für die Referenzierung von Leihgeschäften vorgesehen. Hier erfolgt die Einfügung in der Sequenz GENL auch über eine weitere Sequenz LINK mit dem Feld :20C::COMM.

Kontakt

marketing@clearstream.com

www.clearstream.com

Veröffentlicht von

Clearstream Banking Frankfurt

Eingetragene Adresse:

Clearstream Banking AG

Neue Börsenstraße 1

D-60487 Frankfurt am Main

Postanschrift:

Clearstream Banking

D-60485 Frankfurt am Main

Mai 2010

Dokumentnummer: F-CON25
