

CASCADE Handbuch Band 1

für Kunden der Clearstream Banking AG

(Einführung, Abwicklung Börsen- und OTC-Geschäft,
Geldregulierung)

CASCADE Handbuch Band 1

Clearstream Banking AG, Frankfurt

Dokument-Nummer: F-CON04

Juni 2024

Die im vorliegenden Dokument enthaltenen Informationen können ohne weitere Mitteilung geändert werden und stellen keine Zusage seitens Clearstream Banking AG, Frankfurt (nachfolgend als Clearstream Banking Frankfurt oder CBF bezeichnet) oder eines anderen zur Clearstream Holding AG gehörenden Unternehmens dar. Ohne die ausdrückliche schriftliche Zustimmung von Clearstream Banking Frankfurt darf kein Teil des vorliegenden Handbuchs zu irgendeinem Zweck in irgendeiner Form oder auf irgendeine Weise, einschließlich der Erstellung von Fotokopien und Aufzeichnungen, reproduziert oder übertragen werden.

Vorbehaltlich gegenteiliger Angabe erfolgen alle Zeitangaben in mitteleuropäischer Zeit (MEZ).

© Copyright Clearstream Banking AG, Frankfurt (2023). Alle Rechte vorbehalten.

Vorwort

Dieses Benutzerhandbuch informiert den Kunden von Clearstream Banking Frankfurt (nachfolgend CBF) über die Bedienung der Online-Anwendung CASCADE-Host der CASCADE-Abwicklungsplattform. Neben der Beschreibung der Online-Funktionalitäten liefert das Benutzerhandbuch auch Hintergrundinformationen zur Wertpapierabwicklung über T2S und CASCADE.

Das Benutzerhandbuch untersteht den Allgemeinen Geschäftsbedingungen von CBF. Die im CASCADE-Benutzerhandbuch enthaltenen Informationen gelten in Verbindung mit anderen CBF-Publikationen (CBF Kundenhandbuch, CBF Connectivity Handbook, Link Guides), Kundenmitteilungen und sonstigen Benutzerhandbüchern, die weitere Details hinsichtlich der Nutzung der Serviceleistungen von CBF beschreiben. Gültig ist jeweils die aktuelle Fassung auf der Internetseite www.clearstream.com.

Für Fragen zu Inhalten dieses Handbuchs wenden Sie sich bitte an Ihren Client Services Officer oder Relationship Manager.

Das CASCADE-Benutzerhandbuch ist in drei Bände aufgeteilt mit folgender Inhaltsstruktur:

Band 1

- Allgemeine Informationen zum Instruktionsmanagement mit CASCADE und Systeminformationen zur Online-Schnittstelle
- Abwicklung von Non-CCP-Börsengeschäften (ohne CCP (Central Counterparty) – Einbindung)
- Abwicklung von OTC-Geschäften
- Abwicklung von CCP-OTC-Transaktionen (Surplus Deliveries)
- Geldregulierung aus der CASCADE-Abwicklung

Band 2

- GS Bestandsführung und Depotumsätze
- Custody Services (Income und Non-Income)
- Services zu Namensaktien
- Collateral Services
- Reporting (Listen und Auswertungen)
- Tabellen und Schlüsselverzeichnisse
- Glossar

Band 3

- Abwicklung für Ein- und Auslieferung
- Allgemeine Informationsdienste (z. B. Umsatzinformationen)
- Reporting (Listen und Auswertungen)
- Depotdisposition und Depotbuchung für Ein- und Auslieferungen
- Euro-Umstellung für Wertpapiere
- Tabellen und Schlüsselverzeichnis

Inhalt

1	Einführung.....	7
1.1	CASCADE-Plattform der CBF.....	7
1.2	Erfassungs- und Auftragsstatus.....	8
1.2.1	Börsengeschäfte (ohne CCP).....	8
1.2.2	OTC-Geschäfte.....	8
1.2.3	CCP-OTC-Transaktionen.....	9
1.3	Settlementzyklen.....	9
1.3.1	Geldverrechnung.....	10
1.3.2	Wichtige Zeitpunkte im CASCADE- und T2S-Tagesablauf.....	10
1.3.3	Dispositionsprioritäten.....	17
1.4	Technische Grundlagen.....	17
1.4.1	Anmeldung zu den Online-Serviceleistungen.....	17
1.4.2	Tastenbelegung.....	19
1.4.3	Online-Passwortänderung.....	20
1.4.4	Anmelden am Online-System.....	21
1.4.5	Abmelden vom Online-System.....	25
1.4.6	Allgemeingültige Feldeingaberegeln.....	26
1.4.7	Allgemeingültige Felddescriptions und Formalprüfungen.....	27
1.4.8	Spezifische Felddescriptions und Formalprüfungen.....	47
1.5	Kontakte.....	50
1.5.1	Ansprechpartner für CASCADE.....	50
2	Abwicklung Börsengeschäft (ohne CCP)	51
2.1	Auftragsabwicklung.....	52
3	Abwicklung OTC-Geschäft	54
3.1	Auftragserteilung (EE).....	56
3.1.1	Einzel Erfassung von Wertpapier-Überträgen gegen/mit/frei von Zahlung (Kontrahent im Inland) (WE).....	56
3.1.2	Einzel Erfassung von Wertpapier-Überträgen gegen/mit/frei von Zahlung (Kontrahent im Ausland) (WE).....	66
3.1.3	Mehrfacherfassung von Wertpapier-Überträgen gegen/mit/frei von Zahlung (Kontrahent im Inland) (WM).....	72
3.1.4	Erfassung von Match-Instruktionen (MI).....	75
3.1.5	Erfassung TEFRA D Freigabe (TD).....	83
3.1.6	Einzel Erfassung von Überträgen an die Deutsche Finanzagentur (BE)	88
3.1.7	Erfassung von LSV-Überträgen (LE).....	92

3.1.8	Erfassung Umtausch GBC (UT).....	95
3.1.9	Erfassung Rücktausch GBC (RT)	97
3.1.10	Erfassung Optionsscheintrennung (OT)	101
3.1.11	Erfassung Optionsscheinzusammenführung (OZ).....	103
3.1.12	Erfassung Strip-Aufteilung (SA)	105
3.1.13	Erfassung Strip-Zusammenführung (SZ).....	107
3.2	Auftragsbearbeitung im Erfassungsstatus (EA).....	109
3.2.1	Änderung von Aufträgen (EA).....	109
3.2.2	Löschung von Aufträgen (EA).....	112
3.2.3	Information Erfassungsstatus (EI).....	114
3.3	Kontrolle (EK)	116
3.3.1	Kontrolle über die Vollanzeige (EK).....	118
3.3.2	Kontrolle über die tabellarische Kurzanzeige (EK)	122
3.3.3	Kombination Einzelkontrolle/Blockkontrolle	124
3.4	Auftragsbearbeitung im Auftragsstatus (AA)	125
3.4.1	Markierung zur Änderung (MA)	125
3.4.2	Änderung von Partial Settl. Indicator, Dispo-Priorität und TIN (AA)	127
3.4.3	Markierung zur Löschung (ML)	130
3.4.4	Link-Dienst (AL).....	131
3.4.5	Information zum Auftragsstatus (AI)	134
3.5	Matching	150
3.5.1	Zusätzliche Kriterien für Matching.....	151
3.5.2	Übersicht zum Match-Dienst (AM).....	153
3.5.3	Bearbeiten offener Match-Aufträge/Match-Instruktionen (MA / MI)	155
3.5.4	Fehlerhafte Match-Aufträge/Match-Instruktionen (MA/MI)	156
3.5.5	Information zu bestätigten Match-Aufträgen/Match-Instruktionen (MA/MI)	157
3.5.6	Already Matched Instruktionen.....	158
3.6	Settlement-Sperre/ -Freigabe	160
3.6.1	Sperre bzw. Freigabe von Aufträgen (SA, SI, FA, FI)	161
3.6.2	Informationen	172
4	Abwicklung von CCP-Instruktionen.....	176
4.1	Auftragserteilung	176
4.2	Auftragsbearbeitung und Settlement in EUR	176
4.2.1	Besonderheiten für CBF Equity CCP Konto (8501)	176
4.2.2	Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen/mit Zahlung in EUR	177
4.2.3	Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen Zahlung in Fremdwährung	177
4.3	Auftragsbearbeitung und Settlement in CHF	177

Inhalt

4.3.1	Regulierung von Geschäften in Schweizer Wertpapieren gegen Zahlung in CHF via Schweizerische Nationalbank	177
4.4	Reporting regulierter CCP-Instruktionen.....	178
4.4.1	Regulierungsliste Euro.....	178
4.4.2	Regulierungsliste für Fremdwährung (FW)	178
4.4.3	Buchungstextschlüssel	178
4.4.4	Regulierungsdatenträger MT536.....	178
4.4.5	Swift-Settlement Confirmations (MT544-MT547) und Weiterleitungen (MT578)	178
5	Geldregulierung in Fremdwährung (GC)	179
5.1	Information von CASCADE-FWG-Geschäften	179
5.1.1	Anzeige Verarbeitungs-Status	181
5.1.2	Tabellarische Kurzanzeige der FWG-Aufträge	181
5.1.3	Vollanzeige	183

1 Einführung

1.1 CASCADE-Plattform der CBF

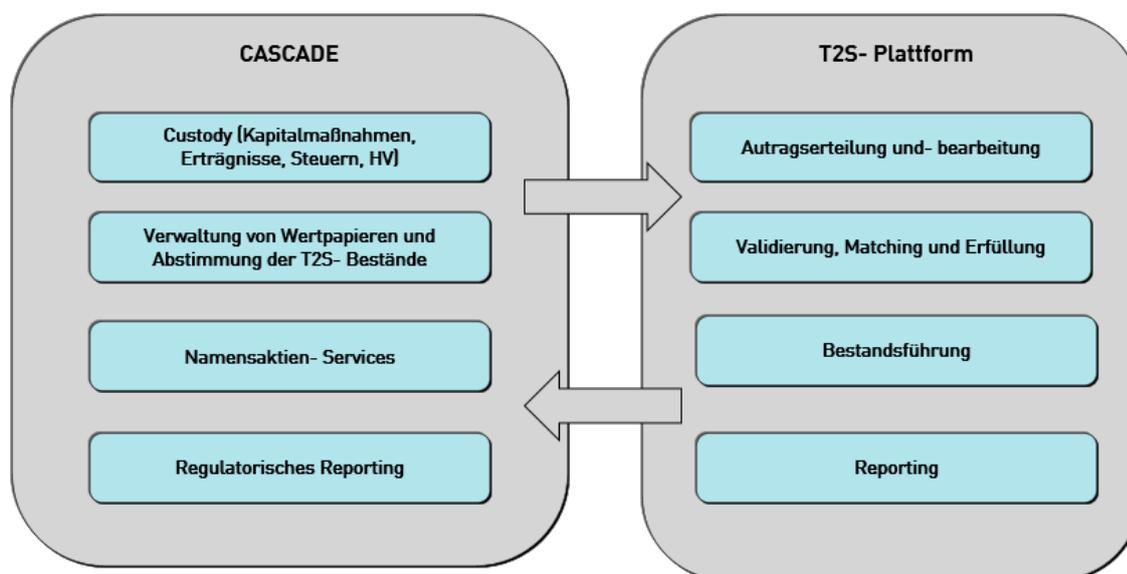
Dieses Kapitel dient zur Erläuterung grundlegender Begriffe, die zum Verständnis des vorliegenden Handbuchs erforderlich sind. Für zusätzliche Informationen zu den CBF-Services wird auf das CBF Kundenhandbuch verwiesen.

CBF stellt mit dem System CASCADE eine hocheffiziente Applikation für die Verwaltung von Transaktionen in deutschen und internationalen Wertpapieren zur Verfügung. CASCADE steht für Central Application for Settlement, Clearing and Depository Expansion und umfasst:

- für Wertpapiere in Girosammelverwahrung (GS) die Erfassung und Weiterleitung von Instruktionen mit und ohne Gegenwertverrechnung der CBF-Kunden an T2S, die Verwaltung von Wertpapieren und Abstimmung der T2S Bestände sowie die Erfüllung der Geldseite von Geschäften in Fremdwährung über die entsprechenden Geldkonten der Clearstream Banking (Commercial Bank Money)
- für Wertpapiere in Streifbandverwahrung die Auftragserteilung und Bearbeitung der Wertpapierübertragungs- und Wertpapierverwaltungsaufträge der CBF-Kunden sowie den Buchungsprozess

Für Namensaktien, die über das CASCADE RS-System verwaltet werden, ist eine erweiterte Bestandsführung bis zur Aktionärssebene möglich. Auch werden spezifische Dienste, z. B. die Umschreibung von Aktienbeständen unter Einbeziehung des Aktienbuches des jeweiligen Emittenten, exklusiv angeboten.

Auf die Wertpapierbestände bietet CBF verschiedene Services an, z. B. die Abrechnung und Zahlung sowie das Inkasso von Ertragszahlungen (Zins- und Dividendenzahlungen), Rückzahlungen und Provisionen oder die Abwicklung von Kapitalmaßnahmen.



Services der CBF auf Basis der CASCADE-Plattform

Über CASCADE werden Instruktionen aus den folgenden Bereichen verwaltet:

- CASCADE unterstützt die Anzeige und Bearbeitung offener Lieferpositionen aus dem Börsengeschäft. Über das SETI Interface werden Lieferpositionen aus Geschäften eingestellt, die über die deutschen Börsen (wie Börse Frankfurt, Börse Stuttgart, Tradegate oder über BrainTrade) gehandelt und nicht gegen den Zentralen Kontrahenten (CCP = Central Counterparty) abgewickelt werden. Nachfolgend wird mit dem Begriff „Börsengeschäft“ alle an CBF erteilten Lieferaufträge bezeichnet, die in CASCADE als Lieferposition von börslichen Handelsgeschäften eingestellt werden.
- CASCADE unterstützt darüberhinaus die Verwaltung von außerbörslichen (OTC = over the counter) Wertpapiertransaktionen. Hierzu zählen auch die von Eurex Clearing AG (CCP) an CBF übermittelten Lieferinstruktionen. Nachfolgend werden mit dem Begriff „OTC-Geschäft“ alle an CBF erteilten Wertpapieraufträge bezeichnet, die nicht als Börsengeschäfte in CASCADE eingestellt werden. Eine Ausnahme hiervon bilden die non-CCP gehandelten Börsengeschäfte, die wie OTC Transaktionen abgewickelt werden
- CASCADE-RS bietet zusätzliche Services, die für die Administration von Namensaktien (RS = Registered Shares) erforderlich sind, wie Zulassung, die Ersteintragung und Umschreibung von Aktionären im Aktienregister und erweiterter Bestandsführung.

1.2 Erfassungs- und Auftragsstatus

1.2.1 Börsengeschäfte (ohne CCP)

Die zur Abwicklung des Börsengeschäfts erforderlichen Aufträge werden automatisch aus den jeweiligen Handelssystemen als offene Lieferpositionen über SETI in CASCADE als „already matched“ eingestellt und in einem OTC-ähnlichen Modus abgewickelt. Die Instruktionserteilung und -änderung folgt denselben Prozessen wie OTC-Instruktionen, das Reporting wird über dieselben Kommunikationskanäle gesteuert. Die Einstellung der Instruktionen erfolgt ausschließlich automatisiert über die SETI-Schnittstelle, das Instruktionsmanagement erfolgt über die CASCADE-Applikation.

Die Verarbeitung und das Reporting von Instruktionen und das Lifecycle-Management für non-CCP Börsengeschäfte in Wertpapieren mit der Verwahrungsart NCSC (Non-Collective Safe Custody) wird über Creation ausgeführt. Diese Instruktionen können analog zu CASCADE in einem „OTC-ähnlichen“ Modus über automatisierte Clearstream Xact-Verbindungskanäle (ISO 15022) und das Xact Web Portal (GUI) bearbeitet werden.

1.2.2 OTC-Geschäfte

Die Abwicklung von OTC-Aufträgen erfolgt durch entsprechende Auftragserteilung der an einer Wertpapiertransaktion beteiligten Parteien. Ein Auftrag kann über die Benutzeroberfläche (CASCADE-HOST) erfasst oder via CBF LIMA File Transfer, Swift Netzwerk oder über IBM WebShere MQSeries (MQ) in CASCADE eingestellt werden. Zusätzlich ist es möglich, bestimmte Wertpapieraufträge über die T2S GUI zu erfassen oder via Swift /SIA-Colt an T2S zu übermitteln. Die direkte Auftragserteilung in T2S ist nicht Gegenstand dieses Handbuchs und wird im DCP¹ Connectivity Handbuch sowie der T2S Dokumentation der EZB näher beschrieben.

Ein in CASCADE Online erfasster Auftrag wird zunächst mit Erfassungsstatus in den Erfassungsbestand von CASCADE eingestellt und nach der Kontrolle und Freigabe durch den Auftraggeber gemäß Vier-Augen-Prinzip mit Auftragsstatus an T2S übermittelt und parallel in den CASCADE-Auftragsbestand übergeleitet. Ein per LIMA File Transfer, Swift Netzwerk oder MQ an CASCADE übermittelter Auftrag wird nach formaler und inhaltlicher Prüfung durch CBF ebenfalls an T2S übermittelt und parallel in den CASCADE-Auftragsbestand (Auftragsstatus) eingestellt.

Sobald ein OTC-Auftrag gegen, mit oder frei von Zahlung an T2S übermittelt worden ist, versucht T2S, diesen mit einem gegenläufigen Auftrag der Gegenpartei zusammenzuführen (Matching).

¹ DCP – Directly Connected Participant

1.2.3 CCP-OTC-Transaktionen

Die vom CCP (EUREX Clearing AG) an CBF übermittelten Aufträge sind Lieferspitzen (surplus deliveries) aus dem Netting Prozess und/oder Bruttolieferungen, werden als OTC-Geschäft mit Auftragsstatus in CASCADE eingestellt und im Status „already matched“ an T2S übermittelt. Im Falle von Aufträgen mit und ohne Zahlung übermittelt der CCP zusätzlich zu dem eigenen Auftrag einen entsprechenden Gegenauftrag im Auftrag des Kontrahenten (POA) an die entsprechende Settlement-Lokation.

1.3 Settlementzyklen

Eingehende GS-Lieferaufträge in CASCADE werden in T2S in unterschiedlichen Settlementzyklen verarbeitet. T2S bietet zur Regulierung von Wertpapieren und Geld eine sequenzielle Nachtverarbeitung (Night-time Settlement – NTS) mit zwei Zyklen und bis zu zwei Real-time Verarbeitungsläufe (Real-time Settlement – RTS) an.

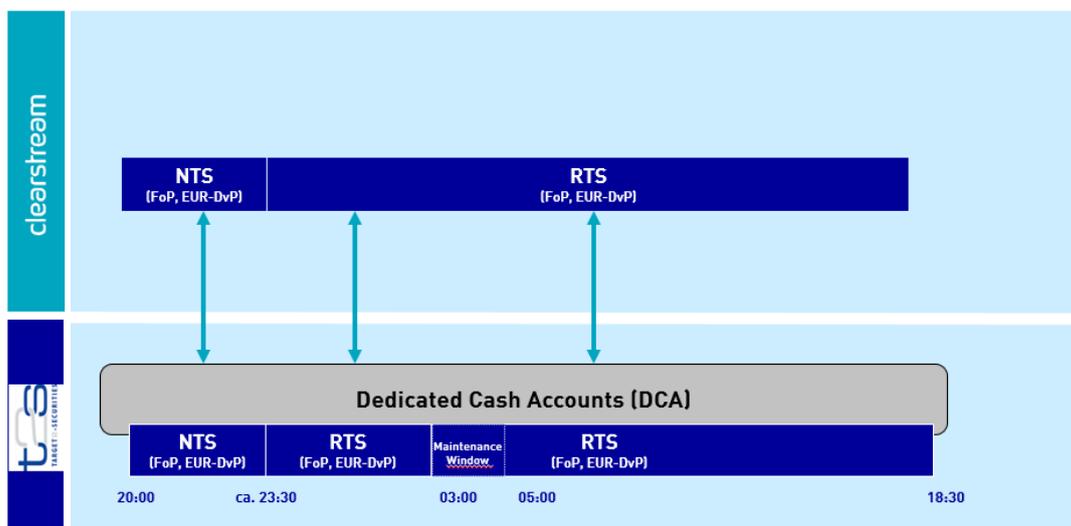
Der T2S Verarbeitungstag ("Daily Schedule") sieht in der Zeit zwischen 03:00 und 05:00 Uhr ein optionales und an Samstagen (zwischen Samstag, 02:30 Uhr, und Montag, 02:30 Uhr) ein obligatorisches Wartungsfenster vor.

Kunden können die Wartungsfenster in CASCADE über die Online Transaktion "KVAV" und Funktion "ID" („Aktuelle Dispositions- und Buchungsinformationen“) verfolgen, wobei die folgenden Codes

- NOMW Kein Wartungsfenster („No Maintenance Window“)
- MTNW-Wartungsfenster („Maintenance Window“)
- RTMS Start des Real-time Settlement für die Tagesverarbeitung und damit Ende des Wartungsfensters

bedeuten. CASCADE hingegen schließt jeden Tag zwischen 03:00 und 05:00 Uhr für Wartungsarbeiten.

Die nachfolgende Abbildung stellt den zeitlichen Ablauf der von T2S bzw. CASCADE unterstützten Settlementzyklen dar. Die zeitliche Einteilung der Abwicklungszyklen in T2S erfolgt nach Geschäftstagen Die Abwicklung in T2S beginnt mit dem Night-time Settlement (NTS) um ca. 20:00 Uhr und endet mit dem Real-time Settlement (RTS) um ca. 18:00 Uhr². Die einzelnen Settlementzyklen für WR-Geschäfte (AKV) werden im CBF Kundenhandbuch beschrieben.



CASCADE / T2S – Übersicht der Settlementzyklen

² An dem nächsten Kalendertag, der einem T2S-Geschäftstag entspricht.

1.3.1 Geldverrechnung

Die Regulierung von Zahlungen aus Wertpapiertransaktionen, Kapitaldiensten, Gebühren und Spesen erfolgt außerhalb der CASCADE-Plattform. CBF bedient sich für die Geldregulierung Zentral- bzw. Korrespondenzbanken (cash agents) sowie Zahlungs- bzw. Abwicklungssystemen, bei denen die Kunden der CBF entsprechende Geldkonten führen.

1.3.1.1 Euro-Zahlungen via T2S

Über T2S und die hierfür eingerichteten T2S-Geldkonten (DCA) werden alle Zahlungen in EUR verrechnet, die sich aus der Regulierung von Wertpapiertransaktionen von girosammelverwahrten Wertpapieren, Zins- und Rückzahlungen, Ausschüttungen und Dividenden von Wertpapieren, für die CBF als Issuer CSD fungiert, Crossborder Market und Reverse Claims für FCSC und NCSC T-Wertpapiere, sowie aus der Abrechnung von Gebühren und Spesen³ durch CASCADE ergeben. Die Verrechnung erfolgt in Echtzeit während der Settlementzyklen.

- Ausschüttungen in EUR werden in der Regel in der Nachtverarbeitung vor dem Zahlbarkeitstag (NTS) oder am Zahlbarkeitstag über T2S reguliert.
- Bei deutschen Wertpapieren fällt der Zahlbarkeitstag in der Regel mit dem Ex-Tag des Events zusammen.

1.3.1.2 Zahlungen in Fremdwährungen via Commercial Bank Money (Creation-Plattform)

Über die Creation-Plattform erfolgt die Geldverrechnung in Fremdwährung, resultierend aus GS Wertpapiertransaktionen und Zahlungen aus Kapitaldiensten zu Wertpapieren in Girosammelverwahrung.

1.3.1.3 CHF Zahlungen via Schweizerische Nationalbank

Zahlungen in CHF via Schweizerische Nationalbank (SNB) resultieren ausschließlich aus Crossborder-Wertpapiertransaktionen gegen Konto 7215. Dabei handelt es sich um DvP-Transaktionen in GS-verwahrten Schweizer Wertpapieren gegen CHF zwischen einem Schweizer und einem CBF-Teilnehmer. Hierfür müssen beide Kontrahenten über eine entsprechende direkte oder indirekte Kontoverbindung bei der SNB verfügen.

Hinweis: Bei DvP-Wertpapiertransaktionen in GS-verwahrten Schweizer Wertpapieren gegen CHF zwischen zwei CBF-Teilnehmern (CBF-interne Transaktionen) werden CHF als Fremdwährungszahlung über die Creation-Plattform (6er-Konten der CBF-Teilnehmer) verrechnet (siehe hierzu Kapitel 1.3.1.2).

Für weitere Informationen zur Geldregulierung wird auf das CBF-Kundenhandbuch verwiesen.

1.3.2 Wichtige Zeitpunkte im CASCADE- und T2S-Tagesablauf

Zur Einhaltung bestimmter Fristen und zur Abstimmung der eigenen Systeme ist es notwendig, einen Überblick für die täglich stattfindenden Prozesse zu erhalten. Die nachfolgend aufgeführten wichtigen Zeitpunkte sind im Tagesablauf zu beachten. Die angegebenen Annahmefristen für die Abwicklung sind nur dann gültig, wenn die vom Kunden gelieferten Instruktionen für eine vollautomatisierte Verarbeitung (Straight-through Processing, STP) geeignet sind.

Wichtiger Hinweis: Im Rahmen der internen Compliance-Verfahren der CBF werden alle eingehenden Kundeninstruktionen automatisch vor Eintritt in die Transaktionsverarbeitung gescannt. Werden Instruktionen intern derart gekennzeichnet, dass sie eine weitere manuelle Untersuchung benötigen, werden diese in den Status Open gesetzt. Dieser Status wird den Kunden sofort über ihre gewählten Kommunikationskanal(e) berichtet, bis die Instruktionen entweder manuell zur Verarbeitung freigegeben oder abgelehnt werden. Zur Gewährleistung einer Untersuchung der Instruktionen sowie der Einhaltung der geltenden Fristen, wird den Kunden empfohlen, Instruktionen spätestens 15 Minuten vor der jeweiligen Frist einzugeben.

Für T2S relevante Aufträge wird empfohlen, diese 25 Minuten vor den T2S Start bzw. Endzeiten an CBF zu übermitteln, da es durch Verarbeitungs- und Übertragungszeiten zu Verzögerungen bei der Übergabe der

³ Die Abrechnung von Gebühren und Spesen erfolgt monatlich in EUR über die T2S DCAs der Kunden.

Aufträge an T2S kommen kann. Es handelt sich hierbei um die Summe der maximal erwarteten Bearbeitungszeit im Rahmen des internen Compliance-Verfahrens (15 Minuten) und der maximal erwarteten Verarbeitungs- und Übertragungszeit im Rahmen der Übergabe der Aufträge an T2S (zehn Minuten). Eine Verarbeitungsgarantie auf T2S wird zu keiner Zeit übernommen.

Uhrzeit	Aktivität	T2S Status ⁴ (camt.019)
18:45	T2S – Beginn der Start of Day (SOD) Prozesse	SODP
19:00	CASCADE – Beginn der STD-Abwicklung von Nicht-T2S-Instruktionen	
ca. 19:00	CBF Reports im Druckformat: Regulierungsliste	
19:30	KADI Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT564 – Notification • MT566 – Confirmations • MT568 – Narrative 	
20:00	T2S – Ende der Start of Day (SOD) Prozesse	
20:00	T2S – Beginn des Night-time Settlements (NTS), Beginn erster NTS-Zyklus	FNNTC
21:00	CASCADE-RS – 4. Zuweisung	
21:00	CASCADE – Ende der STD-Abwicklung von Nicht-T2S-Instruktionen	
21:15	KADI Reporting ⁵ : MT566 – Confirmations	
21:30	CASCADE-RS – Automatische Umschreibung	
22:00	SETI – Non-CCP-Börsengeschäfte werden von den Börsensystemen am Handelstag empfangen und nach T2S weitergeleitet.	
ca. 22:20	T2S – Ende erster NTS-Zyklus ⁶	
ca. 22:20	T2S – Start letzter NTS-Zyklus ⁶	LNNTC
22:30	CASCADE-RS – Weiterleitung RS-Aufträge an Aktienregister aus 4. Zuweisung und automatische Umschreibung	
23:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT536 – Statement of Transactions • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions 	

⁴ T2S-Status: SODP – Start Of Day Period, FNNTC – First Night-Time Cycle, LNNTC – Last Night-Time Cycle, RTMS – Real-time Settlement, RTMC – Real-time Settlement Closure, MTNW – Maintenance Window, NOMW – No Maintenance Window, EODP – End Of Day Period

⁵ Uhrzeit bezieht sich beim KADI Reporting immer auf den KADI-Lauf, das Reporting beginnt bis zu 15 Minuten später.

⁶ Uhrzeit hängt von den Abwicklungsvolumen im ersten NTS Zyklus ab.

Uhrzeit	Aktivität	T2S Status ⁴ (camt.019)
	<ul style="list-style-type: none"> MT586 – Statement of Allegements 	
23:00	CASCADE Reporting: MT537 – CBF Statement of Pending Transactions	
23:00	KADI Reporting: MT564 – Notification MT566 – Confirmations MT568 – Narrative	
23:45	CASCADE Reporting: MT537 – CBF Statement of Pending Transactions	
ca. 00:00	T2S – Ende letzter NTS-Zyklus, Ende des Night-time Settlements (NTS) ⁷	
ca. 00:00	T2S – Start des optionalen Real-time Settlements (RTS)	
02:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> MT536 – Statement of Transactions MT537 – CBF Statement of Pending Transactions MT586 – Statement of Allegements 	
03:00	T2S – Ende des optionalen Real-time Settlements (RTS)	
03:00	T2S – Start des Maintenance Windows ⁹	
03:00	CASCADE – Ende CASCADE Online	NOMW (werk- tags) /MTNW (werktags nach Ankündi- gung)
03:00	CBF – Start des Maintenance Windows	
ca. 05:00	CBF – Ende des Maintenance Windows	
05:00	T2S – Ende des Maintenance Windows ¹⁰	
05:00	T2S – Start Real-time Settlement (RTS)	
05:00	CASCADE – Start CASCADE Online	

⁷ Uhrzeit hängt von den Abwicklungsvolumen im letzten NTS Zyklus ab; spätestens 03:00 Uhr.

⁸ Uhrzeit hängt von den Abwicklungsvolumen im NTS ab; wird nur ausgeführt, falls werktags ein T2S „Maintenance Window“ geöffnet wird und das Ende des NTS vor 03:00 Uhr erreicht ist.

⁹ Das T2S „Maintenance Window“ wird an Werktagen nur bei Bedarf und nach einer Ankündigung mit einem Vorlauf von mindestens einem Bankarbeitstag durchgeführt. Samstags findet es immer statt, und zwar von 2:30 Uhr bis montags um 02:30 Uhr.

Uhrzeit	Aktivität	T2S Status ⁴ (camt.019)
05:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements RTMS 	
05:00	KADI – Instruktion von Market Claims auf im NTS abgewickelte Basiswerte	
06:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT536 – Statement of Transactions • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements 	
06:00	KADI Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT564 – Notification • MT566 – Confirmations • MT568 – Narrative 	
06:00	CBF Reports im Druckformat: <ul style="list-style-type: none"> • Tageslisten – Report JQ263000 	
07:00	Xemac® – Start Xemac Online	
07:30	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements 	
08:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT536 – Statement of Transactions • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements 	
08:00	T2S – Beginn des ersten Partial Settlement Windows	
08:30	T2S – Ende des ersten Partial Settlement Windows	
09:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT536 – Statement of Transactions • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements 	
10:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT536 – Statement of Transactions 	
10:00	T2S – Beginn des zweiten Partial Settlement Windows	
10:15	T2S – Ende des zweiten Partial Settlement Windows	
10:20	Resend process for OTC instructions in recycling status (1/4)	
10:30	CASCADE-RS – 1. Zuweisung	
10:30	CASCADE Reporting:	

Uhrzeit	Aktivität	T2S Status ⁴ (camt.019)
	<ul style="list-style-type: none"> • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements 	
10:30	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions 	
10:30	KADI Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT564 – Notification • MT566 – Confirmations • MT568 – Narrative 	
10:30	KADI – Instruktion von Market Claims auf bis 10:30 Uhr abgewickelten Basiswerte	
10:40	CASCADE – Ende der SDS1-Abwicklung von Nicht-T2S-Instruktionen	
11:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT536 – Statement of Transactions 	
11:15	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements 	
11:30	KADI Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT564 – Notification • MT566 – Confirmations • MT568 – Narrative 	
12:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT536 – Statement of Transactions • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements 	
12:00	T2S – Beginn des dritten Partial Settlement Windows	
12:15	T2S – Ende des dritten Partial Settlement Windows	
12:45	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements 	
12:50	Resend process for OTC instructions in recycling status (2/4)	
13:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT536 – Statement of Transactions 	
13:30	CASCADE-RS – 2. Zuweisung	
13:30	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements 	
13:30	CASCADE Reporting:	

Uhrzeit	Aktivität	T2S Status ⁴ (camt.019)
	<ul style="list-style-type: none"> MT537 – CBF Statement of Pending Transactions 	
13:30	KADI – Instruktion von Market Claims auf bis 13:30 abgewickelten Basiswerte	
13:30	KADI Reporting: <ul style="list-style-type: none"> MT564 – Notification MT566 – Confirmations MT568 – Narrative 	
14:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> MT536 – Statement of Transactions 	
14:00	T2S – Beginn des vierten Partial Settlement Windows	
14:15	T2S – Ende des vierten Partial Settlement Windows	
15:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> MT536 – Statement of Transactions 	
15:00	KADI Reporting: <ul style="list-style-type: none"> MT564 – Notification MT566 – Confirmations MT568 – Narrative 	
15:00	Resend process for OTC instructions in recycling status (3/4)	
15:30	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> MT537 – CBF Statement of Pending Transactions MT586 – Statement of Allegements 	
15:45	KADI Reporting: <ul style="list-style-type: none"> MT564 – Notification MT566 – Confirmations MT568 – Narrative 	
15:30	T2S – Beginn des letzten Partial Settlement Windows	
16:00	T2S – Ende des letzten Partial Settlement Windows	
16:00	T2S – Annahmefrist für Instruktionen gegen/mit Zahlung in EUR (mit Ausnahme von Instruktionen mit BATM Flag)	
16:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> MT536 – Statement of Transactions MT537 – CBF Statement of Pending Transactions MT586 – Statement of Allegements 	
16:15	KADI Reporting: <ul style="list-style-type: none"> MT564 – Notification MT566 – Confirmations MT568 – Narrative 	

Uhrzeit	Aktivität	T2S Status ⁴ (camt.019)
16:30	T2S – Automatische Freigabe von noch schwebenden Auto-Collateralisation Reimbursement-Instruktionen	
17:00	CASCADE-RS – 3. Zuweisung	
17:00	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT536 – Statement of Transactions • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions • MT586 – Statement of Allegements 	
17:30	Annahmefrist für Instruktionen gegen Zahlung in Fremdwährungen	
17:40	T2S – Annahmefrist für Instruktionen gegen/mit Zahlung in EUR mit „ADEA“ Flag (BATM-Geschäfte)	
17:40	Xemac® – Ende Xemac Online	
17:40	Resend process for OTC instructions in recycling status (4/4)	
18:00	T2S – Annahmefrist für Instruktionen frei von Zahlung ¹⁰	
18:00	T2S – Ende des Real-time Settlements (RTS)	
18:00	T2S – Beginn der End of Day (EOD) Prozesse	EODP
ca. 18:00	Geldreporting ¹¹ : <ul style="list-style-type: none"> • MT942 – Interim Transaction Report • MT950 – Statement Message 	
ca. 18:00	CASCADE Reporting ¹¹ : <ul style="list-style-type: none"> • MT586 – Statement of Allegements 	
ca. 18:00	CBF Reports im Druckformat: <ul style="list-style-type: none"> • Tageslisten – Report JQ262000 • Geldtagesauszug 	
18:30	CASCADE Reporting: <ul style="list-style-type: none"> • MT536 – Statement of Transactions • MT537 – CBF Statement of Pending Transactions 	
18:30	CASCADE-RS – Weiterleitung RS-Aufträge an Aktienregister aus 1.-3. Zuweisung	
18:45	T2S – Ende der End of Day (EOD) Prozesse	

¹⁰ Für TEFRA D Wertpapiere liegt die effektive T2S Annahmefrist am 40. Tag der TEFRA D Periode bei 17:45 Uhr.

¹¹ Uhrzeit hängt vom T2S Business Event EODP ab.

1.3.3 Dispositionsprioritäten

Es existiert die Möglichkeit zur Kennzeichnung von Instruktion in GS-Wertpapieren mit der Priorität „3“ („Hoch“) oder „4“ („Normal“, Default für OTC-Geschäfte). Die Prioritäten „1“ („Reserved“) und „2“ („Top“, Default für Börsengeschäfte) stehen ausschließlich CSDs, NCBs, CCPs und Handelsplattformen zur Verfügung. Prioritäten werden von T2S im Night-time Settlement (NTS) vor jedem Abwicklungsversuch und im Real-time Settlement (RTS) nur in den Optimierungsläufen und im Recycling berücksichtigt.

1.4 Technische Grundlagen

1.4.1 Anmeldung zu den Online-Serviceleistungen

Die Einrichtung einer Dialogverbindung erfordert folgende Maßnahmen:

- 1) Der Kunde der Clearstream Banking AG, Frankfurt (CBF) fordert einen Systemfragebogen von der Kundenbetreuung der CBF an. Dieser ist ausgefüllt an die vorgegebene Adresse zurückzusenden.
- 2) Wenn noch keine Postleitung existiert, stellt die Deutsche Börse Systems AG (Systems) bei der Telekom einen Postleitungsantrag, der auch dem Kunden der CBF zur Unterschrift zugeht (Dauer bis zur Schaltung der Leitung: zurzeit vier bis acht Wochen).
- 3) Nachdem die Postleitung geschaltet worden ist, erfolgt von der Deutsche Börse Systems AG die Generierung der Leitung in der System-Software (Generierungsrhythmus: ca. vier Wochen).
- 4) Vom Kunden sind die gewünschten Anwendungen bei der Clearstream Banking AG, Frankfurt zu beantragen, d. h. aufgrund der Dialogverbindung besteht (nach Bedarf) die Möglichkeit einer universellen Nutzung aller Inland-Anwendungen der CBF (CASCADE, WSS).
- 5) Die Betriebssicherheit IT der Gruppe Deutsche Börse wird davon in Kenntnis gesetzt und der Haupt-security-Beauftragte sendet dem Kunden der CBF den Antrag „Berechtigung zur Nutzung von Anwendungen der Gruppe Deutsche Börse“.

1.4.1.1 Das Zugriffsschutz-System

Mit Einführung der Datenbanksoftware „IMS“ ist gleichzeitig ein Security-System installiert, das einen weitestgehenden Schutz der IMS-Online-Anwendungen vor Missbrauch ermöglicht.

Voraussetzung für das Security-System ist eine Security-Datenbank (Benutzer-Datenbank), in der jeder Benutzer mit seinem eindeutigen Identifizierungs-Kennzeichen (ID-KZ) und Passwort sowie seinen Transaktionsberechtigungen gespeichert ist. Diese Transaktionsberechtigungen werden von dem Kunden-Security-Beauftragten den verschiedenen Mitarbeitern zugeordnet.

In jeder Bank müssen zwei Security-Beauftragte benannt sein, die sich in ihren Aufgabenbereichen folgendermaßen unterscheiden:

- Der Bank Security-Beauftragte zur Pflege:
Pflegen der Berechtigungsdaten in der Security-Datenbank, d. h. Funktionscodeberechtigungen können erfasst, geändert, gelöscht sowie angezeigt werden.
- Der Bank Security-Beauftragte zur Freigabe:
Aufgaben: Kontrolle und Freigabe der Anwendungsberechtigungen, die der Kunden-Security-Beauftragte zur Pflege vergeben hat.

Im Folgenden wird der Aufbau des Mitarbeiter-Security-Daten-Formulars erläutert, das Sie von Ihrem „Security-Beauftragten“ erhalten haben. Hier wird Ihnen mitgeteilt, für welche Transaktionen und Funktionen von CASCADE oder Custody (oder von anderen IMS-Anwendungen der Gruppe Deutsche Börse) Ihnen eine *Zugriffsberechtigung* zugewiesen worden ist.

Im oberen Teil des Formulars wird neben dem User-Identifizierungskennzeichen, dem Namen und Vornamen der zugriffsberechtigten Person auch das Ersterfassungs-Passwort angegeben. Dieses Passwort wird beim Ersteinstieg in das System vom User im Online-Passwortänderungsdienst in ein eigenes Passwort umgeändert. Außerdem wird der Status „Ersterfassung“, „Änderung“ oder „Löschung“ aufgeführt.

1.4.2 Tastenbelegung

Taste	Erklärung
Enter bzw. Datenfreigabe	<p>Auswahlmenümasken:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Prüfung der Eingaben; Sind die Eingaben korrekt, wird in die nächste Ebene verzweigt. <p>Erfassungsmaske:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Prüfung der Eingaben <p>Tabellarische Anzeigemasken:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Prüfung der Eingaben. Wird KZ = „I“ eingegeben, so führt ENTER zur Informationsvollanzeige des gekennzeichneten Auftrages.
Tabulatortaste	Vor-/Rückwärtsspringen auf das nächste eingabefähige Feld
PF1	Führt in verschiedenen Transaktionen zur Anzeige einer Hilfemaske.
PF2	<p>Führt zu einem Online-Druck aus der Informationsvollanzeige heraus. Weiterhin kann im Rahmen der tabellarischen Kurzanzeige der Transaktion KVAI ein Online-Druck mit PF2 sowie durch Kennzeichnung mit „D“ vorgenommen werden.</p> <p>Zusätzlich kann aus der tabellarischen Anzeige der Transaktion „KVAV“ ein Online-Druck aktiviert werden. (Voraussetzung für den Ausdruck ist eine leitungsbezogene Bildschirmzuordnung zum Drucker.)</p>
PF3	Führt zu einer Verarbeitung der eingegebenen Daten (= Eingabebestätigung).
PF4	Mit PF4 wird ein Dialog ohne Verarbeitung abgebrochen. Anschließend wird das jeweilige Auswahlmenü angezeigt.
PF5	<p>Bei Vollanzeige: Statusinformation;</p> <p>Nur bei tabellarischen Anzeigen: Wenn aufgrund einer Zeitüberschreitung die Datenbanksuche abgebrochen werden musste, initiiert PF5 ein Weitersuchen nach Aufträgen in der Datenbank.</p>
PF6	Führt zu einer Verarbeitung der eingegebenen Daten und blättert gleichzeitig innerhalb eines Vorganges bei bestimmten CASCADE-Auftragsarten vor.
PF7	Falls Folgemasken existieren: Ermöglicht ein Zurückblättern zur vorangegangenen Maske innerhalb eines Vorganges.
PF8	Falls Folgemasken existieren: Ermöglicht ein Vorwärtsblättern zur Folgemaske innerhalb eines Vorganges.
PF9	Nicht belegt.
PF10	Nicht belegt.
PF11	<p>Wie bei PF4 erfolgt ein Abbruch des Dialogs ohne Verarbeitung.</p> <p>Bewirkt zusätzlich die Abmeldung vom System CASCADE und den Rücksprung in das Gruppe Deutsche Börse-Einstiegsmenü.</p>
PF12	Nicht belegt.

1.4.3 Online-Passwortänderung

Mit Hilfe dieser Funktion kann die Änderung eines Passwortes durchgeführt werden:

Transaktionscode „MENU“ (1. Zeile) durch „PWAD“ überschreiben.

Als Ergebnis erscheint das Passwortänderungs-Menü:

```
TRAN: PWAD FC:      SB:
----- P A S S W O R T - AENDERUNG -----

IDENTIFIZIERUNGS-KZ      :
ALTES PASSWORT           :
NEUES PASSWORT           :
WIEDERHOLUNG NEUES PASSWORT:

PFK1: HELP FUNKTION      PFK4: VORGANGSABBRUCH
****

SY0010A BITTE GEBEN SIE IDENTIFIZIERUNGS-KZ, ALTES UND NEUES PASSWORT EIN
```

**** Nur Musterdaten

Folgende Eingaben sind notwendig:

- Identifizierungskennzeichen
- Altes Passwort
- Neues Passwort
- Wiederholung des neuen Passwortes

Hinweis: Das Zugangswort (Passwort) muss:

- Achtstellig sein
- Mindestens einen Buchstaben enthalten
- Mindestens eine Zahl enthalten
- Eines der nachstehenden Sonderzeichen enthalten: „.←(+\$*);-/,%→?#=”

Werden die Daten korrekt eingegeben, wird die Passwortänderung durch eine Bildschirmmeldung bestätigt.

Generell kann eine Passwortänderung zu jedem Zeitpunkt vorgenommen werden. Darüber hinaus wird in folgenden Fällen automatisch der Passwortänderungsdienst aufgerufen:

- Zur Änderung des Ersterfassungs-Passwortes
Das vom Bank-Security-Beauftragten erhaltene Erst-Passwort muss vor Nutzung des Systems geändert werden.
Hinweis: Das Erst-Passwort ist 24 Stunden gültig und muss vor Ablauf dieser Frist geändert werden.
- Bei Ablauf des Passwort-Gültigkeitszeitraumes
Der Gültigkeitszeitraum eines Passwortes beträgt drei Monate, d. h. im Abstand von drei Monaten muss das Passwort geändert werden.

Durch Drücken der PF4-Taste kann der Passwortänderungsdienst abgebrochen werden.

Informationen zur Passwortänderung können durch Betätigen der PF1-Taste abgerufen werden.

1.4.4 Anmelden am Online-System

Vorgehensweise beim Aufruf von CASCADE:

Bildschirm einschalten.

Es erscheint der Begrüßungsbildschirm der Gruppe Deutsche Börse:

```
Deutsche Boerse Systems  
  
System P1P3  
  
Nodename: B790743G   IP-Adresse: 172.19.36.155   Port: 22123  
  
Call Center  
  
-Telefon:    069-211-11000  
-Telefax:    069-211-11001
```

IMS1 eingeben und Datenfreigabetaste betätigen.

Als Ergebnis wird das Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse eingeblendet:

```
TRAN: MENU FC:      SB:

                               G r u p p e   D e u t s c h e   B o e r s e

Anwendungen stehen Ihnen aus folgenden Bereichen zur Verfügung:

BI:  XONTRO                KS:  Clearstream Banking AG, Frankfurt
                               Domestic
WS:  Wertpapier - Service - System    EK:  Engagementkontrolle
SO:  Sonstige Dienstleistungen

Verlassen IMS: TRAN=/RCL + evtl. vorh. Daten in FC, SB, ID-KZ, PW loeschen
```

In der ersten Zeile im Feld „FC“ das Kürzel „KS“ für Anwendungen der CBF Domestic eingeben.

In der vorletzten Zeile das ID-KZ (10-stelliges, numerisches, persönliches Identifizierungs-Kennzeichen) und Passwort eingeben.

Datenfreigabe (ENTER)

Es erscheint das Auswahlmenü der CBF Domestic Anwendungen:

```
TRAN: MENU FC:      SB:

                               C l e a r s t r e a m   B a n k i n g ,   F r a n k f u r t

Funktionsangebot fuer Clearstream Banking, Frankfurt - Domestic

CA:  CASCADE - Auftragsabwicklung    CE:  CARAD - Emissionsueberwachung
                               CP:  CARAD - Pruefstellen
CK:  CASCADE - Dienste                CD:  CARAD - Stueckenummernverwaltung
CR:  CASCADE - Dienste Namensaktien  KU:  Kundenstammdaten
KA:  Kapitaldienste                  EO:  Allgemeine Dienste
                               TB:  Taxbox Abgeltungsteuer Service
```

1.4.4.1 CASCADE Auftragsabwicklung Wertpapiere

Das Feld „FC“ in der ersten Zeile mit „CA“ für CASCADE füllen.

Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das CASCADE Hauptauswahlmenü Auftragsabwicklung Wertpapiere:

```
TRAN: MENU FC:      SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          H A U P T A U S W A H L

      ERFASSUNGSSTATUS                AUFTRAGSSTATUS

EE  ERFASSUNG GIROBEREICH BANK      AM  MATCH-DIENST
EW  ERFASSUNG WERTEBEREICH BANK     AS  SETTLEMENT-DIENST
ED  ERFASSUNG CBF                   AI  INFORMATION/ONLINE-DRUCK
EA  AENDERUNG/LOESCHUNG GIROBER.   AA  AENDERUNG/LOESCHUNG
EB  AENDERUNG/LOESCHUNG WERTEBER.  AL  LINK-DIENST
EI  INFORMATION/ONLINE-DRUCK
EK  KONTROLLE GIROBEREICH           AN  NOTFALL-DIENST
EC  KONTROLLE WERTEBEREICH         AB  BULK-PROCESSING
```

Sie können nun den Funktionscode der gewählten Anwendung eingeben (z. B. „EE“ für die Erfassung von Aufträgen).

Die Funktionscodes „AN“ und „AB“ stehen nur Clearstream-Mitarbeitern zur Verfügung.

1.4.4.2 CASCADE-Dienste

Das Feld „FC“ in der ersten Zeile mit „CK“ für CASCADE-Dienste füllen.

Datenfreigabe (ENTER).

Es erscheint das CASCADE-Dienste Hauptauswahlmenü:

```
TRAN: MENU FC:      SB:

CBF-DIENSTE              H A U P T A U S W A H L

DEPOT                    GELDKONTROLLE
DU  UMSAETZE              GC  COMMERCIAL BANK MONEY (CBM)
BA  BESTAND

                            KADI-INFORMATION
                            GI  DISPOSITION UND ABRECHNUNG

ALLGEMEINE INFORMATIONEN
AV  VEROEFFENTLICHUNGEN
```

Sie können nun den Funktionscode der gewählten Anwendung eingeben (z. B. „DU“ für die Anzeige von Depotumsätzen).

1.4.5 Abmelden vom Online-System

Und so können Sie sich aus der Anwendung „*abmelden*“:

Rückkehr vom CASCADE Hauptauswahlmenü zum Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse durch Betätigen der Taste PF11.

Es erscheint das Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse.

Im Einstiegsmenü ist der Transaktionscode „MENU“ (vgl. das Feld TRAN:) durch „/RCL“ zu überschreiben. Datenfreigabe betätigen.

Das erfolgreiche Verlassen des Systems wird durch das Erscheinen des Begrüßungsbildschirms der Gruppe Deutsche Börse dokumentiert.

Einen Hinweis zum Verlassen des Online-Systems IMS finden Sie immer in der Zeile 20 auf dem Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse.

1.4.6 Allgemeingültige Feldeingaberegeln

1.4.6.1 Felddefinitionen

Falls eine Eingabe nicht die maximale Anzahl von Stellen umfasst, die für dieses Feld vom Programm zugelassen ist, kann die Eingabe wahlweise linksbündig, rechtsbündig oder in der Mitte des Feldes erfolgen. Jede Eingabeform wird vom Programm verarbeitungsgerecht aufbereitet (numerische Felder = rechtsbündig; alphanumerische Felder = linksbündig).

Die Eingabe führender Nullen bei den Vorkommastellen und abschließender Nullen bei den Nachkommastellen ist möglich, aber nicht erforderlich.

Die Eingabe des Kommas ist nur erforderlich, wenn Nachkommastellen eingegeben werden.

Bei der Eingabe von Nachkommastellen ist die Eingabe mindestens einer Stelle vor dem Komma erforderlich, ggf. einer „0“.

Beispiel:

0,11 richtig
,11 falsch

1.4.6.2 Datumseingaben

Folgende Datumseingaben werden akzeptiert:

TTMM:	1406
TT.MM:	14.06
TTMMJJ:	140609
TT.M.JJ:	14.6.09
TT.MM.JJ:	14.06.09
TTMMJJJJ:	14062009
TT.MM.JJJJ:	14.06.2009

Von der Anwendung wird das eingegebene Datum in der Form „TT.MM.JJJJ“ aufbereitet.

1.4.6.3 Änderung eines Feldinhaltes

Die Änderung eines angezeigten Feldinhaltes ist durch Überschreiben möglich. Nicht überschriebene Stellen der Anzeige müssen gelöscht werden.

1.4.6.4 Löschung eines Feldinhaltes

Zur Löschung eines angezeigten Feldinhaltes existieren folgende Möglichkeiten:

- Den Cursor an der ersten Stelle des Feldes positionieren und die Taste „ENDE“ („END“) betätigen (Löschung des gesamten Feldes).
- Den Cursor an der ersten Stelle des Feldes positionieren und die Taste „ENTF“ („DEL“) betätigen (Löschung Zeichen für Zeichen).

1.4.6.5 Anzeige Fehlermeldungen

Bei fehlerhaften Feldeingaben werden in der Zeile 24 auf Ihrem Bildschirm Fehlermeldungen angezeigt.

1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
AA AUFTRAGSART	Auftragsart	2-stellig numerisch	***	<p>Numerisches Kennzeichen für eine CASCADE Auftragsart.</p> <p>Folgende Ausprägungen sind möglich:</p> <p>01 WP-Übertrag / Depotübertrag RS / non-CCP-Börsengeschäftsinstruktion (Lieferung) /Bestandsübertrag RS/ Emissionsein RS / CCP-OTC-WP-Übertrag</p> <p>02 Match-Instruktion/ Emissionseinführung R / non-CCP-Börsengeschäftsinstruktion (Er /CCP-Instruktion</p> <p>03 BSV-/ LSV-Übertrag</p> <p>04 Verpfändung *</p> <p>05 Freigabe *</p> <p>07 GBC-Umtausch</p> <p>09 GBC-Rücktausch</p> <p>11 WP-Leihauftrag *</p> <p>12 WP-Leihe/Rückführung *</p> <p>14 Strip-Aufteilung</p> <p>15 Strip-Zusammenführung</p> <p>16 Einlieferung für Einzelkunden/ techn. Sammelkunden, Neuzulassung/ Aufstockung für Globalurkunde + Jungschein, Valutierung von variabelurkunden (BIS-ZU)</p> <p>17 Optionsscheintrennung</p> <p>18 Auslieferung für Einzelkunden/ techn. Sammelkunden Auslieferung für Globalurkunde Jungschein Re-Valutierung von variablen Globalurkunden (BIS-ZU)</p> <p>19 Optionsscheinzusammenführung</p> <p>99 Storno/Nachbuchung Depotumsatz</p> <p>-----</p> <p>* nur für non-CCP-Geschäfte.</p>
ABR.BETRAG	Abrechnungsbetrag	13,2-stellig numerisch	Keine	Wird in der Vollanzeige eines Börsenumsatzes angezeigt: Abrechnungsbetrag eines Geschäftes
AEN	Verlinkung hinzufügen/ entfernen	LNK/UNL	Muss	LNK: Verlinkung hinzufügen UNL: Verlinkung entfernen
AKTIONÄRS-NUMMER	Aktionärsnummer bei Namensaktien	10-stellig	***	Hier wird die Aktionärsnummer angezeigt. Diese Nummer wird nur durch den Emittenten vergeben.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
AKTUELLER	Aktueller Kurswert	13,2-stellig numerisch	Keine	Aktueller Kurswert der Wertpapiere auf einem Depot.
ALPHA VON (BIS)	Alpha von (bis)	15-stellig alphanum.	Muss	Durch eine alphabetische Eingabe in die Felder „ALPHA VON“ und „BIS“ kann für den unter „KV/CL“ (vgl. Feld KV/CL) angegebenen Clearing-Partner eine Eingrenzung vorgenommen werden.
ALREADY MATCHED	Bereits gematched	J/leer	Kann	Folgende Eingaben sind möglich: leer (Default) Instruktion muss in T2S gematched werden. J Instruktion wird von CASCADE mit „Already matched“ Flag nach T2S gesendet und muss dort nicht mehr gematched werden. (Standardmäßig vorbelegt bei non-CCP Börsengeschäften). In diesem Fall ist der SAC der Gegenpartei ein Pflichtfeld. Die instruierende Partei kann mit diesem Kennzeichen gegen eigene Konten oder gegen Konten einstellen, für die sie eine Vollmacht besitzt.
ANZ K/V	Anzeige Kurz-/Vollanzeige	1-stellig alphanum.	Muss	Wahlmöglichkeit zwischen Kurz- oder Vollanzeige
AUFTRNR AUFTRAGSNR AUFTRNR A-NR GEGEN- AUFTRNR	Auftragsnummer	1-7-stellig numerisch	Muss	Eindeutigkeit je Eingabe muss systemseitig vorliegen. Von den Systemnutzern kann eine 7-stellige Nummer zwischen 1 und 6999999 frei vergeben werden. Automatisch generierte Aufträge aus Umlegungen und Stornos erhalten Auftragsnummern zwischen 8000000 und 9499999. CCP Aufträge erhalten eine 7-stellige Nummer zwischen 7000000 und 7999999.
AUFTRAGS-REFERENZ	Auftragsreferenz	16-stellig alphanum. (Swift Character Set X)	Kann	In KVEE/WE und KVEE/MI kann der Kunde eine eigene Referenz angeben, die als T2S Actor Reference genutzt wird. Die Referenz muss für die Instructing Party über einen Zeitraum von drei Monaten eindeutig sein (dies gilt auch für gelöschte Instruktionen). Gibt der Kunde keine eigene Referenz an, weist CBF dem Auftrag eine eindeutige T2S Actor Reference zu (OneClearstream ID). In Informationsmasken kann dieses Feld auch die Auftrags-Nummer eines Clearinghaus-/CSD-Teilnehmers im Clearinghaus- bzw. CSD-System und CCP Geschäftsnummer enthalten.
AUSWERTUNG	Auswertung	1-stellig alphanum.	Muss	Hier kann eine Terminierung der Listanforderung vorgenommen werden.
BANK	vgl. Last-/Gut-Bank			
BANK-IGSNR	Bankinterne Geschäftsnummer	5-stellig numerisch	Keine	Wird in der Vollanzeige eines Börsenumsatzes angezeigt.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
BANK-IKZ	Bankinternes Kennzeichen	2-stellig alpha-num.	Keine	Wird in der Vollanzeige eines Börsenumsatzes angezeigt.
BANK-NUMMER (CASCADE)	Banknummer	4-stellig numerisch	Muss	Kontostamnummer
BANK-NUMMER	Banknummer	4-stellig numerisch	Kann	Kontonummer der Zentrale oder Niederlassung. Ist diese Feld nicht gefüllt, so wird für die Verarbeitung die Banknummer aus der User-ID herangezogen (Ausnahme: CBF). Die Zentrale kann bis zu 16 Filialen im REG-ÜBER Verfahren direkt bearbeiten. Sind weitere Filialen vorhanden, so wird das Feld zum Muss-Feld.
BANK-NR DES KONTRAHENTEN	Bank-Nr. des Kontrahenten	4-stellig numerisch	***	Kontostamnummer des Kontrahenten
BATM/ADEA	Nutzung des BATM Services	J/N	Kann	<p>Nur wenn beide Kontrahenten dieses Kennzeichen mit „Ja“ gesetzt haben, kann die Instruktion nach der regulären DvP-Abwicklungszeit zum Settlement gelangen.</p> <p>Wenngleich beide Parteien das Feld gesetzt haben müssen, gehört das Feld nicht zu den T2S Matchkriterien.</p> <p>Nach erfolgreicher Instruktionserteilung ist keine Änderung des zuvor erfassten Werts möglich</p> <p>Folgende Eingaben stehen zur Verfügung:</p> <p>N (Default) Instruktion wird von CASCADE ohne „ADEA“ Flag nach T2S gesendet und unterliegt den normalen Abwicklungsfristen.</p> <p>J Instruktion wird von CASCADE mit „ADEA“ Flag nach T2S gesendet und unterliegt im Fall von einer Instruktion gegen/mit Zahlung der verlängerten Abwicklungsfrist für BATM-Geschäfte (siehe Kapitel 1.3.2).</p>
BEANTR STATUS	Beantragungs-Status	Text	Keine	Zeigt an, welcher Wert beantragt wurde. Für mögliche Ausprägungen siehe die Beschreibung des zugrundeliegenden Feldes.
BEARBEITUNGS STATUS	Bearbeitungs-Status	Text	Keine	Zeigt an, in welchem Status sich der beantragte Wert befindet. Für mögliche Ausprägungen siehe die Beschreibung des zugrundeliegenden Feldes.
BEGUENSTIGTER-NAME	siehe auch AA Rücktausch GBC			Name einer Drittbank oder eines Brokers, an den die Lagerstelle der CBF die Wertpapiere zu liefern hat
BELEGSCHAFTS-SP	Belegschafts-sperre	J/N	Muss	Sperrdatum bei der Übertragung von Belegschaftsaktien
BENE-IND (J/N)	Angabe zum Endbegünstigten	J/N	Kann	Der Kunde hat die Möglichkeit anzugeben, ob es einen Endbegünstigten-Wechsel gibt oder nicht. Relevant für den Portfolio-Transfer
BOERSENPL	Börsenplatz	4-stellig alpha-num.	Kann	In dieses Feld muss bei non-CCP-Börsengeschäften und OTC-Geschäften der Handelsplatz gemäß der ISO 10383 Market Identification Code (MIC) -Liste eingetragen werden. Eine Validierung durch CBF wird nicht vorgenommen.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
BUCHUNGEN siehe Buchungszeilen				Hier wird die Anzahl der ermittelten Zusatzbuchungen angezeigt.
BUCHUNGS-ZEILEN	Buchungszeilen		Keine	Hier werden die automatisch gebildeten Umsätze angezeigt.
CBF-INTERNATIONAL LAG	Lagerstellenkonto (CBF-LAG)	3-stellig	Keine	In diesem Feld wird die CBF interne Kennung und der Name der Lagerstelle für die sich im Ausland befindliche Original-WKN zu einer GBC-GS-WKN angezeigt. Beide Informationen werden vom System nach ENTER hinzugefügt.
CLRNG PL	Abwicklungsplatz	11-stellig alpha-num.	Kann	Hier kann ein Abwicklungsplatz, definiert über einen BIC11, eingetragen werden. Der BIC11 wird gegen das aktuelle Swift BIC Directory geprüft. Das Feld steht für die folgenden Instruktionstypen zur Verfügung: <ul style="list-style-type: none"> • CASCADE RS "Emissionseinführung" • CASCADE RS Account Transfer • CCP-Instruktionen • OTC (einschließlich Passive Matching) • Rechte/Teilrechte • TEFRA D
CoSD HOLD-STATUS	CoSD Hold-Status	1-stellig numerisch und Text	Keine	Folgende Ausprägungen sind möglich: <ul style="list-style-type: none"> • 0 - FREIGEgeben • 1 - GESPERRT AUFTRAGGEBER • 2 - GESPERRT EMPFAENGER • 3 - GESPERRT BEIDE SEITEN Der Beantragungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen: <ul style="list-style-type: none"> • FREI (freigegeben) Der Bearbeitungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen: <ul style="list-style-type: none"> • AEND BEANTRAGT • AEND ANGENOMMEN • AEND ABGELEHNT • AEND ABGEWIESEN • AEND DURCHGEF
CSD HOLD-STATUS	CSD Hold-Status	1-stellig numerisch und Text	Keine	Folgende Ausprägungen sind möglich: <ul style="list-style-type: none"> • 0 - FREIGEgeben • 1 - GESPERRT AUFTRAGGEBER • 2 - GESPERRT EMPFAENGER • 3 - GESPERRT BEIDE SEITEN Der Beantragungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen: <ul style="list-style-type: none"> • FREI (freigegeben) • BLOC (gesperrt) Der Bearbeitungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen: <ul style="list-style-type: none"> • AEND BEANTRAGT

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				<ul style="list-style-type: none"> • AEND ANGENOMMEN • AEND ABGELEHNT • AEND ABGEWIESEN • AEND DURCHGEF
CSD VALHOLD-STATUS	CSD Validation Hold-Status	1-stellig numerisch und Text	Keine	<p>Folgende Ausprägungen sind möglich:</p> <ul style="list-style-type: none"> • 0 – FREIGEgeben • 1 - GESPERRT AUFTRAGGEBER • 2 - GESPERRT EMPFAENGER • 3 - GESPERRT BEIDE SEITEN <p>Der Beantragungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen:</p> <ul style="list-style-type: none"> • FREI (freigegeben) <p>Der Bearbeitungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen:</p> <ul style="list-style-type: none"> • AEND BEANTRAGT • AEND ANGENOMMEN • AEND ABGELEHNT • AEND ABGEWIESEN • AEND DURCHGEF
DCA/REF	DCA / DCA Referenz	DCA: 34-stellig alphanum. / REF: 7-stellig numerisch	Kann	In diesem Feld kann in Instruktionen gegen/mit Zahlung der DCA bzw. die DCA Referenz eingetragen werden. Wird das Feld nicht gefüllt, zieht T2S automatisch den Default DCA für die Abwicklung heran.
DEPOTBUCH-BESTAND	Depotbuchbestand	14,6-stellig numerisch	Keine	Depotbuchbestand pro WKN und KONTO
DISPO-PRIORITAET	Dispositions-Priorität	1-stellig numerisch	Muss	<p>Durch Nutzung dieses Kennzeichens kann die Priorität eines Auftrages in der T2S Abwicklung gesteuert werden (siehe Band 1, Abschnitt 1.3.3. Dispositionsprioritäten).</p> <p>Der Beantragungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen:</p> <ul style="list-style-type: none"> • 3 • 4 <p>Der Bearbeitungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen:</p> <ul style="list-style-type: none"> • AEND BEANTRAGT • AEND ANGENOMMEN • AEND ABGELEHNT • AEND ABGEWIESEN • AEND DURCHGEF
DISPO-STATUS	Dispositionsstatus	1-stellig numerisch	Keine	Informations-Kennzeichen für den Dispositionsstatus eines Auftrages. Ausprägungen, siehe Band 2 Abschnitt 8.2.
DISPOSITIONS-BESTAND	Dispositionsbestand	14,6-stellig numerisch	Keine	Dieses Feld wird wegen der sofortigen Finalität der Wertpapiertransaktionen nicht mehr benötigt und daher nicht mehr befüllt.
DISPOSITIONS-SALDO	Dispositions-saldo	14,6-stellig numerisch	Keine	Dieses Feld wird wegen der sofortigen Finalität der Wertpapiertransaktionen nicht mehr benötigt und daher nicht mehr befüllt

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
EINHEIT	Einheit	2-stellig	Keine	Depotwährung (z. B. „ST“, „EUR“)
EMISS-EINF	Emissions-Einführung	J/N	***	Primary Market Abwicklungs-Kennzeichen. Für CASCADE RS-Aktien Muss-Information
EMPF	Empfänger	4-stellig num.	Muss	Banknummer des Empfängers bei der Anforderung einer Bestandsauswertung
EMPF-P1	Empfänger Settlement Party 1	BIC: 11 Stellen alphanumerisch / SAC: bis zu 35 Stellen alphanum.	***	Bei WP-Überträgen mit Kontrahent im Inland muss der BIC und SAC mit dem entsprechenden Gut-Konto korrespondieren.
EMPF-P2	Empfänger Settlement Party 2	BLZ: 8 Stellen numerisch / BIC: ohne Leerzeichen 8- oder 11-stellig/alphanum. / KTO: bis zu 35 Stellen alphanum. / TXT: bis zu 70 Zeichen Freitext / DSS: bis zu 8 Zeichen gefolgt von "/" gefolgt von bis zu 34 Zeichen	***	Auflistung einer zusätzlichen, hinter dem Empfänger-Konto stehenden Partei. Hinweis: Der ID-Type MSC wird nicht mehr unterstützt, daher muss – falls benötigt – die Eingabe mit ID-Type KTO oder ACC und Feldinhalt „MSC-NON-REF“ vorgenommen werden.) Die in Textfeldern verwendeten Zeichen müssen dem Zeichensatz (Character Set) X entsprechen.
EMPFANG-DATUM	Empfangsdatum	TT.MM.JJ	Muss	Empfangs- und Verarbeitungsdatum der File Transfer-Blöcke
ERFASSER	Erfasser	4-stellig numerisch	Muss	Über das Feld wird festgelegt, wer die Listanforderung bearbeitet. Das Feld wird vorbelegt mit den ersten vier Stellen des ID-Kennzeichens.
ERWERBSPREIS	Erwerbspreis	10,2-stellig numerisch	Kann	Der ausmachende Betrag ist hier einzugeben zuzüglich der Währungsangabe EUR.
ERWERBSTAG	Erwerbstag	TT.MM.JJ	Kann	Hier ist der Valuta-Tag einzutragen.
ERWORBEN / VERW.	erworben / verwahrt	J/N	Kann	In diesem Feld ist einzutragen, inwiefern das übertragende Institut die Wertpapiere für den Kunden erworben bzw. nur verwahrt hat.
EX-TRD	EX/CUM Kennzeichnung für Market Claim Verarbeitung	leer CCPN XCPN	Kann	Folgende Eingaben sind möglich: Leer (Default): Cum Kupon CCPN: Cum Kupon XCPN: Ex Kupon Wenn beide Kontrahenten die Kennzeichnung mit dem Wert „XCPN“ füllen, wird das Geschäft unabhängig vom Handelsdatum exklusive des letzten Kupons geliefert – Market Claims werden dann nicht ausgeführt, beziehungsweise Reverse Claims werden ausgeführt. Wenn beide Kontrahenten die Kennzeichnung mit dem Wert „CCPN“ oder gar nicht füllen, wird das Geschäft inklusive des letzten Kupons geliefert. Hinweis: Es kommt nur zum Matching, wenn beide Seiten entweder das gleiche oder kein Kennzeichen senden (siehe Kapitel 3.5).
EXT-SET-DAY	Externer Settlement-Day	TT.MM.JJ	Kann	Die zwischen den externen Teilnehmern (=Dritte) gültige Buchungsvaluta.
G-KONTO	Gegenkonto	7-stellig numerisch	Kann	Gegenkonto zu der unter KONTO eingegebenen Nummer

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
GELDVERR	Geldverrechnung	Textfeld	Keine	Hier erscheint ein Hinweis, ob ein automatischer Kontoausgleich bei EUR durchgeführt wurde.
GESCHÄFTSART	Geschäftsart	Auswahl	Kann	Im Feld "Geschäftsart" können Kunden eines der folgenden Filterkriterien festlegen ("O" für OTC-Geschäfte, "S" für Börsengeschäfte, "W" für elektronische Wertpapiere). Das Feld ist optional und bleibt standardmäßig unbefüllt.
GUT (CASCADE)	Gutschrift-Konto / -BIC	Konto: 4- bis 7-stellig numerisch / BIC: 11-stellig alphanum.	Muss	Hauptkonto, Unterkonto oder T2S Party BIC des Begünstigten Nach ENTER wird vom System die Kontobezeichnung und ggf. der T2S Party BIC bzw. das Gutschrift-Konto hinzugefügt. Bei Eingabe einer 4-stelligen Kontonummer wird automatisch „000“ ergänzt.
GUT-BANK	Gutschrift-Bank	4-stellig numerisch	***	Hauptkonto des Begünstigten (= Habenkonto)
GUT-KONTO-RTS	Gutschrift-konto-Bank Identifier Code	11-stellig alphanum.	Keine	BIC des Gut-Kontoinhabers bei der Zentralbank (RTGS-Konto)
HLG	Hinterlegungsart CBF	2-stellig numerisch	Muss	Dieses Feld orientiert sich an der internen Verwahrart der CBF für die jeweilige WKN. Folgende Ausprägung ist derzeit möglich: 01 = „GS“ (Girosammelverwahrung) Nach ENTER wird vom System die Bezeichnung hinzugefügt.
ID AENDERUNG / ID-LOESCHUNG	Identifizierungs-Kennzeichen zur Änderung bzw. Löschung	10-stellig numerisch	Keine	User-ID des Benutzers, der einen Auftrag zur Änderung bzw. Löschung markiert hat
IND	Art der verlinkten Referenz	A	Keine	Vorgefüllt mit „A“ für „T2S Actor Reference“.
ISO TRANSACTION CODE	ISO Transaction Code	Gemäß ISO 15022 / 20022	Keine	Folgende Ausprägungen sind möglich: BSBK Buy Sell Back relates to a buy sell back transaction BYIY Buy In The transaction relates to a buy-in by the market following a delivery transaction failure. CLAI Market Claim Transaction resulting from a market or reverse claim CNCB ¹² Central Bank Collateral Operation Collateral delivery/ receipt to a

¹² Kann nur durch Zentralbanken genutzt werden.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				<p>national central bank for central bank credit operations</p> <p>COLI Collateral In Collateral transaction, from the point of view of the collateral taker or its agent</p> <p>COLO Collateral Out Collateral transaction, from the point of view of the collateral giver or its agent</p> <p>ETFT Exchange Traded Funds ETF creation or redemption</p> <p>FCTA Factor Update</p> <p>INSP Move of Stock Movement of shares into or out of a pooled account</p> <p>MKDW Mark-Down Decrease of positions held by an International Central Securities Depository (ICSD) at the common depository due to custody operations (repurchase, pre-release, proceed of corp. event realigned)</p> <p>MKUP Mark-Up Increase of positions held by an International Central Securities Depository (ICSD) at the common depository due to custody operations (repurchase, pre-release, proceed of corporate event realigned)</p> <p>NETT Netting Relates to the netting of settlement instructions</p> <p>NSYN Non Syndicated Relates to the issue of medium and short term paper (CP, CD, MTN, notes etc.) under a program and without syndication arrangement.</p> <p>OWNE External Account Transfer Account transfer involving more than one instructing party (messages sender) and/or account servicer (messages receiver)</p>

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				<p>OWNI Internal Account Transfer Account transfer involving one instructing party (messages sender) at one account servicer (messages receiver)</p> <p>PAIR Pair-Off The transaction is paired off and netted against one or more previous transactions.</p> <p>PLAC Placement Relates to a placement/new issue of a financial instrument</p> <p>REDM Redemption (Funds) Relates to a redemption of funds (funds industry only)</p> <p>RELE DR Release/Cancellation Relates to a release (into/from local) of depository receipt operation</p> <p>REPU Repo Repurchase agreement transaction</p> <p>RODE Return of Delivery Without Matching Relates to a return of financial instruments resulting from a rejected delivery without matching operation</p> <p>RVPO Reverse Repo Relates to a reverse repurchase agreement transaction</p> <p>SBBK Sell Buy Back Relates to a sell buy back transaction</p> <p>SECB Securities borrowing operation</p> <p>SECL Securities lending operation</p> <p>SUBS Subscription to funds (funds industry only)</p> <p>SYND Syndiccate of Underwriters Relates to an issue of financial instruments through a syndicate of underwriters and a Lead Manager</p> <p>TBAC TBA Closing To Be Announced (TBA) closing trade</p>

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				<p>TRAD Trade Relates to a settlement of a trade</p> <p>TRPO Triparty Repo Relates to a tri-party repurchase agreement</p> <p>TRVO Triparty Reverse Repor Relates to a tri-party reverse repurchase agreement</p> <p>TURN Turnaround Relates to a turnaround: The same security is bought and sold to settle the same day, to or from different brokers.</p>
KE-DATUM	Datum bei bedingter Kapitalerhöhung	TT.MM.JJJJ	Muss	Angabe nur bei WP-Überträgen in RS WKN als Emissionseinführung
KONTO	Konto	7-stellig numerisch	Muss	Vgl. LAST / GUT
KONTO-RTS	Bank Identifier Code	11-stellig alphanum.	Keine	RTGS-Konto des Gut- bzw. Last-Kontoinhabers im Eurosystem
KONTROLL-KENNZEICHEN	Kontroll-Kennzeichen	1-stellig alphanum.	Muss	Dies Feld ist in der Funktion „Kontrolle“ vom Kontrolleur zu füllen. Die verschiedenen möglichen Kennzeichen finden Sie im Kapitel: Funktionen Erfassungsstatus.
KTO / TLN-NR	Konto- bzw. Teilnehmer-Nr.	n-stellig numerisch	Muss	Angabe einer vierstelligen Banknummer, wenn es sich um einen Teilnehmer bei der CBF handelt oder einer n-stelligen Nummer, wenn es sich um einen CSD/ICSD handelt.
KUNDEN-REFERENZ	Siehe auch Band 1, Abschnitt 1.4.8.2 sowie die einzelnen Auftragsarten		***	In diesem Feld kann der Auftraggeber bzw. Begünstigte Informationen zum Original-Auftraggeber oder Endbegünstigten spezifizieren. Bei den Auftragsarten Bestands-, Depotübertrag und WP-Übertrag mit Emissionseinführung identifizieren die Angaben in diesem Feld Instituts und/oder Depotnummer des Aktionärs.
KURS / WRG	Kurs und Währung	Kurs: 6,4-stellig numerisch; Währung: 3-stellig alphabetisch	Kann	Der von den Endteilnehmern vereinbarte Kurs mit der dazugehörigen Währung.
KZ	Kennzeichenspalte	1-stellig alphanum.	Kann	Zu den verschiedenen möglichen Kennzeichen vgl. die Vorgänge in den Kapiteln: Funktionen Erfassungsstatus, Auftragsstatus, Börsengeschäftsabwicklung
KZ-AA	Zusätzliches internes CBF Kennzeichen für OTC-Auftragsarten	1-stellig alphabetisch	Muss	<p>Art eines WP-Übertrages</p> <p>Es sind folgenden Ausprägungen möglich:</p> <p>A CCP-Surplus Delivery Auftrag</p> <p>B Bestandsübertrag (RS)</p> <p>C Xemac-Auftrag</p> <p>E Emissionseinführung (RS)</p>

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				P Depotübertrag (RS)
L / G	Lastschrift/ Gutschrift	L / G	Keine	Anzeige eines Last- oder Gutschriftauftrages
LAST (CASCADE)	Lastschrift- Konto bzw. - BIC	Konto: 4- bis 7- stellig numerisch / BIC: 11-stellig alphanum.	Muss	Hauptkonto, Unterkonto oder T2S Party BIC des Auftraggebers. Nach ENTER wird vom System die Konto- bezeichnung und ggf. der T2S Party BIC bzw. das Lastschrift-Konto hinzugefügt.
LAST-BANK	Lastschrift- Bank	4-stellig nume- risch	***	Hauptkonto des Auftraggebers (= Sollkonto)
LAST-KONTO- RTS	Lastschrift- konto-Bank Identifier Code	11-stellig alpha- num.	Keine	BIC des Last-Kontoinhabers bei der Zentralbank
LINK-REF	Verlinkte Refe- renz	16-stellig alpha- num.	***	Referenz in T2S, mit der die verlinkte bzw. zu verlin- kende Instruktion identifiziert wird. Es ist die Eingabe einer gültigen T2S Actor Reference erforderlich.
LINK OWNER BIC	BIC des Besit- zers der ver- linkten Refe- renz	11-stellig alpha- num.	***	Gibt den BIC11 des Besitzers der verlinkten Referenz an. Muss im BIC-Directory vorhanden sein.
LKZ	Länderkenn- zeichen	3-stellig alpha- num.	Muss (vorbe- legt)	An dieser Stelle muss das Länderkennzeichen des Begünstigten bei einem SV-Übertrag angegeben wer- den (AA 03).
LOESCH-STATUS	Lösch-Status des Auftrages	1-stellig nume- risch und Text	Keine	Folgende Ausprägungen sind möglich: <ul style="list-style-type: none"> • 0 – KEINE LOESCHANFRAGE • 1 – LOESCHUNG VON LAST-SEITE • 2 – LOESCHUNG VON GUT-SEITE • 3 – LOESCHUNG VON BEIDEN SEITEN Der Beantragungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen: <ul style="list-style-type: none"> • LSCH Der Bearbeitungs-Status kann hierfür folgende Aus- prägungen annehmen: <ul style="list-style-type: none"> • LSCH BEANTRAGT • LSCH ANGENOMMEN • LSCH OFFEN • LSCH ABGELEHNT • LSCH ABGEWIESEN • LSCH DURCHGEF
LZB-ENDSALDO	LZB-Endsaldo	14,2-stellig nume- risch	keine	Hier wird der Endsaldo der letzten Zentralbank-Ver- rechnung (in Euro) angezeigt.
MARKT	Internationale Märkte mit ein- em aktiven Settlement Link zu Clear- stream Ban- king AG, Frankfurt	2-stellig nume- risch	Muss	Angabe einer Markt-Nummer oder „A“ für alle (nur bei Alphasuche). Folgende Ausprägungen sind für CASCADE-Aufträge möglich: <p>01= DE CBF Germany CBF</p> <p>11= US DTCC USA DTCC</p> <p>60= CBL AS ISSUER CBL as issuer</p> <p>90= CH SIS AS ISSUER Switzerland SIX SIS as issuer</p>

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
MATCH-STATUS	Match-Status	2-stellig numerisch 1-stellig numerisch	keine	Informations-Kennzeichen für den Match-Status eines Auftrages. Ausprägungen, siehe Band 2 Abschnitt 7.2.
MITI REF	MITI Referenz	16-stellig alphanum.	keine	Die Referenz, die T2S einer angenommenen Instruktion zuweist (Market Infrastructure Transaction Identification).
NAME 1 / VORNAME 1	Name / Vorname	Textfeld; Die verwendeten Zeichen müssen dem Zeichensatz (Character Set) X entsprechen.	muss	Name und Vorname des Schuldbuchkonto-Inhabers bzw. bei Neueinträgen Name und Vorname des Begünstigten.
NAME 2 / VORNAME 2	Name / Vorname	Textfeld; Die verwendeten Zeichen müssen dem Zeichensatz (Character Set) X entsprechen.	kann	Bei Gemeinschaftskonten sind hier Name und Vorname des 2. Kontoinhabers einzutragen.
NOMINALE	Nominale / Nennwert	10,6-stellig numerisch;	muss	Der zwischen den Kontrahenten zu buchende Depot-Nominalbetrag. Wurde die Instruktion im DCP-Modus eingegeben oder handelt es sich um ein Allegement durch einen DCP oder Teilnehmer eines ausländischen CSD, so werden die Nachkommastellen ggf. abgeschnitten.
OPT-OUT	Opt-Out für einen laufenden Market Claim / Reverse Claim Prozess	J/leer	kann	Folgende Eingaben sind möglich: J Transaktion vom Market Claim/ Reverse Claim Prozess abgeschlossen. Leer Transaktion nicht abgeschlossen.(bei non-CCP-Börsengeschäften nicht gesetzt)
ORT	Ort	Textfeld	muss	BSV/LSV-Übertragung ergänzende Personendaten jetzt: Deutsche Finanzagentur (AA03).
P1	Settlement Party 1	BIC: 11-stellig alphanum. / SAC: bis zu 35 Stellen alphanum.	***	Bei WP-Überträgen mit Kontrahent im Inland ist der dem entsprechenden Last-/Gut-Konto zugeordnete T2S Party BIC und (im Falle eines 7-stelligen Last-/Gut-Kontos) SAC vorausgefüllt. Bei WP-Überträgen mit Kontrahent im Ausland ist eine Eingabe gemäß der Informationen im entsprechenden CASCADE Link Guide notwendig. Wird ein BIC eingegeben, so muss dieser im BIC-Directory vorhanden sein. Non-CCP-Börseninstruktionen werden immer mit zwei Settlement Party Levels enigestellt. Party Level 1 enthält das CBF-Abwicklungskonto (das Hauptkonto des Kunden), das für die Abwicklung von non-CCP-Börseninstruktionen vorgesehen ist.
P2	Settlement Party 2	BIC: 11-stellig alphanum. / SAC: bis zu 35 Stellen alphanum.		Non-CCP-Börseninstruktionen werden immer mit zwei Settlement Party Levels erstellt. Im Party Level 2 wird der tatsächliche Verkäufer/Käufer angegeben. Kunden, die als Reg-Über Zentrale agieren, werden in diesem Feld über die entsprechende Niederlassung informiert. Die entsprechenden Käufer- bzw. Verkäuferinformationen werden von der Börse geliefert.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
P3 – P5	Settlement Party 3-5	BLZ: 8 Stellen numerisch / BIC: ohne Leerzeichen 8- oder 11-stellig alphanum. / KTO: bis zu 35 Stellen alphanum. / TXT: bis zu 70 Zeichen Freitext / DSS: bis zu 8 Zeichen gefolgt von "/" gefolgt von bis zu 34 Zeichen	***	<p>Auflistung zusätzlicher, hinter dem instruierenden Konto stehenden Parteien. Bei WP-Überträgen mit Kontrahenten im Ausland ist eine Eingabe gemäß der Informationen im entsprechenden CASCADE Link Guide notwendig. Wird ein BIC eingegeben, so muss dieser im BIC-Directory vorhanden sein.</p> <p>Hinweis: Der ID-Type MSC wird nicht mehr unterstützt, daher muss – falls benötigt – die Eingabe mit ID-Type KTO oder ACC und Feldinhalt „MSC-NON-REF“ vorgenommen werden)</p>
PARTIAL SETTL INDICATOR	Partial Settlement Indicator	Leer/NPAR/PART/ PARQ/PARC	kann	<p>Leer (Default) Partial Settlement Indicator wird von CBF gemäß Default-Wert des Kontos nach T2S gesendet.</p> <p>NPAR Kein Partial Settlement erlaubt. Die Instruktion wird beim Partial Settlement nicht berücksichtigt.</p> <p>PART Partial Settlement ist erlaubt. Die Instruktion wird beim Partial Settlement berücksichtigt.</p> <p>PARQ Partial Settlement ist erlaubt, muss aber einen minimalen Wertpapierbetrag erfüllen. (Standardmäßig vorbelegt bei non-CCP-Börseninstruktionen.) Die Instruktion kann beim Partial Settlement nur berücksichtigt werden, wenn der in den T2S Wertpapierstammdaten angegebene minimale Abwicklungsschwellenwert überschritten wird. Der Schwellenwert wird von T2S geprüft.</p> <p>PARC Partial Settlement ist erlaubt, muss aber einen minimalen Geldgegenwert erfüllen. Die Instruktion kann beim Partial Settlement nur berücksichtigt werden, wenn der in den T2S Stammdaten definierte Wert überschritten wird. Der Wert hängt von der ISIN und der Währung des Geldgegenwerts ab. Der Schwellenwert wird von T2S geprüft.</p> <p>Der Beantragungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen:</p> <ul style="list-style-type: none"> • NPAR • PARC • PARQ • PART

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				Der Bearbeitungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen: <ul style="list-style-type: none"> • AEND BEANTRAGT • AEND ANGENOMMEN • AEND ABGELEHNT • AEND ABGEWIESEN • AEND DURCHGEF
PARTY-HOLD (CASCADE)	Settlement-Sperre	J/N	muss	Kennzeichen, ob ein Auftrag mit einer Settlement-Sperre versehen werden soll
PARTYHOLD-STATUS / PRYHLD-STATUS	Party Hold-Status des Auftrages	1-stellig numerisch und Text	keine	Folgende Ausprägungen sind möglich: 0 – FREIGEgeben 1 – GESPERRT AUFTRAGGEBER 2 – GESPERRT EMPFÄNGER 3 – GESPERRT BEIDE SEITEN Der Beantragungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen: FREI (Freigegeben) BLOC (Gesperrt) Der Bearbeitungs-Status kann hierfür folgende Ausprägungen annehmen: AEND BEANTRAGT AEND ANGENOMMEN AEND ABGELEHNT AEND ABGEWIESEN AEND DURCHGEF Wenn eine Instruktion mit einer Settlement-Sperre (CoSD HOLD-STATUS = BLOC [gesperrt]) gekennzeichnet ist, kann kein PARTY-HOLD („gesperrt“) für eine bereits freigegebene Instruktion gesetzt werden.
PERSON	Kennzeichen Person	1-stellig alpha-num.	***	Durch dieses Kennzeichen muss der Begünstigte bei einem „NEUEINTRAG“ in das Bundesschuldbuch angeben, ob eine natürliche oder eine juristische Person ein neues Schuldbuchkonto eröffnen möchte (AA03).
PLZ	Postleitzahl	5-stellig numerisch	muss	Bei Ortsangaben
POOL OWNER	BIC des Pool-Besitzers	11-stellig alpha-num.	***	Gibt den BIC11 des Pool-Besitzers an. Muss im BIC-Directory vorhanden sein.
POOL REF	Pool-Referenz	1- bis 11-stellig alphanum.	***	Gibt die Pool-Referenz an, an die eine Instruktion verlinkt werden soll. Muss für einen neuen Pool durch den Kunden initial festgelegt werden.
POOL ZAEHLER	Pool-Zähler	1- bis 3-stellig numerisch	***	Gibt die Anzahl der Instruktionen im Pool an. Muss für einen neuen Pool durch den Kunden initial festgelegt werden.
POSN	Link-Position	AFTE/BEFO/WITH/INFO	***	Gibt die Art der Verlinkung an. Folgende Eingaben sind möglich: AFTE Die verlinkte Instruktion muss nach oder zumindest zeitgleich mit der Instruktion, an die sie gelinkt ist, abgewickelt werden.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				<p>BEFO Die verlinkte Instruktion muss vor oder zumindest zeitgleich mit der Instruktion, an die sie gelinkt ist, abgewickelt werden.</p> <p>WITH Die verlinkte Instruktion muss zeitgleich mit der Instruktion, an die sie gelinkt ist, abgewickelt werden (Alles-oder-nichts Prinzip).</p> <p>INFO Die Instruktion ist nur zu Informationszwecken verlinkt (keine Auswirkung auf die Abwicklung). Nur unterstützt in der Erfassung von OTC-Geschäften (KVEE), nicht in der Änderung von OTC- und Börsengeschäften (KVAL).</p>
PRIMANOTE PN P	Primanote	1-3-stellig numerisch	kann	Der Kunde der CBF kann hier mehrere Aufträge unter einer von ihm selbst vergebenen Ordnungsnummer verwalten (Stapelerfassung). Für die Korrektheit dieser Nummer ist der Teilnehmer selbst verantwortlich, da systemseitig keine Überprüfung erfolgt.
PRTYHLD-STATUS	Party Hold-Status (Kurzanzeige)	1-stellig numerisch	Keine	Informations-Kennzeichen für den Party Hold-Status eines Auftrages (vgl. Band 2, Abschnitt 7.2)
REASON CODE	T2S Reason Code	Bis zu fünf 4-stellige Codes	keine	Informationsfeld über die von T2S zum jeweiligen Geschäft / zur jeweiligen Instruktion gemeldeten Reason Codes (z.B. Grund für „Hold“ Status). Erklärungen zu den verschiedenen T2S Reason Codes können der User Detailed Functional Description (UDFS) entnommen werden.
REFERENZ-NR	Referenz-Nummer (WP-Überträge)	16-stellig alpha-num.	kann	Hier kann die zwischen den Kontrahenten vereinbarte (WP-Übertrag) Auftragsbezugsnummer (Common Trade Reference) eingetragen werden.
RTGS – Konto	RTGS - Konto	11-stellig alpha-num.	keine	Kontenbezeichnung für registrierte Zentralbank-Konten im Eurosystem bzgl. der Geldverrechnung im Rahmen des TARGET2 Systems
RTS	Art der Regulierung	J/N	muss	Dieses Feld hat für T2S Instruktionen keine Relevanz und ist mit „N“ vorbelegt (nicht editierbar).
RUECK-UEBERTRAG	Rückübertrag	J/N	muss	Wenn ein früherer Auftrag direkt zwischen den Teilnehmer „storniert“ werden soll.
RULE-ID	ID der Regel für den CSD Validation-Hold	9-stellig numerisch	keine	Zeigt die ID der Regel an, auf dessen Grundlage der CSD Validation-Hold gesetzt wurde.
RULE-ID1 RULE-ID2	ID der Regel für den CoSD-Hold	9-stellig numerisch	keine	Zeigt die ID der Regel(n) an, auf dessen/deren Grundlage der CoSD-Hold gesetzt wurde.
SALDO-VORTRAG	Saldovortrag	14,2-stellig	keine	Im diesem Feld wird der Saldo aus der Zentralbank-Verrechnung angezeigt.
SCHLUSSTAG	Schlusstag	TT.MM.JJ	muss	Der Tag, an dem die Endteilnehmer das WP-Geschäft/Börsengeschäft abgeschlossen haben (Trade-date)

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
SEQUENZ-NR	Sequenz-Nummer in einem Pool	1- 3-stellig numerisch	***	Gibt die Sequenz-Nummer einer Instruktion in einem Pool an.
SET-DAY SET-D	Settlement-Day	TT.MM.JJJJ	muss	Buchungstag, zu dem Wertpapier- und Geldregulierung erfolgen soll (Wenn der Eingabe dies Feld nicht gefüllt hat, erfolgt eine automatische Voreinstellung der nächstmöglichen Buchungsvaluta). <i>Bedingung:</i> Settlement-Day muss kleiner oder gleich dem Tagesdatum oder Tagesdatum + 40 Bankarbeitstage sein
SETTLEMENT-SPERRE	Settlement-Sperre	1-stellig alphanum.	***	Kennzeichen, welches das gewählte Freigabe-Verfahren (Positiv / Negativ) bzw. den Verarbeitungsstatus des Börsengeschäftes widerspiegelt Folgende Ausprägungen sind möglich: S Gesperrte Geschäfte F Freigegebene Geschäfte L Von mindestens einer Seite zur Löschung markierter Geschäfte A Keine Einschränkung in Bezug auf Party Hold-Status oder Lösch-Status
SP-DATUM	Sperr-Datum	TT.MM. JJJJ	Kann	Dieses Feld ist bei der Übertragung von Belegschaftsaktien innerhalb der entsprechenden Sperrfrist zu füllen.
ST-ART	Stückart	20-stellig alphanum.	Keine	Gattungsspezifische Hinterlegungsart von Wertpapieren (z. B. Mantel und Bogen, Unikate, nur Mantel).
ST-ZINS	Stückzins	6,2-stellig numerisch	Kann	Dieses Feld ist bei der Übertragung an die Bundes- und Landesschuldenverwaltung u füllen. Zuzüglich die Währung EUR.
STATUS	Status der Verlinkung	Text	keine	Information über den Status einer geänderten Verlinkung Folgende Ausprägungen sind möglich: <ul style="list-style-type: none"> • BEANTRAGT • ANGENOMMEN • ABGELEHNT (nur in KVAI/HA) • ABGEWIESEN (nur in KVAI/HA) • AUSGEFUEHRT (nur in KVAI/HA)
STRASSE	Straße	Textfeld; Die verwendeten Zeichen müssen dem Zeichensatz (Character Set) X entsprechen.	Muss	
STRIPPING-FORM	Stripping-Form	2-stellig alphanum.	Keine	Angabe, in welcher Form eine Anleihe aufgeteilt werden soll: 2 Trennung cum-Anleihe in Mantel /Kupons
SV-KONTO	SV-Konto	7-stellig numerisch / 10-stellig alphanum.	Muss	Eingabe der 7-stelligen Schuldbuch-Kontonummer, die mit 0, 1, 3, 4, 6, 8 oder 9 beginnen muss.

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				Sofern für den Begünstigten noch kein Schuldbuch-Konto besteht, ist „NEUEINTRAG“ in das Feld einzugeben.
SWIFT-ADRESSE SWIFT-ADR	Swift-Adresse	12-stellig alpha-num.	***	Angabe einer gültigen Swift-Adresse
T2S ACCEPTED	Settlement Finality (SF1)	TT.MM.JJJJ und Uhrzeit HH:MM:SS	Keine	Zeigt den Zeitstempel für die Annahme der Instruktion auf der T2S-Plattform.
T2S ACTOR BIC	BIC11 des T2S Actors	11-stellig alpha-num.	Keine	BIC11 des T2S Actors, der den Auftrag instruiert hat (Instructing Party)
T2S ACTOR REFERENCE	T2S Actor Reference	16-stellig alpha-num.	Keine	Zeigt die Auftrags-Referenz des Kunden oder die von CBF vergebene Referenz (OneClearstream ID).
T2S MATCHED	Settlement Finality (SF2)	TT.MM.JJJJ und Uhrzeit HH:MM:SS	Keine	Zeigt den Zeitstempel, zu dem das Matching der Instruktion auf der T2S-Plattform erfolgte.
TAG DER GELDERRECHNUNG	Tag der Geldverrechnung	TT.MM.JJJJ	Muss	Auswahlkriterium im Rahmen der Geldvorabinformationsanzeige
TEXT	Text	Textfeld	Kann	Hier können zusätzliche Informationen für den Begünstigten eingetragen werden.
TR	Teilrechte: Umwandlung von Teilrechte in Vollrechte bzw. Umwandlung von Vollrechte in Teilrechte oder Umwandlung von Aktienspitzen/ Aktienanrechten in Originalaktien bzw. von Originalaktien in Aktienspitzen/ Aktienanrechten	1-stellig numerisch	kann	Bei der Umwandlung von Teilrechte- in Vollrechte-Wertpapierbestände oder von Vollrechte- in Teilrechte-Wertpapierbestände sind folgende Ausprägungen möglich: 1 Teilrechte in Vollrechte 2 Vollrechte in Teilrechte. (Vollrechte in Namensaktien (RS) werden immer über den freien Meldebestand mit KE-TYP gebucht. Bei der Umwandlung von Aktienspitzen/Aktienanrechten in Originalaktien oder von Originalaktien in Aktienspitzen/Aktienanrechten sind folgende Ausprägungen sind möglich: 3 Spitzen/Anrechte in Originalaktien* 4 Originalaktien* in Spitzen/Anrechte 5 Spitzen/Anrechte in Originalaktien* 6 Originalaktien* in Spitzen/Anrechte ----- *
TRADE-DATE	Trade-Date Schluss-Tag Handelstag	TT.MM.JJ	muss	Tag, an dem ein Geschäft abgeschlossen wurde (Schlusstag oder Handelstag)
UEB-GRUND UEB-G	Übertragungsgrund 1 WP-Übertragungen	3-stellig numerisch	kann	Es sind folgende Ausprägungen möglich: 101 OTC-Geschäftsbelieferung (DvP) 102 OTC-Geschäftsbelieferung (FOP) 103 Realignment 104 Lieferung für Kundendepot 201 Repo mit Gegenwert

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				202 Repo ohne Gegenwert 203 Repo (open) 204 Repo (return) 220 CBL Non-CSD Transfer 221 EOC FIN Transfer 401 Neuemission/IPO 501 Corporate Action UM 502 Corporate Action KE 503 BR-Ausübung 504 BR-Handel 505 Angebote 506 OS-Ausübung 507 OTC/SE Kompensation 509 Storno OTC/ SE Kompensation 511 OTC Reverse Claim 513 Storno OTC Reverse Claim 515 Corporate Action TI 601 Others 701 Collateral (open) 702 Collateral (return) 901 Rejection/Storno 950 Nur DTCC Transfers mit Reason Code 280 951 Nur DTCC Transfers mit Reason Code 290 952 Nur DTCC Transfers mit Reason Code 040 953 Nur DTCC Transfers mit Reason Code 098
UEBERTRAG-ART	SV-Übertragungsart für Übertragungen von bzw. an Deutsche Finanzagentur	1-stellig numerisch	Muss	Kennzeichen für die Richtung der Schuldbuchforderungsübertragung (Übertrag in Einzel- oder Sammelschuldbuchforderung). Folgende Ausprägungen sind möglich: 1 an SV Einzelschuldbuchforderung 2 von SV Sammelschuldbuchforderung

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
UMSATZART	Umsatzart	1-stellig alpha-num.	***	Folgende Ausprägungen sind möglich: L Lastschrift G Gutschrift
VA	Verarbeitungsstatus	1-stellig alpha-num.	Keine	Anzeige des Verarbeitungsstatus der Ertragnisbeiträge bei der Geldvorabinformation. Es sind folgende Ausprägungen möglich: V Vorabinformation zu den Ertragnisdaten E Endgültige Ertragnisdaten
VALUTA, VALUTAZEIT-RAUM	Valuta	TT.MM.JHJJ	***	Eingabe einzeln oder als Intervall möglich (Buchungstag bis 120 Tage historisch).
VALUTA LTE.BEW.	Valuta Letzte Bewegung	TT.MM.JHJJ	Keine	In diesem Feld wird in der Depotanzeige das Datum der letzten Bewegung angezeigt
VERARB. STATUS	Verarbeitungsstatus	Textfeld	Keine	Anzeige des SDS-Verarbeitungsstatus in der Gelddispositionsanzeige (Transaktion: KVUM / GU)
VERARB-STATUS	Verarbeitungsstatus	3-stellig numerisch	Kann	Verarbeitungsstatus der Geldüberweisungsaufträge bzw. der Widerrufe im Rahmen von RTS mit Gegenwert EUR (vgl. Band 2, Abschnitt 7.2)
VERWENDUNGS-ZWECK	Verwendungszweck	10-stellig numerisch	Kann	Wichtiges Zuordnungskriterium im Rahmen von RTS mit Gegenwert Euro. Setzt sich aus der CBF-Nummer des Eingabers der Match-Instruktion (vstellig) sowie der Auftrags-Nr. der Match-Instruktion (7-stellig) zusammen.
VS VERARB-STATUS	vgl. Verarbeitungsstatus			
VWA (CASCADE)	Verwahrart	2-stellig alpha-num.	Keine	Das Feld wird mit „GS“ für Girosammelverwahrung vorbelegt und ist nicht überschreibbar.
WAEHRUNG	Währung	3-stellig alpha-num.	Muss	Zugelassene Währungen, in denen Geschäfte verarbeitet werden können
WAEHRUNG GEGENWERT	Währung Gegenwert	3-stellig alpha	Muss	Eingabemöglichkeiten: EUR = Euro
WEITERLEITUNG AN	Weiterleitung an	35-stellig alpha-num.	Kann	An dieser Stelle kann beispielsweise eine bestimmte Empfangsabteilung beim Kunden der CBF angegeben werden.
WKN WP-KENNUNG	Wertpapier-Kennung/ISIN	siehe Erklärung	Muss	Abhängig von der Eingabe. Bei der WP-Kennung gelten für die WKN folgende Bedingungen: W 6-stellig numerisch und größer als 100.000 I 12-stellig alphanumerisch B 3 bzw.4-stellig alphanumerisch F 7-stellig numerisch D 7-stellig alphanumerisch E 4-stellig alphanumerisch

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
WKN BIS	Wertpapierkennnummer bis	12-stellig numerisch	Kann	Dieses Feld kann zur Eingrenzung eines Kennnummernkreises gefüllt werden.
WKN D. RECHTS	Wertpapierkennnummer	6-stellig numerisch	Muss	Der Kapitalerhöhungstyp bei einer Namensaktie stellt sich aus der WKN des Rechts und dem entsprechenden Ex-Tag der Maßnahme dar.
WKN-INFO (Ausgabezeile nach WKN)	Wertpapierbezeichnung	Textfeld	Keine	<p><i>Erste Zeile:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • Zinssatz (bei Renten) • Wertpapier-Kurzbezeichnung • Zinstermin (bei Renten) <p><i>Zweite Zeile:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • Gattungssperre mit Gültigkeitszeitraum • Verlosungs-, Rückzahlungs- bzw. Kündigungsinformationen
WP-KENNUNG	Wertpapierkennung siehe auch WKN	1-stellig alpha-num.	Muss	<p><i>Eingabemöglichkeiten:</i></p> <p>W Deutsche WKN</p> <p>I ISIN</p> <p>B Börsenkürzel</p> <p>F COMMON CODE Vorbelegung: I</p>
WRG (CASCADE)	Währung Gegenwert	3-stellig	Muss	<p>Zugelassene Währungen, in denen Gegenwerte über Bankguthaben (commercial bank money) verrechnet werden können.</p> <p><i>Eingabemöglichkeiten:</i></p> <p>AUD Australien</p> <p>CAD Kanada</p> <p>CHF Schweiz</p> <p>CNY China</p> <p>CZK Tschechien</p> <p>DKK Dänische Kronen</p> <p>EUR EWWU</p> <p>GBP Großbritannien</p> <p>HKD Hongkong Dollar</p> <p>HUF Ungarn</p> <p>JPY Japan</p> <p>MXN Mexiko</p> <p>NOK Norwegen</p> <p>NZD Neuseeland</p> <p>PLN Polen</p> <p>RUB Russland</p>

Feld auf der Maske	Bedeutung	Formal korrekt	Eingabe	Erklärung
				SEK Schweden SGD Singapur TRY Türkei USD US-Dollar ZAR Südafrika Nähere Informationen zur Geldverrechnung in Fremdwährung können dem CBF Kundenhandbuch (Kapitel 4.3) entnommen werden. Bei Gegenwertverrechnung in Schweizer Franken (CHF) und Einbeziehung eines Wertpapiers mit CH-ISIN ist die Beschreibung im CBF Kundenhandbuch (Kapitel 4.4) zu berücksichtigen.
ZIELREF	Zielkundenreferenznummer	3/11-stellig 3/13-stellig	Keine	Bei der Auftragsart Depotübertrag -extern- in RS wird dieses Referenzfeld mit der CBF- und der Auftragsnummer systemseitig gefüllt.
ZU-GUNSTEN-KTO	zu-Gunsten-Konto	7-stellig	Muss	Bei der Auftragsart Optionsscheintrennung können die notwendigen Zusatzbuchungen für die Optionsanleihen-ex und die nur-Optionsscheine über ein abweichendes Depotkonto erfolgen.
ZU-LASTEN-KTO	zu-Lasten-Konto	7-stellig	Muss	Bei der Auftragsart Optionsscheinzusammenführung können die notwendigen Zusatzbuchungen für die Optionsanleihen-ex und die nur-Optionsscheine über ein abweichendes Depotkonto des Auftraggebers erfolgen.

*** Muss- oder Kannfeld kann nicht eindeutig festgelegt werden, sondern hängt vom jeweiligen Vorgang ab.

1.4.8 Spezifische Feldbeschreibungen und Formalprüfungen

1.4.8.1 Die Zuordnungsnummern

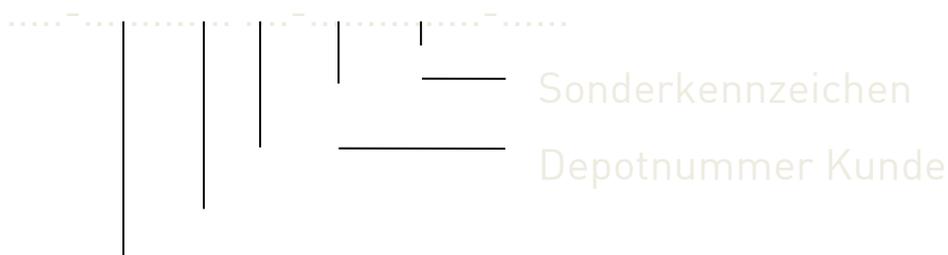
Die Stückenummern aus den eingelieferten Urkunden von Namensaktien (RS) werden mit der GS-Umstellung zu Zuordnungsnummern und im erweiterten Bestand zur jeweiligen Aktionärsnummer mitgeführt. Zu den Auftragsarten Depotübertrag, Bestandsübertrag und Emissionseinführung sind keine Zuordnungsnummern vom Kunden der CBF vorzugeben.

1.4.8.2 Die Kundenreferenz

Die Kundenreferenz ermöglicht dem Eingabe je gewählter Auftragsart, Auftragsinformationen bezüglich des Auftraggebers bzw. Endbegünstigten zu spezifizieren. Sofern kein zweiter Kunde der CBF am Auftrag beteiligt ist, enthält die Kundenreferenz stets die Geschäftsteilnehmerdaten der eingebenden Seite. Zukünftig sollen damit sukzessive in allen betroffenen Auftragsarten die Felder Original-Auftraggeber und Endbegünstigter abgelöst werden.

Format und Inhalt der Kundenreferenz sind entsprechend standardisiert und werden, sofern allgemein gültig, in den nachfolgenden Abschnitten beschrieben. Auftragspezifische Gegebenheiten sind in den entsprechenden Kapiteln dokumentiert.

Feldformate:



Bestandteil	Bedeutung korrekt	Formal	Eingabe	Erklärung
Geschäftsteilnehmer-Identifikations-Typ (GIT)	Geschäftsteilnehmer	3-stellig numerisch	kann	<p>Dieses Feld kann mit einem dreistelligen Kürzel belegt werden, welches die Angabe der Kundenreferenz Drittbank bzw. des Kunden im Hinblick auf eine maschinelle Weiterverarbeitung unterstützt. Folgende Inhalte werden derzeit bei der Eingabe formal geprüft:</p> <ul style="list-style-type: none"> • BIC für Bank-Identifikations-Code • BLZ für Bankleitzahl • KTO für Konto <p>Wird die Kundenreferenz GIT Drittbank mit einem der aufgelisteten Kürzel belegt, muss eine Eingabe für die Kundenreferenz Drittbank erfolgen.</p>
Institutsnummer (Drittbank)	Institutsnummer Drittbank	Max. 11-stellig alphanum.	kann	<p>Konto/Filialnummer der Niederlassung des Kunden der CBF Die formale Eingabe der Drittbank richtet sich nach der gewählten GIT-Ausprägung:</p> <ul style="list-style-type: none"> • GIT Drittbank • BIC = Durchgängig 8- oder 11-stellig • BLZ = 8-stellig • KTO = 13-stellig • SEC = 8-stellig (max.) <p>Die Kundenreferenz Drittbank kann auch ohne Angabe einer GIT für die Drittbank angegeben werden.</p>
Kunde	Kunde	Max. 13-stellig alphanum.	*	<p>Konto/Filialnummer der Niederlassung eines Teilnehmers der CBF bzw. Kontonummer des Kunden, der hinter dem Teilnehmer der CBF bzw. der Drittbank steht (Auftraggeber, Begünstigter).</p> <p>Die formale Eingabe des Kunden richtet sich nach der gewählten GIT-Ausprägung:</p> <ul style="list-style-type: none"> • GIT Drittbank • BIC = 8- oder 11-stellig • BLZ = 8-stellig • KTO = 13-stellig <p>Die Kundenreferenz Kunde kann auch ohne Angabe einer GIT für den Kunden eingegeben werden.</p>
Sonderkennzeichen	Sonderkennzeichen	2-stellig numerisch	keine	Keine Belegung.

* Muss- oder Kannfeld kann nicht eindeutig festgelegt werden, sondern hängt vom jeweiligen Vorgang ab.

1.5 Kontakte

Clearstream Banking Frankfurt

[Clearstream Client Services](#)

Mergenthalerallee 61
D-65760 Eschborn

www.clearstream.com

1.5.1 Ansprechpartner für CASCADE

1.5.1.1 Fachfragen

Die Kontaktdaten von Client Services, einschließlich Connectivity Support, Global Securities Financing, Investment Fund Services und Tax Help Desk, finden Sie auf der Clearstream-Website unter Contacts & Client Services.

1.5.1.2 Fachfragen zu deutschen GS-Namensaktien (RS)

Clearstream Banking AG

[Registered Shares Team](#)

1.5.1.3 Security-Angelegenheiten für die Online-Anwendungen

Deutsche Börse AG

[Haupt-Security-Beauftragter](#)

2 Abwicklung Börsengeschäft (ohne CCP)

Die Abwicklung der Börsengeschäfte in Nicht-CCP-Instrumenten (CSC und NCSC-T) ist in das CASCADE Online-System integriert und findet in einem OTC-ähnlichen Modus statt.

Die Verarbeitung und das Reporting von Instruktionen und das Lifecycle-Management für non-CCP- Börsengeschäfte in Wertpapieren mit der Verwahrungsart NCSC (Non-Collective Safe Custody) wird über Creation gematcht und ausgeführt. Diese Instruktionen werden in einem "OTC-ähnlichen" Modus über automatisierte Clearstream Xact-Verbindungskanäle (ISO 15022) und das Xact Web Portal (GUI) verarbeitet.

Die Einstellung der Instruktionen erfolgt ausschließlich automatisiert über die SETI-Schnittstelle. Über diese werden an deutschen Börsen (wie Börse Frankfurt, Börse Stuttgart, Tradegate oder über BrainTrade) gehandelte Geschäfte mit Abwicklungswährung Euro oder Fremdwährung eingestellt.

Die Änderung von Börsengeschäften folgt denselben Prozessen wie bei „already matched“ eingestellten OTC-Instruktionen, das Reporting wird über dieselben Kommunikationskanäle gesteuert.

Durch Eingabe des Funktionscodes „CA“ im Einstiegsmenü der Gruppe Deutsche Börse „Funktionsangebot für den Bereich Clearstream Banking AG, Frankfurt Domestic“ (siehe Band 1, Abschnitt 2.3.4 [Anmelden am Online-System](#)) wird das Hauptauswahlmenü „CASCADE Auftragsabwicklung“ aufgerufen:

```
TRAN: MENU FC:      SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          H A U P T A U S W A H L

      ERFASSUNGSSTATUS          AUFTRAGSSTATUS

      EE  ERFASSUNG GIROBEREICH BANK      AM  MATCH-DIENST
      EW  ERFASSUNG WERTEBEREICH BANK      AS  SETTLEMENT-DIENST
      ED  ERFASSUNG CBF                    AI  INFORMATION/ONLINE-DRUCK
      EA  AENDERUNG/LOESCHUNG GIROBER.     AA  AENDERUNG/LOESCHUNG
      EB  AENDERUNG/LOESCHUNG WERTEBER.
      EI  INFORMATION/ONLINE-DRUCK         AN  NOTFALL-DIENST
      EK  KONTROLLE GIROBEREICH           AB  BULK-PROCESSING
      EC  KONTROLLE WERTEBEREICH

KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus
```

2.1 Auftragsabwicklung

Non-CCP-Börsengeschäfte werden aus den jeweiligen Börsensystemen an CBF übergeleitet und als Lieferinstruktion gemäß von dem Kunden gewählten Freigabeverfahren (gesperrt oder freigegeben) über die SETI-Schnittstelle in CASCADE eingestellt. Börsengeschäfte in GS-Wertpapieren werden zur Abwicklung an T2S als „already matched“ weitergeleitet.

Die Erfüllungsfrist beträgt in der Regel zwei Tage (T+2).

Für die weitere Auftragsabwicklung ist entscheidend, für welches Lieferfreigabeverfahren das Abwicklungskonto des Kunden aufgesetzt ist. Hier gibt es zwei Möglichkeiten:

Beim Party -Hold oder Positiv-Verfahren werden alle Verkauf-Lieferinstruktionen zunächst mit einer Settlement-Sperre in CASCADE eingestellt und sind dann vom Kunden oder dem von ihm mit der Abwicklung des non-CCP Börsengeschäfts beauftragten Instituts freizugeben. Börsengeschäfte in GS-Wertpapieren werden in diesem Fall mit einem „Hold“ Flag an T2S weitergeleitet.

Beim Release oder Negativ-Verfahren werden alle Verkauf-Lieferinstruktionen sofort zur Belieferung freigegeben, können aber vom Kunden oder dem von ihm mit der Abwicklung des non-CCP Börsengeschäfts beauftragten Instituts noch bis vor Beginn des nächsten Settlementzyklus gesperrt werden. Börsengeschäfte in GS-Wertpapieren können vom Kunden auf „Hold“ gesetzt werden, solange diese in T2S schwebend sind¹³.

Börsengeschäfte mit identischem Last- und Gutschriftkonto in CASCADE (sogenannte Kompensationsgeschäfte) werden abhängig vom gewählten Lieferfreigabeverfahren mit (Positiv-Verfahren) oder ohne (Negativ-Verfahren) Settlement-Sperre in den Lieferbestand eingestellt und im Fall von GS-Wertpapieren dementsprechend mit oder ohne „Hold“ Flag an T2S weitergeleitet.

Die weitere Auftragsbearbeitung ist mit der für OTC-Geschäfte identisch (siehe Kapitel 3 Abwicklung OTC-Geschäft).

Beispiel eines Börsengeschäftes in der CASCADE Online Informationsanzeige:

AUFTRAGSABWICKLUNG		I N F O R M A T I O N		AUFTRAGSSTATUS
TRAN:	KVAI FC: AA SB: 02##1234#I###S#			
AA	AUFTRAGSART : 02		KZ-AA: .	
AN	AUFTRAGS-NUMMER :			
AR	REFERENZ : M			
AD	NICHT ERFOLGREICH DISPONIERTE AUFTRAEGE			
MA	MATCH-AUFTRAEGE : .	M/O/F	(MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)	
MI	MATCH-INSTRUKTIONEN : .	M/O/F	(MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)	
AK	AUFTRAEGE KAPITALDIENSTE TA : ...	BID	:	
CI	ALLE AUFTRAEGE ZU EINER ISIN			
ZUSAETZLICHE	LASTSCHRIFT-BANK : 1234	WKN	: I	
AUSWAHL	GUTSCHRIFT-BANK :	SETTLEMENT-DAY	:	
	GESCHAEFTSART : S	WRG GEGENWERT	: ...	
HA	HISTORISCHE AUFTRAEGE		EINGEBER :	

¹³ Bereits das einseitige Setzen einer Settlement-Sperre bewirkt auf T2S einen „Hold“ Status für beide Legs. Im Falle einer zweiseitigen Settlement-Sperre wird der „Hold“ Status der beiden Legs auf T2S erst dann wieder entfernt, wenn beide Seiten das Geschäft freigegeben haben.

```

TRAN: KVAI FC: AA SB: 02##1234#I####S#

AUFTRAGSABWICKLUNG MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR : 7250234

LAST : 1234 000 TESTBANK 1 / TESTDEFFXXX
GUT : 9999 000 KUNDENBANK / TESTDEMMXXX
WKN : I DE000A0Q8A07 CONCEPT AURELIA GLOBAL

NOMINALE : 100 EINHEIT: ST DISPO-PRIORITAET:
GEGENWERT: 1.000,00 WRG : EUR VWA : GS GS
DCA/REF : EMISS-EINF: N
SET-DAY : 21.06.2022 EX-TRD : BATM/ADEA : N
BOERSENPL: DUSB OPT-OUT: CLRNG PL :

MATCH-STATUS : 02 AUFTRAG BESTAETIGT MIT GEGENAUFTRAG NUMMER 7250000
PRTYHLD-STATUS: 1 GESPERRT AUFTRAGGEBER
DISPO-STATUS : 4 OFFEN WEGEN SETTLEMENT-SPERRE (LIEFERER)

```

```

TRAN: KVAI FC: AA SB: 02##1234#I####S#

AUFTRAGSABWICKLUNG MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION-2 AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR: 7250962 WKN: I DE000A0Q8A07

T2S ACTOR BIC: DAKVDEFFLIO T2S ACTOR REF : SAA0Q8A0D47B0974
MITI REF : 2206202373158800
REFERENZ-NR : LP2206170000020 AUFTRAGS-REFERENZ:
ALREADY MATCHED : A PARTIAL SETTL IND: PARQ BENE-IND:
ISO TRANSACTION CODE: TRAD REASON CODE : PRCY
T2S ACCEPTED : 20.06.2022 08:01:54 T2S MATCHED : 20.06.2022 08:01:54
SCHLUSSTAG : 17.06.2022 KURS / WRG : 10,0000 EUR
PARTIAL BUYIN IND:
UEB-GRUND : BUCH-TXT-GELD:
CA-OPTION NR : CA-OPTION KEY:

KADI-LAUF-NR: KADI-TA :
TEXT: /IDAY 20220617

```

3 Abwicklung OTC-Geschäft

Unter der Erfassung ist die *Neueingabe von Aufträgen in den Erfassungsstatus* zu verstehen. Sie kann sowohl von den Kunden als auch von der CBF durchgeführt werden.

Durch Eingabe des Funktionscodes „CA“ im Einstiegsmenü „Funktionsangebot für den Bereich Clearstream Banking AG, Frankfurt-Domestic“ (siehe Band 1, Abschnitt 2.3.4 [Anmelden am Online-System](#)) wird das Hauptauswahlmenü Auftragsabwicklung Wertpapiere in „CASCADE“ aufgerufen:

```

TRAN: MENU FC:      SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      H A U P T A U S W A H L

      ERFASSUNGSSTATUS      AUFTRAGSSTATUS

      EE  ERFASSUNG GIROBEREICH BANK      AM  MATCH-DIENST
      EW  ERFASSUNG WERTEBEREICH BANK      AS  SETTLEMENT-DIENST
      ED  ERFASSUNG CBF                    AI  INFORMATION/ONLINE-DRUCK
      EA  AENDERUNG/LOESCHUNG GIROBER.    AA  AENDERUNG/LOESCHUNG
      EB  AENDERUNG/LOESCHUNG WERTEBER.
      EI  INFORMATION/ONLINE-DRUCK        AN  NOTFALL-DIENST
      EK  KONTROLLE GIROBEREICH           AB  BULK-PROCESSING
      EC  KONTROLLE WERTEBEREICH

KV0005I Funktion beendet, bitte wählen Sie aus
    
```

Ausgehend von dem Hauptauswahlmenü gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes „EE“ zum Auswahlmenü der Erfassung:

```

TRAN: KVEE FC:      SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      E R F A S S U N G      GIROBEREICH BANK      ERFASSUNGSSTATUS

      WE  WP-UEBERTRAG EINZEL              LE  LSV-UEBERTRAG
      WM  WP-UEBERTRAG MEHRFACH            BE  BSV-UEBERTRAG EINZEL
      MI  MATCH-INSTRUKTION WP-UEBERTRAG
                                         UT  UMTAUSCH
      BV  BESTANDSUEBERTRAG                RT  RUECKTAUSCH
      DV  DEPOTUEBERTRAG
                                         OT  OPTIONSSCHEINTRENNUNG
      TD  TEFRA-D FREIGABE                 OZ  OPTIONSSCHEINZUSAMMENF.
                                         SA  STRIP-AUFTEILUNG
                                         SZ  STRIP-ZUSAMMENFUEHRUNG

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

Kunden der CBF können die folgenden Funktionscodes nutzen:

WE	WP-Übertrag einzeln
WM	WP-Übertrag mehrfach
MI	Match-Instruktion zu einem WP-Übertrag
BV	Bestandsübertrag (nur für Namensaktien-RS) ohne Gegenwert
DV	Depotübertrag (nur für Namensaktien-RS) ohne Gegenwert
TD	Freigabe von TEFRA D Wertpapierbeständen
LE	LSV-Übertrag (Landesschuldbuch) ohne Gegenwert
BE	BSV-Übertrag (jetzt: Deutsche Finanzagentur) ohne Gegenwert
UT	Umtausch GBC
RT	Rücktausch GBC
OT	Optionsscheintrennung
OZ	Optionsscheinzusammenführung
SA	Strip-Aufteilung
SZ	Strip-Zusammenführung

Die Funktionscodes BV und DV stellen Services für Namensaktien dar und werden in Band 2 unter Kapitel 3 erläutert.

3.1 Auftragserteilung (EE)

Folgende WP-Überträge werden hier erfasst:

WP-Übertrag Inland, d. h.

Bei einem Wertpapierübertrag Inland ist der Kontrahent direkt Teilnehmer bei CBF.

Es sind folgende Auftragserteilungen möglich:

- WP-Übertrag Inland ohne Zahlung (Match-Auftrag)
- WP-Übertrag Inland gegen Zahlung in EUR (Match-Auftrag)
- WP-Übertrag Inland mit Zahlung in EUR (Match-Auftrag)
- Zahlung Inland in EUR ohne WP-Übertrag (Match-Auftrag)¹⁴
- WP-Übertrag Inland gegen Zahlung in zugelassener Fremdwährung (Match-Auftrag)

WP-Übertrag Ausland (Cross-border), d. h.

Bei einem Wertpapierübertrag Ausland ist der Kontrahent Teilnehmer bei einem ausländischen Zentralverwahrer (CSD bzw. ICSD).

Es sind folgende Auftragserteilungen möglich:

- WP-Übertrag Ausland frei von Zahlung (Match-Auftrag)
- WP-Übertrag Ausland gegen Zahlung in EUR (Match-Auftrag)
- WP-Übertrag Ausland mit Zahlung in EUR (Match-Auftrag)
- Zahlung Ausland in EUR ohne WP-Übertrag (Match-Auftrag)¹⁴
- WP-Übertrag Ausland gegen Zahlung in zugelassener Fremdwährung (Match-Auftrag)

Einzelerfassung von WP-Übertrag Inland bzw. Ausland

Es ergeben sich hierdurch Unterschiede bei der Folgeerfassung von erforderlichen Daten bei WP-Überträgen (Folgeerfassung). Es wird zusätzlich nachfolgende Unterteilung vorgenommen:

- Einzelerfassung (Kontrahent im Inland)
- Einzelerfassung (Kontrahent im Ausland)

3.1.1 Einzelerfassung von Wertpapier-Überträgen gegen/mit/frei von Zahlung (Kontrahent im Inland) (WE)

3.1.1.1 Basisdaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Die Einzelerfassung sollte immer dann gewählt werden, wenn WP-Überträge mit umfangreichen zusätzlichen Informationen für den Begünstigten zu erfassen sind.

Nach Eingabe des Funktionscodes „WE“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird die zweiseitige Maske zur Erfassung der Basisdaten zur Verfügung gestellt.

¹⁴ Es handelt sich um einen WP-Übertrag mit der Nominale 0 gegen Zahlung.

(B) Eingabemaske Einzelerfassung

TRAN: KVEE FC: WE SB:			
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS	
PRIMANOTE: _____	AUFTNR: _____	VWA: GS	TR: _
LAST : _____		/	
GUT : _____		/	
WKN : I _____			
NOMINALE : _____	EINHEIT: _____	DISPO-PRIORITAET: _	
GEGENWERT: _____	WRG : EUR	PARTY-HOLD (J/B/C/N) : N	
DCA/REF : _____		EMISS-EINF (J/N) : N	
SET-DAY : 08.01.2020	EX-TRD : _____	BATM/ADEA (J/N) : N	
BOERSENPL: _____	OPT-OUT: _	CLRNG PL :	
SCHLUSSTAG: _____	REFERENZ-NR : _____		
KURS / WRG: _____	AUFTRAGS-REFERENZ: _____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Neu			

Nach Datenfreigabe werden die eingegebenen Daten auf formale Richtigkeit und Plausibilität geprüft und ausgerichtet. Fehler werden angezeigt und müssen korrigiert werden. Erst wenn alle Daten korrekt sind, kann die Verarbeitung mit PF3 bestätigt werden.

Im Unterschied zur Nutzung der Taste PF3 ermöglicht eine Nutzung der Taste PF6, dass die eingegebenen Daten nach der Verarbeitung weiterhin auf dem Bildschirm angezeigt werden und somit wiederverwendet werden können. Anschließend kann dann z. B. durch Überschreiben eines Feldes und erneutes Verarbeiten durch PF3 (oder PF6) ein weiterer Auftrag generiert werden.

(C) Felddesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines WP-Übertrages (Basisdaten) sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	„GS“ = Girosammelverwahrung
LAST	Bank-Nr. des erfassenden Kunden der CBF
GUT	
WKN-KENNUNG	„I“ (änderbar in „W“)
WKN	
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag
EMISS-EINF	„N“ = NEIN
PARTY HOLD	„N“ = NEIN
BATM/ADEA	„N“ = NEIN
SCHLUSSTAG	

Neben den allgemeingültigen Felddescriptions (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Felddescriptions und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Einzelerfassung eines WP-Übertrages folgende Felddescriptions:

PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld PRIMANOTE mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 5000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren inkl. der Aufträge für den Wertebereich.
TR	Für die Übertragung von Teilrechte- in Vollrechte-Konten oder von Vollrechte- in Teilrechte-Konten sind folgende Ausprägungen möglich: <ol style="list-style-type: none"> 1 Teilrechte in Vollrechte 2 Vollrechte in Teilrechte 3 Spitzenkonten in Vollrechte 4 Vollrechte in Spitzenkonten 5 Spitzenkonten in Vollrechte 6 Vollrechte in Spitzenkonten
LAST / GUT	Die in den Feldern LAST / GUT eingegebenen Kontonummern müssen unter den folgenden Kontoarten sein: <ul style="list-style-type: none"> • Kundenkonten • Verfügungskonten Bundesbank • Rückgabekonten Bundesbank und ihren Niederlassungen • Kundenkonten Treuhand/Vorratslager/Rückgabe • Abwicklungskonto für Teilrechte <p>Wird eine BIC eingegeben, so muss diese als T2S Party BIC für ein Konto der o.g. Kontoarten in CBF hinterlegt sein. Die Felder LAST und GUT können identisch sein.</p>
DISPO-PRIORITAET	Folgende Ausprägungen sind möglich: <ol style="list-style-type: none"> 4 Normal (Default – auch bei leerem Feld) 3 Hoch 2 Reserved (nur für CCPs und Handelsplattformen) <p>Siehe auch Kapitel 1.3.3 Dispositionsprioritäten.</p>
GEGENWERT	Das Feld GEGENWERT ist nur bei WP-Überträgen gegen/mit Zahlung und bei WP-Überträgen mit Nominale 0 zu füllen. Kann positiv oder negativ sein.
WRG	Pflichtfeld bei Aufträgen gegen/mit Zahlung. Zugelassene Fremdwährungen (z. B. USD, AUD etc.) sind entsprechend zu erfassen. Bei Gegenwertverrechnung in Schweizer Franken (CHF) und Einbeziehung eines Wertpapiers mit CH-ISIN ist die Beschreibung im CBF Kundenhandbuch (Kapitel 4.4) zu berücksichtigen.
DCA/REF	In diesem Feld kann in Instruktionen gegen/mit Zahlung der DCA bzw. die DCA Referenz eingetragen werden. Der DCA bzw. die DCA Referenz muss in CBF an das entsprechende Last-Konto verlinkt sein. Wird das Feld nicht gefüllt, zieht T2S automatisch den Default DCA für die Abwicklung heran.
SET-DAY	Der SET-DAY kann auch in die Zukunft erfasst werden.
EX-TRD	Die Ex/Cum Kennzeichnung für die Verarbeitung von Kompensationen kann hier eingegeben werden (in Abhängigkeit vom Markt CCPN/XCPN/leer oder SPEX/leer). Für Details siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddescriptions und Formalprüfungen .
BATM/ADEA	Dieses Feld gibt an, ob für eine Instruktion gegen/mit Zahlung die erweiterte Abwicklungsfrist in T2S gelten soll. Für mögliche Eingabewerte siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddescriptions und Formalprüfungen .

BOERSENPL	In dieses Feld kann der Handelsplatz gemäß der ISO 10383 Market Identification Code (MIC) -Liste eingetragen werden.
CLRNG PL	Hier kann ein Abwicklungsplatz, definiert über einen BIC11, eingetragen werden. Der BIC11 wird gegen das aktuelle Swift BIC Directory geprüft.
OPT-OUT	Opt-Out für einen laufenden Market Claim/Reverse Claim Prozess (J/leer).
SCHLUSSTAG	Der Tag, an dem die Endteilnehmer das WP-Geschäft/Börsengeschäft abgeschlossen haben (Trade-date)
AUFTRAGS-REFERENZ	In diesem Feld kann eine eigene Referenz angegeben werden, die als T2S Actor Reference genutzt wird. Die Referenz muss für die Instructing Party über einen Zeitraum von drei Monaten eindeutig sein (dies gilt auch für gelöschte Instruktionen). Wird keine eigene Referenz angegeben, weist CBF dem Auftrag eine eindeutige T2S Actor Reference zu.

(D) Eingabemaske Einzelerfassung-2

Sind die Mussfelder (vgl. Abschnitt C) ausgefüllt, so wechselt PF8 auf die zweite Seite der Eingabemaske:

```

TRAN: KVEE FC: WE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG-2      ERFASSUNGSSTAT

          PRIMANOTE:          AUFTNR:          1      WKN: I DE000710000

UEB-GRUND   : ____          BUCH-TXT-GELD: ____
CA-OPTION NR: ____          CA-OPTION KEY: ____
KADI-LAUF-NR: ____          KADI-TA      : ____
EXT SET-DAY : ____          RUECKUEBERTRAG (J/N) : N
ALREADY MATCHED (J/ ) : _  PARTIAL SETTL.INDICATOR: ____
ISO TRANSACTION CODE : ____ BENE-IND (J/N)      : _
          PARTIAL BUYIN IND (J/ ) : _
BELEGSCHAFT-SP: N          SP-DATUM: ____
KUPONINFO/RECORD-DATE: ____

TEXT:

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

```

(E) Felddesonderheiten

UEB-GRUND	In diesem Feld kann für den Begünstigten die fachliche Zuordnung des Auftrages angegeben werden. Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .
CA-OPTION NR	Optionsnummer einer Kapitalmaßnahme (aus Reporting)
CA-OPTION KEY	Optionsbeschreibung einer Kapitalmaßnahme (aus Reporting)
KADI-LAUF-NR	Interne Verarbeitungsnummer der Kapitalmaßnahme
KADI-TA	Terminart eines Ertragnisses
EXT SET-DAY	Tatsächlicher Settlement-Tag, wenn abweichend von ursprünglichem Settlement-Tag.
RUECKUEBERTRAG	Kennzeichen Rückübertrag
ALREADY MATCHED	In diesem Feld kann angegeben werden, ob die Instruktion bereits gematched an T2S gesendet werden soll. Für Details, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .
PARTIAL SETTL.INDICATOR	In diesem Feld kann angegeben werden, ob für die Instruktion eine Teilabwicklung erlaubt ist. Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .

ISO TRANSACTION CODE	In diesem Feld kann ein ISO Transaction Code gemäß ISO 15022 / 20022 angegeben werden. Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .
BENE-IND (J/N)	In diesem Feld kann angegeben werden, ob sich der Endbegünstigte ändert oder nicht (relevant beim Service eines Portfolio-Transfers). Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .
PARTIAL BUYIN IND	Kennzeichen für einen teilweise durchzuführenden Buy-In. Ausprägung J oder frei.

(F) Abhängigkeitsprüfungen

TR / GUT / WKN	<p>Wenn TR = 01, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeb = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Teilrechte-WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist (von Teilrechte in Vollrechte) liegen. Bei Namensaktien (RS) werden die Vollrechte immer in den freien Meldebestand mit KE-Typ eingebucht.</p> <p>Wenn TR = 02, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeb = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Vollrechte-WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist (von Vollrechte in Teilrechte) liegen. Bei Namensaktien (RS) werden die Vollrechte immer aus dem freien Meldebestand mit KE-Typ ausgebucht.</p> <p>Wenn TR = 03, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeb = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Aktienspitze/Aktienrechte WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist liegen. Bei Namensaktien (RS) werden die Vollrechte immer in den freien Meldebestand ohne KE-Typ eingebucht.</p> <p>Wenn TR = 04, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeb = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Aktienspitze/Aktienrechte WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist liegen. Bei Namensaktien (RS) werden die Vollrechte immer aus dem freien Meldebestand ohne KE-Typ ausgebucht.</p> <p>Wenn TR = 05, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeb = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Aktienspitze/Aktienrechte WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist liegen.</p> <p>Wenn TR = 06, dann wird das GUT automatisch vom System ermittelt (Eingeb = LAST). Darüber hinaus muss die im Feld WKN eingegebene Aktienspitze/Aktienrechte WKN noch in der festgelegten Umwandlungsfrist liegen.</p> <p>Die Zusatzbuchung wird jeweils automatisch erstellt und mit der Freigabetaste in der Informationszeile angezeigt.</p>
TR / ALREADY MATCHED	Wenn das Feld TR gefüllt wurde, muss das Feld ALREADY MATCHED leer sein.
TR / PARTIAL SETTL.INDICATOR	Wenn das Feld TR gefüllt wurde, muss das Feld PARTIAL SETTL.INDICATOR leer oder mit „NPAR“ gefüllt sein.
TR / GEGENWERT	Wenn das Feld TR gefüllt wurde, kann kein Gegenwert eingetragen werden.
NOMINALE / GEGENWERT	Wenn das Feld NOMINALE mit „0“ gefüllt wurde, muss das Feld GEGENWERT gefüllt sein.
NOMINALE / WRG	Wenn das Feld NOMINALE mit „0“ gefüllt wurde, muss das Feld WRG mit „EUR“ gefüllt sein.
GEGENWERT / WRG	Bei Überträgen mit positivem Gegenwert muss das Feld WRG gefüllt sein.

GEGENWERT / WRG	Bei Überträgen mit negativem Gegenwert muss das Feld WRG mit „EUR“ gefüllt sein.
DCA/REF / GEGENWERT / WRG	Wenn das Feld DCA/REF gefüllt wurde, muss das Feld GEGENWERT mit einem Wert größer 0 und das Feld WRG mit „EUR“ gefüllt sein. Eine umgekehrte Abhängigkeit besteht nicht.
EMISS-EINF / WKN / ALREADY MATCHED	Wenn das Feld EMISS-EINF mit „J“ gefüllt wurde und es handelt sich bei der eingegebenen WKN um eine Namensaktie, muss das Feld ALREADY MATCHED leer sein.
EMISS-EINF / WKN / PARTIAL SETTL.INDICATOR	Wenn das Feld EMISS-EINF mit „J“ gefüllt wurde und es handelt sich bei der eingegebenen WKN um eine Namensaktie, muss das Feld PARTIAL SETTL.INDICATOR leer oder mit „NPAR“ gefüllt sein.
WKN / WRG	Wenn es sich bei der eingegebenen WKN um ein TEFRA D Wertpapier handelt, dass sich innerhalb der 40-tägige Frist befindet, muss das Feld WRG leer oder mit „EUR“ gefüllt sein.

3.1.1.2 Folgedaten (Settlement Parties)

(A) Allgemeine Beschreibung

Sollen bzw. müssen hinsichtlich eines WP-Übertrages noch weitere Daten erfasst werden, so ist mit PF8 die Folgeerfassungsmaske aufzurufen.

(B) Folgemaske WP-Übertrag

```

TRAN: KVEE FC: WE SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / SETL.PTY-ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
          PRIMANOTE: 100      AUFTNR:          1      WKN: I DE0001135218

SETTL PARTY - LIEFERER
P1: _____
P2: _____
P3: _____
P4: _____
P5: _____

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: _____
P2: _____
P3: _____
P4: _____
P5: _____

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

```

Nach Datenfreigabe werden die eingegebenen Daten auf formale Richtigkeit und Plausibilität geprüft und ausgerichtet. Fehler werden angezeigt und müssen korrigiert werden. Erst wenn alle Daten korrekt sind, kann die Verarbeitung mit PF3 bestätigt werden.

Im Unterschied zur Nutzung der Taste PF3 ermöglicht eine Nutzung der Taste PF6, dass die eingegebenen Daten nach der Verarbeitung weiterhin auf dem Bildschirm angezeigt werden und somit wiederverwendet werden können. Anschließend kann dann z. B. durch Überschreiben eines Feldes und erneutes Verarbeiten durch PF3 (oder PF6) ein weiterer Auftrag generiert werden.

(C) Feldbesonderheiten

Bei WP-Überträgen gegen/mit Zahlung sowie Zahlungen ohne WP-Übertrag mit einem Kontrahenten im Inland sind die Felder der Folgemaske als Kann Felder definiert. Bei Überträgen frei von Zahlung (FoP) mit einem Kontrahenten im Inland sind diese Felder zum Teil als Mussfelder definiert.

PRIMANOTE / AUFTNR / WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
SETTL PARTY - LIEFERER: P1	Der dem entsprechenden Last-Konto zugeordnete T2S Party BIC und (im Falle eines 7-stelligen Gut-Kontos) SAC ist vorausgefüllt.
SETTL PARTY - LIEFERER: P2 – P5	Bei WP-Überträgen mit Kontrahent im Inland ist die Eingabe optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC, DSS und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (siehe entsprechendes Eingabeschema). Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z. B. Name und Adresse). Die in Textfeldern verwendeten Zeichen müssen dem Zeichensatz (Character Set) X entsprechen. Hinweis: Der ID-Type MSC wird nicht mehr unterstützt, daher muss – falls benötigt – die Eingabe mit ID-Type KTO oder ACC und Feldinhalt „MSC-NONREF“ vorgenommen werden.
SETTL PARTY - EMPFAENGER: P1	Bei WP-Überträgen mit Kontrahent im Inland ist der dem entsprechenden Gut-Konto zugeordnete T2S Party BIC und (im Falle eines 7-stelligen Gut-Kontos) SAC vorausgefüllt.
SETTL PARTY - EMPFAENGER: P2 – P5	Bei WP-Überträgen gegen/mit Zahlung sowie Zahlungen ohne WP-Übertrag mit Kontrahent im Inland ist die Eingabe optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC, DSS und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (siehe entsprechendes Eingabeschema). Bei WP-Überträgen frei von Zahlung mit Kontrahent im Inland muss die Teilnehmerinformation des endbegünstigten Kunden (KTO, ACC, BIC, DSS oder BLZ) angegeben werden. Bitte beachten Sie, dass die automatische Erkennung von Retailgeschäften für das Aktiv- und Passivmatching anhand der BLZ lediglich in P2 unterstützt wird. Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z.B. Name und Adresse). Die in Textfeldern verwendeten Zeichen müssen dem Zeichensatz (Character Set) X entsprechen. Hinweis: Der ID-Type MSC wird nicht mehr unterstützt, daher muss – falls benötigt – die Eingabe mit ID-Type KTO oder ACC und Feldinhalt „MSC-NONREF“ vorgenommen werden.

Eingabeschema KVEE/WE: SETTL PARTY – LIEFERER (im Inland)					
	5 Level	4 Level	3 Level	2 Level	1 Level
P1 SAC	Last-Konto ^a (DEAG)				
P2	Auftraggebender Intermediär 1 (DEI1)	Auftraggebender Intermediär 1 (DEI1)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)	
P3	Auftraggebender Intermediär 2 (DEI2)	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)		
P4	Auftraggebende Depotbank (DECU)	Original-Auftraggeber (SELL)			
P5	Original-Auftraggeber (SELL)				

a. SAC wird aus dem Last-Konto in der Grundmaske abgeleitet, falls dieses 7-stellig eingegeben wurde.

Eingabeschema KVEE/WE: SETTL PARTY – EMPFAENGER (im Inland)					
	5 Level	4 Level	3 Level	2 Level	1 Level
P1 SAC	Gut-Konto ^a (REAG)				
P2	Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Begünstigter Intermediär 1 (REI1)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)	
P3	Begünstigter Intermediär 2 (REI2)	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)		
P4	Begünstigte Depotbank (RECU)	Endbegünstigter (BUYR)			
P5	Endbegünstigter (BUYR)				

a. SAC wird aus dem Gut-Konto in der Grundmaske abgeleitet, falls dieses 7-stellig eingegeben wurde.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

P2 – P5	Wird das Präfix mit KTO, ACC, BLZ oder BIC gefüllt, so erwartet das System die Eingabe einer zugehörigen Schlüsselnummer.
P3 – P5	Wird eines dieser Felder gefüllt, so darf das darüberliegende Feld nicht leer sein.

3.1.1.3 Folgedaten (Linkages)

(A) Allgemeine Beschreibung

Soll eine Instruktion in T2S an andere OTC-Instruktion oder ein nicht-CCP-Börsengeschäfte in GS-Wertpapieren verlinkt werden, so ist mit PF8 die weitere Folgeerfassungsmaske aufzurufen.

Für neue Instruktionen kann eine Verlinkung auf zwei Arten erfolgen:

- Über eine Pool-Referenz: Eine Pool-Referenz ist eine gemeinsame Referenz, mit der eine Menge an Instruktionen (max. 999) zur zeitgleichen Abwicklung (Alles-oder-nichts Prinzip) miteinander verlinkt werden kann. Neben der Pool-Referenz und dem Pool-Besitzer muss die Gesamtzahl der im Pool enthaltenen Instruktionen (Pool-Zähler) festgelegt werden sowie eine Sequenz-Nummer für jede Instruktion angegeben werden. Alle Instruktionen im Pool werden zur gemeinsamen Abwicklung herangezogen, sobald die Anzahl der Instruktionen mit der gleichen Pool-Referenz mit dem entsprechenden Pool-Zähler übereinstimmt. Werden eine oder mehrere im Pool enthaltene Instruktionen storniert oder von T2S abgelehnt, so kann der Pool nicht abgewickelt werden. Die Änderung des Pools oder das nachträgliche Austauschen stornierter oder abgelehnter Instruktionen ist erforderlich.
- Über die Verlinkungstypen „AFTE“, „BEFO“, „WITH“ und „INFO“, siehe Feld „POSN“ in Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen](#).

Eine Kombination aus beiden Arten der Verlinkung ist möglich, d.h. ein Pool kann mit Einzelinstruktionen und Instruktionen, die selbst Teil eines Pools sind, verlinkt werden und umgekehrt.

Hinweis: Geschäfte gegen Zahlung in Fremdwährungen sowie Geschäfte mit Kontrahenten in einem T2S Out-CSD dürfen grundsätzlich mit keinen anderen Geschäften verlinkt werden, da dies zu Verarbeitungsproblemen führen kann. CBF behält sich in solchen Fällen einen manuellen Eingriff vor, um eine ordnungsgemäße Verarbeitung dieser Geschäfte zu gewährleisten. Für TEFRA D Wertpapiere darf bei Nutzung des strikten Verfahrens innerhalb der 40-tägigen Frist keine Verlinkung zwischen einer Empfangs- und Lieferinstruktion des gleichen Wertpapiers zur gemeinsamen Abwicklung vorgenommen werden, da eine Abwicklung sonst nicht möglich ist.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

TR / POOL REF	Wenn das Feld TR (Basisdaten) gefüllt wurde, muss das Feld POOL REF leer sein.
TR / SEQUENZ-NR	Wenn das Feld TR (Basisdaten) gefüllt wurde, muss das Feld SEQUENZ-NR leer sein.
TR / POOL ZAEHLER	Wenn das Feld TR (Basisdaten) gefüllt wurde, muss das Feld POOL ZAEHLER leer sein.
TR / POOL OWNER BIC	Wenn das Feld TR (Basisdaten) gefüllt wurde, muss das Feld POOL OWNER BIC leer sein.
TR / POSN	Wenn das Feld TR (Basisdaten) gefüllt wurde, muss das Feld POSN leer sein.
TR / LINK-REF	Wenn das Feld TR (Basisdaten) gefüllt wurde, muss das Feld LINK-REF leer sein.
TR / LINK OWNER BIC	Wenn das Feld TR (Basisdaten) gefüllt wurde, muss das Feld LINK OWNER BIC leer sein.
POOL REF / SEQUENZ-NR / POOL ZAEHLER / POOL OWNER BIC	Wenn eines der Felder gefüllt wurde, müssen alle übrigen Felder ebenfalls gefüllt sein.
POSN / LINK-REF / LINK OWNER BIC	Wenn eines der Felder gefüllt wurde, müssen alle übrigen Felder in der gleichen Zeile ebenfalls gefüllt sein.

3.1.2 Einzelerfassung von Wertpapier-Überträgen gegen/mit/frei von Zahlung (Kontrahent im Ausland) (WE)

3.1.2.1 Basisdaten

(A) Allgemeine Beschreibung

WP-Überträge an ausländische Zentralverwahrer oder Clearinghäuser müssen über die Einzelerfassung eingegeben werden. Eine detaillierte und nach einzelnen Ländern aufgeschlüsselte Erläuterung der benötigten Eingaben in KVEE/WE findet sich auf der Clearstream Website im jeweiligen CASCADE Link Guide unter [Products and Services / Market coverage](#).

Nach Eingabe des Funktionscodes „WE“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird die zweiseitige Maske zur Erfassung der Basisdaten zur Verfügung gestellt.

(B) Eingabemaske WP-Übertrag Einzelerfassung Ausland

TRAN: KVEE FC: WE SB:			
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS	
PRIMANOTE: _____	AUFTNR: _____	VWA: GS	TR: _
LAST : _____			/
GUT : _____			/
WKN : I _____			
NOMINALE : _____	EINHEIT: _____	DISPO-PRIORITAET: _____	
GEGENWERT: _____	WRG : EUR	PARTY-HOLD (J/B/C/N) : N	
DCA/REF : _____		EMISS-EINF (J/N) : N	
SET-DAY : 08.01.2020	EX-TRD : _____	BATM/ADEA (J/N) : N	
BOERSENPL: _____	OPT-OUT: _____	CLRNG PL :	
SCHLUSSTAG: _____	REFERENZ-NR : _____		
KURS / WRG: _____	AUFTRAGS-REFERENZ: _____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Neu			

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines WP-Übertrages (Basisdaten) sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	„GS“ = Girosammelverwahrung
LAST	Bank-Nr. des erfassenden Kunden der CBF
GUT	
WKN-KENNUNG	„I“ (änderbar in „W“)
WKN	
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag
EMISS-EINF	„N“ = NEIN
PARTY HOLD	„N“ = NEIN
BATM/ADEA	„N“ = NEIN
SCHLUSSTAG	

Neben den allgemeingültigen Felddescriptions (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Felddescriptions und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Einzelerfassung eines WP-Übertrages mit Kontrahent im Ausland folgende Feldbesonderheiten:

PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld PRIMANOTE mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 5000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren inkl. der Aufträge für den Wertebereich.
LAST / GUT	<p>Kontrahent in einem T2S In-CSD: Die im Feld LAST eingegebene Kontonummer muss zur Kontengruppe 01 (Kundendepot nur H) gehören. Die im Feld GUT eingegebene Kontonummer muss ein Counterparty CSD Account sein. Die Eingabe eines Mirror-Kontos ist nicht erlaubt. Die Eingabe eines Omnibus-Kontos im Feld GUT führt zu einem WP-Übertrag zwischen den beiden CBF-Konten, nicht zu einem Crossborder-Geschäft.</p> <p>Kontrahent in einem T2S Out-CSD: Die im Feld LAST / GUT eingegebene Kontonummer muss auf der einen Seite zur Kontengruppe 01 (Kundendepot nur H) gehören und auf der anderen Seite ein Omnibus oder Mirror-Konto sein.</p> <p>Wird eine BIC eingegeben, so muss diese als T2S Party BIC mit einem Konto der o.g. Kontoarten in CBF verknüpft sein.</p> <p>Nähere Informationen dazu finden sich im jeweiligen CASCADE Link Guide.</p>
DISPO-PRIORITAET	<p>Folgende Ausprägungen sind möglich:</p> <ul style="list-style-type: none"> 4 Normal (Default – auch bei leerem Feld) 3 Hoch 2 Reserved (nur für CCPs und Handelsplattformen) <p>Siehe auch Kapitel 1.3.3 Dispositionsprioritäten.</p>
GEGENWERT	Das Feld GEGENWERT ist nur bei WP-Überträgen gegen/mit Zahlung und bei WP-Überträgen mit Nominale 0 zu füllen. Kann positiv oder negativ sein.

WRG	Pflichtfeld bei Aufträgen gegen/mit Zahlung. Hier wird das entsprechende Währungskürzel eingetragen. Bei Gegenwertverrechnung in Schweizer Franken (CHF) und Einbeziehung eines Wertpapiers mit CH-ISIN ist die Beschreibung im CBF Kundenhandbuch (Kapitel 4.4) zu berücksichtigen.
DCA/REF	In diesem Feld kann in Instruktionen gegen/mit Zahlung der DCA bzw. die DCA Referenz eingetragen werden. Der DCA bzw. die DCA Referenz muss in CBF an das entsprechende Last-/Gut-Konto verlinkt sein. Wird das Feld nicht gefüllt, zieht T2S automatisch den Default DCA für die Abwicklung heran.
SET-DAY	Der SET-DAY kann auch in die Zukunft erfasst werden.
EX-TRD	Die Ex/Cum Kennzeichnung für die Verarbeitung von Kompensationen kann hier eingegeben werden (in Abhängigkeit vom Markt CCPN/XCPN/leer oder SPEX/leer). Für Details siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
BATM/ADEA	Dieses Feld gibt an, ob für eine Instruktion gegen/mit Zahlung die erweiterte Abwicklungsfrist in T2S gelten soll. Für mögliche Eingabewerte siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
BOERSENPL	In dieses Feld kann der Handelsplatz gemäß der ISO 10383 Market Identification Code (MIC) -Liste eingetragen werden.
CLRNG PL	Hier kann ein Abwicklungsplatz, definiert über einen BIC11, eingetragen werden. Der BIC11 wird gegen das aktuelle Swift BIC Directory geprüft.
OPT-OUT	Opt-Out für einen laufenden Market Claim/Reverse Claim Prozess (J/leer).
REFERENZ-NR	Hier kann die zwischen den Kontrahenten vereinbarte Auftragsbezugsnummer (Common Trade Reference) eingetragen werden. Wird im Falle eines Kontrahenten in einem T2S In-CSD als optionales Matchkriterium in T2S genutzt.
AUFTRAGS-REFERENZ	In diesem Feld kann eine eigene Referenz angegeben werden, die als T2S Actor Reference genutzt wird. Die Referenz muss für die Instructing Party über einen Zeitraum von drei Monaten eindeutig sein (dies gilt auch für gelöschte Instruktionen). Wird keine eigene Referenz angegeben, weist CBF dem Auftrag eine eindeutige T2S Actor Reference zu.

(D) Eingabemaske Einzelerfassung-2

Sind die Mussfelder (vgl. Abschnitt C) ausgefüllt, so wechselt PF8 auf die zweite Seite der Eingabemaske:

TRAN: KVEE FC: WE SB:		
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG-2	ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE:	AUFTNR: 3215	WKN: I DE0005151005
UEB-GRUND : ____		BUCH-TXT-GELD: ____
EXT SET-DAY : _____	RUECKUEBERTRAG (J/N) : N	
ALREADY MATCHED (J/) : _	PARTIAL SETTL.INDICATOR: ____	
ISO TRANSACTION CODE : ____	BENE-IND (J/N) : _	
BELEGSCHAFT-SP: N	SP-DATUM: _____	
KUPONINFO/RECORD-DATE: _____		
TEXT: _____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Neu PF7:Zurück PF8:Vor		

(E) Felddesonderheiten

UEB-GRUND	In diesem Feld kann für den Begünstigten die fachliche Zuordnung des Auftrages angegeben werden. Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .
EX SET DAY	Tatsächlicher Settlement-Tag, wenn abweichend von ursprünglichem Settlement-Tag
ALREADY MATCHED	In diesem Feld kann angegeben werden, ob die Instruktion bereits gematched an T2S gesendet werden soll. Für Details, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .
PARTIAL SETTL INDICATOR	In diesem Feld kann angegeben werden, ob für die Instruktion eine Teilabwicklung erlaubt ist. Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .
ISO TRANSACTION CODE	In diesem Feld kann ein ISO Transaction Code gemäß ISO 15022 / 20022 angegeben werden. Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .
BENE-IND (J/N)	In diesem Feld kann angegeben werden, ob sich der Endbegünstigte ändert oder nicht (relevant beim Service eines Portfolio-Transfers). Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .

3.1.2.1.1 (F) Abhängigkeitsprüfungen

ALREADY MATCHED	<p>Wenn das Feld ALREADY MATCHED mit "J" gefüllt wurde,</p> <ul style="list-style-type: none"> • muss der mit CBF verbundene T2S In-CSD des Kontrahentenkontos diesen Service ebenfalls anbieten. • müssen Im T2S Rechtemanagement Vollmachten für den Eingebener („Initiator“) und den Empfänger („Receiver“) der „Already matched“-Instruktionen vom zuständigen T2S In-CSD hinterlegt worden sein. • unterliegen die Instruktionen mit dem Kennzeichen already matched den T2S-Validierungsregeln beider betroffener T2S In-CSDs. Scheitert die Validierung auf T2S, unterliegt die Instruktion einem „CSD Party Hold“ (CVAL) und kann nicht mehr abgewickelt, sondern nur noch gelöscht werden.
NOMINALE / GEGENWERT NOMINALE / WRG	<p>Wenn das Feld NOMINALE mit „0“ gefüllt wurde, muss das Feld GEGENWERT gefüllt sein.</p> <p>Wenn das Feld NOMINALE mit „0“ gefüllt wurde, muss das Feld WRG mit „EUR“ gefüllt sein.</p>
GEGENWERT / WRG	Bei Überträgen mit positivem Gegenwert muss das Feld WRG gefüllt sein.
GEGENWERT / WRG	Bei Überträgen mit negativem Gegenwert muss das Feld WRG mit „EUR“ gefüllt sein.
GUT / WKN	Wenn im Feld GUT ein Counterparty CSD Account oder der BIC eines Counterparty CSD Accounts eingegeben wurde, muss das im Feld WKN eingegebene Wertpapier zur Abwicklung in T2S zugelassen sein.

3.1.2.2 Folgedaten (Settlement Parties)

(A) Allgemeine Beschreibung

Bei der WP-Übertragung mit Kontrahenten im Ausland müssen zusätzliche Daten in einer Folgemaske eingegeben werden. Eine detaillierte Beschreibung findet sich im jeweiligen CASCADE Link Guide.

(B) Folgemaske WP-Übertrag Ausland

TRAN: KVEE FC: WE SB:			
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / SETL.PTY-ERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS	
PRIMANOTE:	AUFTRN:	13	WKN: I DE000A0Z17A1
SETTL PARTY - LIEFERER			
P1:	_____		
P2:	_____		
P3:	_____		
P4:	_____		
P5:	_____		
SETTL PARTY - EMPFAENGER			
P1:	_____		
P2:	_____		
P3:	_____		
P4:	_____		
P5:	_____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Neu PF7:Zurück			

(C) Felddesonderheiten

Neben den allgemeingültigen Felddesonderheiten (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Felddesonderheiten und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Einzelerfassung eines WP-Übertrages folgende Felddesonderheiten:

PRIMANOTE / AUFTR / WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
SETTL PARTY - LIEFERER: P1-P5	<p>Kontrahent in einem T2S In-CSD / Kontrahent in einem T2S Out-CSD auf der Gut-Seite:</p> <p>In P1 ist der dem entsprechenden Gut-Konto zugeordnete T2S Party BIC und (im Falle eines 7-stelligen Gut-Kontos) SAC vorausgefüllt. Die Eingabe von P2 – P5 ist optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC, DSS und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (es gilt das in Kapitel 0 beschriebene Eingabeschema). Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z.B. Name und Adresse).</p> <p>Kontrahent in einem T2S Out-CSD auf der Last-Seite:</p> <p>Die Eingabe ist gemäß den Angaben im jeweiligen CASCADE Link Guide erforderlich.</p>

SETTL PARTY - EMPPFAENGER: P1 – P5	<p>Kontrahent in einem T2S In-CSD / Kontrahent in einem T2S Out-CSD auf der Gut-Seite:</p> <p>Die Eingabe ist gemäß den Angaben im jeweiligen CASCADE Link Guide erforderlich.</p> <p>Kontrahent in einem T2S Out-CSD auf der Last-Seite:</p> <p>In P1 ist der dem entsprechenden Gut-Konto zugeordnete T2S Party BIC und (im Falle eines 7-stelligen Gut-Kontos) SAC vorausgefüllt. Die Eingabe von P2 – P5 ist optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC, DSS und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (es gilt das in Kapitel 3 unter (c) Feldbesonderheiten beschriebene Eingabeschema). Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z. B. Name und Adresse). Die in Textfeldern verwendeten Zeichen müssen dem Zeichensatz (Character Set) X entsprechen.</p>
---------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(D) Abhängigkeitsprüfungen

P2 – P5	Wird das Präfix mit KTO, ACC, BLZ oder BIC gefüllt, so erwartet das System die Eingabe einer zugehörigen Schlüsselnummer.
P3 – P5	Wird eines dieser Felder gefüllt, so darf das darüberliegende Feld nicht leer sein.

3.1.2.3 Folgedaten (Linkages)

Siehe Kapitel [3.1.1.3](#).

3.1.3 Mehrfacherfassung von Wertpapier-Überträgen gegen/mit/frei von Zahlung (Kontrahent im Inland) (WM)

(A) Allgemeine Beschreibung

Bei der Mehrfacherfassung können mehrere WP-Überträge gegen/mit/frei von Zahlung sowie Zahlungen ohne WP-Übertrag auf einem Bildschirm eingegeben werden. Hierbei werden in jeweils einer Zeile nur die Standard-Angaben zu einem Auftrag erfasst.

Im Rahmen der Mehrfacherfassung spricht man von der sachlichen Sammelerfassung, wenn mehrere Aufträge die gleiche Wertpapierkennung aufweisen. Demgegenüber liegt eine persönliche Sammelerfassung vor, wenn sich mehrere Aufträge in dem Feld Gutschrift-Konto gleichen. Zur Vereinfachung der Erfassung können diese gleichen Feldinhalte aus der ersten Kopfzeile der Mehrfacherfassungsmaske in die einzelnen Eingabereihen kopiert werden.

Über die Mehrfacherfassung können nur WP-Überträge mit oder ohne Gegenwert an deutsche Kunden der CBF eingegeben werden. WP-Überträge an ausländische Zentralverwahrer oder Clearinghäuser müssen über die Einzelerfassung eingegeben werden.

Bei der Mehrfacherfassung sind die in den Zeilen EMPF-P2 oder UEB-G eingegebenen Zusatzinformationen für alle auf dieser Maske erfassten Aufträge gültig.

Es gibt keine Folgemasken.

Mit dem Aufruf des Funktionscodes „WM“ wird eine vorbelegte Eingabemaske zur Verfügung gestellt.

Bei der Erfassung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	Bedeutung
AUFTNR	Auftragsnummer
LAST-KTO	Lastschrift-Konto
GUT-KTO	Gutschrift-Konto
WKN	Wertpapierkennnummer/ISIN
SET-DAY	Settlement Tag (Intended settlement day)
SCHLUSSTAG	Schlussstag/Handelstag
UEB-G	Übertragungsgrund
EMPF-P2	Bei WP-Überträgen frei von Zahlung muss die Teilnehmerinformation des endbegünstigten Kunden (KTO, ACC, BIC, DSS oder BLZ) eingetragen werden. Bei WP-Überträgen gegen/mit Zahlung ist keine Eingabe erforderlich. Falls zusätzliche Ebenen erforderlich sind, muss die Einzelerfassung genutzt werden.
NOMINALE	Nominalbetrag des Auftrags

Nach Datenfreigabe werden die eingegebenen Daten auf formale Richtigkeit und Plausibilität geprüft und ausgerichtet. Fehler werden angezeigt und müssen korrigiert werden. Erst wenn alle Daten korrekt sind, erscheint in Zeile 24 die Aufforderung, die Verarbeitung mit PF3 zu bestätigen. Jede Seite muss einzeln mit PF3 verarbeitet werden.

```

TRAN: KVEE FC: WM SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / MEHRFACHERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS

PN: ____ LAST-KTO : 7930 ____ GUT-KTO: ____ WKN: I DE0005752000 UEB-G: ____
EMISS-EINF(J/N): N SCHLUSSTAG : _____ SET-DAY: 20.11.2014 OPT-OUT: _
REFERENZ-NR: _____ PARTY-HOLD (J/B/C/N): N
EMPF-P1: _____ WRG : EUR
EMPF-P2: _____
TEXT : _____

      AUFTNR LAST-KTO GUT-KTO WKN              NOMINALE              GEGENWERT
      1234 7930 000 6789 000 DE0005752000          100                234,67
      20 7930 000 5678 000 DE0005752000           23
      23 7930 000 4567 000 DE0005752000           12

PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch

```

Die nach der Verarbeitung mit PF3 ausgegebene Mehrfacherfassungsmaske übernimmt die Vorbelegungen aus der Ersteinstiegsmaske.

Will man die Mehrfacherfassung beenden, kehrt man mit PF4 zum Menü Erfassung zurück.

3.1.4 Erfassung von Match-Instruktionen (MI)

Bei einem Wertpapierübertrag gegen/mit/frei von Zahlung sowie einer Zahlung ohne Wertpapierübertrag zwischen zwei Teilnehmern müssen aufgrund eines erforderlichen Matchings (vgl. Kapitel 3.5 [Matching](#)) in der Regel beide Seiten (Lieferer/Verkäufer und Empfänger/Käufer der Wertpapiere) Eingaben in das System CASCADE vornehmen¹⁵.

Die Match-Pflicht von Match-Aufträgen hängt einerseits ab von der Match-Pflicht des im Auftrag angegebenen Last- und Gut-Kontos und andererseits davon, ob es sich bei dem Wertpapierübertrag um eine Lieferung innerhalb eines Institutes (gleicher Kontostamm = vierstellige Kontonummer) oder einem Wertpapierübertrag zwischen zwei unterschiedlichen Instituten (unterschiedliche Kontostämme) handelt.

- Handelt es sich um einen Wertpapierübertrag frei von Zahlung innerhalb desselben Institutes (gleicher CBF-Kontostamm), muss dieser nur dann gematcht werden, wenn beide daran beteiligten Konten matchpflichtig sind.
- Handelt es sich um einen Wertpapierübertrag frei von Zahlung zwischen zwei verschiedenen Instituten (unterschiedliche CBF-Kontostämme), muss dieser dann gematcht werden, wenn das darin angegebene Gut-Konto (Empfängerkonto der Wertpapiere) matchpflichtig ist.

¹⁵ Theoretisch kann eine Match-Instruktion auch außerhalb von CASCADE direkt in T2S bzw. in einem ausländischen CSD eingegeben werden.

3.1.4.1 Matchfreie CBF Konten

Für bestimmte CASCADE Kontogruppen ist die Matchpflicht von Wertpapierüberträge ohne Gegenwert grundsätzlich ausgeschlossen; das sind hauptsächlich Überträge von Sicherheiten z. B. Eurex Clearing AG oder Treuhandsperrkonten. Dasselbe gilt für die CBF-Konten 7399 000 und 7299 000 (beide lautend auf „Clearstream Banking“) bei der Emissionseinführung von CASCADE-RS Gattungen.

3.1.4.2 Matchpflichtige CBF-Konten

Die nachfolgende Tabelle gibt einen allgemeinen und beispielhaften Überblick über matchpflichtige CBF-Konten.

Kontenbezeichnung	Kontonummer ^a
Kundenkonto	XXXXa 000, XXXX 901-906, XXXX 061-062 (u. a.)
Kundenkonto / Makler	XXXX 000
Kundenkonto Vorratslager	XXXX 907
Nicht verkaufte Werte	XXXX 410
Equity CCP	7525 000 und 8501 000 und weitere Konten z. B. zur Abwicklung von Buy-In-Ergebnissen
Edelmetalle (Deutsche Börse Commodities GmbH)	7332 000
Eigenbestand Streifband	XXXX 097
Fremdbestand Streifband	XXXX 096
TEFRA D Leadmanager (nur Überträge an Dritte)	XXXX 670

- a. CBF nutzt zur Bestimmung der Matchpflicht eines CBF-Kontos einen CBF-internen technischen Schlüssel. Da dieser nicht eindeutig den verschiedenen CBF-Kontonummern zugeordnet werden kann, sind in der Tabelle nur exemplarisch die häufigsten Ausprägungen genannt. Der Platzhalter „XXXX“ entspricht dem vierstelligen CBF-Kontostamm.

Für Wertpapierüberträge gilt die Match-Pflicht auch für CBF-Konten zwischen Zentralen und deren Niederlassungen oder CBF-Kunden, die mehrere CBF-Kontostämme unterhalten, da hier verschiedene rechtliche Entitäten involviert sein können.

3.1.4.3 Basisdaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Während die Erfassung eines WP-Übertrages von der Verkäuferseite vorzunehmen ist, muss die Match-Instruktion von der Käuferseite eingegeben werden.¹⁶

¹⁶ Eine Ausnahme stellen Geschäfte mit Kontrahenten in T2S Out-CSDs dar, bei denen ein WP-Übertrag unter Umständen auch von der Käuferseite vorgenommen werden kann.

(B) Eingabemaske Match-Instruktion

TRAN: KVEE FC: MI SB:		
AUFTRAGSABWICKLUNG	MATCH-INSTRUKTION / ERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: _____	AUFTNR: _____	VWA: GS
LAST : _____		/
GUT : _____		/
WKN : I _____		
NOMINALE : _____	EINHEIT: _____	DISPO-PRIORITAET: _____
GEGENWERT: _____	WRG : EUR	PARTY-HOLD (J/B/C/N) : N
DCA/REF : _____		EMISS-EINF (J/N) : N
SET-DAY : 08.01.2020	EX-TRD : _____	BATM/ADEA (J/N) : N
BOERSENPL: _____	OPT-OUT: _____	CLRNG PL :
SCHLUSSTAG: _____	REFERENZ-NR : _____	
KURS / WRG: _____	AUFTRAGS-REFERENZ: _____	
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF6:Verarb+Neu		

(C) Felddesonderheiten

Bei der Erfassung einer Match-Instruktion sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	„GS“ = Girosammelverwahrung
LAST	
GUT	Bank-Nr. des erfassenden Kunden der CBF
WKN-KENNUNG	„I“ (änderbar in „W“)
WKN	
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag
EMISS-EINF	„N“ = NEIN
PARTY HOLD	„N“ = NEIN
BATM/ADEA	„N“ = NEIN

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen) gelten bei der Erfassung einer Match-Instruktion folgende Feldbesonderheiten:

PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld PRIMANOTE mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 5000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren inkl. der Aufträge für den Wertebereich.
LAST / GUT	<p>Kontrahent in CBF:</p> <p>Die in den Feldern LAST / GUT eingegebenen Kontonummern müssen zur Kontengruppe 01 (Kundendepot nur H) gehören.</p> <p>Kontrahent in einem T2S In-CSD:</p> <p>Die im Feld GUT eingegebene Kontonummer muss zur Kontengruppe 01 (Kundendepot nur H) gehören. Die im Feld LAST eingegebene Kontonummer muss ein Counterparty CSD Account sein. Die Eingabe eines Mirror-Kontos ist nicht erlaubt. Die Eingabe eines Omnibus-Kontos im Feld LAST führt zu einer Match-Instruktion für einen WP-Übertrag zwischen den beiden CBF-Konten, nicht für ein Crossborder-Geschäft.</p> <p>Kontrahent in einem T2S Out-CSD:</p> <p>Die im Feld LAST / GUT eingegebene Kontonummer muss auf der einen Seite zur Kontengruppe 01 (Kundendepot nur H) gehören und auf der anderen Seite ein Omnibus oder Mirror-Konto sein.</p> <p>Nähere Informationen zu den erforderlichen Eingaben in Match-Instruktionen mit einem Kontrahenten in einem T2S In- oder Out-CSD finden sich im jeweiligen CASCADE Link Guide.</p> <p>Wird eine BIC eingegeben, so muss diese als T2S Party BIC mit einem Konto der o.g. Kontengruppe in CBF verknüpft sein.</p>
DISPO-PRIORITAET	<p>Folgende Ausprägungen sind möglich:</p> <p>4 Normal (Default – auch bei leerem Feld)</p> <p>3 Hoch</p> <p>2 Reserved (nur für CCPs und Handelsplattformen)</p> <p>Siehe auch Kapitel 1.3.3 Dispositionsprioritäten.</p>
GEGENWERT	Das Feld GEGENWERT ist nur bei WP-Überträgen gegen/mit Zahlung und bei WP-Überträgen mit Nominale 0 zu füllen.
WRG	Pflichtfeld bei Aufträgen gegen/mit Zahlung. Zugelassene Fremdwährungen (z. B. USD, AUD etc.) sind entsprechend zu erfassen. Bei Gegenwertverrechnung in Schweizer Franken (CHF) und Einbeziehung eines Wertpapiere mit CH-ISIN ist die Beschreibung im CBF Kundenhandbuch (Kapitel 4.4) zu berücksichtigen.
DCA/REF	In diesem Feld kann in Instruktionen gegen/mit Zahlung der DCA bzw. die DCA Referenz eingetragen werden. Der DCA bzw. die DCA Referenz muss in CBF an das entsprechende Gut-Konto verlinkt sein. Wird das Feld nicht gefüllt, zieht T2S automatisch den Default DCA für die Abwicklung heran.
SET-DAY	Der SET-DAY kann auch in die Zukunft erfasst werden (außer bei Gegenwert EUR).
EX-TRD	Die Ex/Cum Kennzeichnung für die Verarbeitung von Kompensationen kann hier eingegeben werden (in Abhängigkeit vom Markt CCPN/XCPN/leer oder SPEX/leer). Für Details siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
BATM/ADEA	Dieses Feld gibt an, ob für eine Instruktion gegen/mit Zahlung die erweiterte Abwicklungsfrist in T2S gelten soll. Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
BOERSENPL	In dieses Feld kann der Handelsplatz gemäß der ISO 10383 Market Identification Code (MIC) -Liste eingetragen werden.
CLRNG PL	Hier kann ein Abwicklungsplatz, definiert über einen BIC11, eingetragen werden. Der BIC11 wird gegen das aktuelle Swift BIC Directory geprüft.
OPT-OUT	Opt-Out für einen laufenden Market Claim/Reverse Claim Prozess (J/leer).

SCHLUSSTAG	Der Tag, an dem die Endteilnehmer das WP-Geschäft/Börsengeschäft abgeschlossen haben (Trade Date)
AUFTRAGS-REFERENZ	In diesem Feld kann eine eigene Referenz angegeben werden, die als T2S Actor Reference genutzt wird. Die Referenz muss für die Instructing Party über einen Zeitraum von drei Monaten eindeutig sein (dies gilt auch für gelöschte Instruktionen). Wird keine eigene Referenz angegeben, weist CBF dem Auftrag eine eindeutige T2S Actor Reference zu.

(D) Eingabemaske Einzelerfassung-2

Sind die Mussfelder (vgl. Abschnitt C) ausgefüllt, so wechselt PF8 auf die zweite Seite der Eingabemaske.

```

TRAN: KVEE FC: MI SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG   MATCH-INSTRUKTION / ERFASSUNG-2           ERFASSUNGSSTATUS
                        PRIMANOTE:           AUFTNR:           3215           WKN: I DE0005151005
UEB-GRUND           : _____           BUCH-TXT-GELD: _____

ALREADY MATCHED (J/ ) : _           PARTIAL SETTL.INDICATOR: _____
ISO TRANSACTION CODE : _____           BENE-IND (J/N)           : _

TEXT: _____

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

```

(E) Feldbesonderheiten

PRIMANOTE / AUFR / WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
ALREADY MATCHED	In diesem Feld kann angegeben werden, ob die Instruktion bereits gematched an T2S gesendet werden soll. Für Details, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen . Dieses Feld ist zurzeit noch nicht nutzbar.
PARTIAL SETTL.INDICATOR	In diesem Feld kann angegeben werden, ob für die Instruktion eine Teilabwicklung erlaubt ist. Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .
ISO TRANSACTION CODE	In diesem Feld kann ein ISO Transaction Code gemäß ISO 15022 / 20022 angegeben werden. Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .
BENE-IND (J/N)	In diesem Feld kann angegeben werden, ob sich der Endbegünstigte ändert oder nicht (relevant beim Service eines Portfolio-Transfers). Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen .

(F) Abhängigkeitsprüfungen

NOMINALE / GEGENWERT	Wenn das Feld NOMINALE mit „0“ gefüllt wurde, muss das Feld GEGENWERT gefüllt sein.
GEGENWERT / WRG	Bei Überträgen mit Gegenwert muss das Feld WRG gefüllt sein.
DCA/REF / GEGENWERT / WRG	Wenn das Feld DCA/REF gefüllt wurde, muss das Feld GEGENWERT mit einem Wert größer 0 und das Feld WRG mit „EUR“ gefüllt sein. Eine umgekehrte Abhängigkeit besteht nicht.
EMISS-EINF / WKN / ALREADY MATCHED	Wenn das Feld EMISS-EINF mit „J“ gefüllt wurde und es handelt sich bei der eingegebenen WKN um eine Namensaktie, muss das Feld ALREADY MATCHED leer sein.
EMISS-EINF / WKN / PARTIAL SETTL.INDICATOR	Wenn das Feld EMISS-EINF mit „J“ gefüllt wurde und es handelt sich bei der eingegebenen WKN um eine Namensaktie, muss das Feld PARTIAL SETTL.INDICATOR leer oder mit „NPAR“ gefüllt sein.

3.1.4.4 Folgedaten (Settlement Parties)

(A) Allgemeine Beschreibung

Sollen hinsichtlich einer Match-Instruktion noch weitere Daten erfasst werden, so ist mit PF8 die Folgerfassungsmaske aufzurufen.

(B) Folgemaske WP-Übertrag

```
TRAN: KVEE FC: MI SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG  MATCH-INSTRUKTION / SETL.PTY-ERFASSUNG  ERFASSUNGSSTATUS
                    PRIMANOTE: 123      AUFTNR:      354      WKN: I DE000A0Z17A1

SETTL PARTY - LIEFERER
P1: _____
P2: _____
P3: _____
P4: _____
P5: _____

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: _____
P2: _____
P3: _____
P4: _____
P5: _____

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF6:Verarb+Neu  PF7:Zurück
```

Nach Datenfreigabe werden die eingegebenen Daten auf formale Richtigkeit und Plausibilität geprüft und ausgerichtet. Fehler werden angezeigt und müssen korrigiert werden. Erst wenn alle Daten korrekt sind, erscheint in Zeile 24 die Aufforderung, die Verarbeitung mit PF3 zu bestätigen. Jede Seite muss einzeln mit PF3 verarbeitet werden.

Im Unterschied zur Nutzung der Taste PF3 ermöglicht eine Nutzung der Taste PF6, dass die eingegebenen Daten nach der Verarbeitung weiterhin auf dem Bildschirm angezeigt werden und somit wiederverwendet werden können. Anschließend kann dann z. B. durch Überschreiben eines Feldes und erneutes Verarbeiten durch PF3 (oder PF6) ein weiterer Auftrag generiert werden.

(C) Feldbesonderheiten

PRIMANOTE / AUFTR / WKN	Wird bei Eingabe aus der Grundmaske übernommen.
SETTL PARTY - LIEFERER: P1 – P5	<p>Kontrahent in CBF oder in einem T2S In-CSD / Kontrahent in einem T2S Out-CSD auf der Gut-Seite:</p> <p>In P1 ist der dem entsprechenden Last-Konto zugeordnete T2S Party BIC und (im Falle eines 7-stelligen Gut-Kontos) SAC vorausgefüllt. Die Eingabe von P2 – P5 ist optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC, DSS und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (es gilt das in Kapitel 0 beschriebene Eingabeschema). Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z. B. Name und Adresse).</p> <p>Kontrahent in einem T2S Out-CSD auf der Last-Seite:</p> <p>Die Eingabe ist gemäß den Angaben im jeweiligen CASCADE Link Guide erforderlich.</p>
SETTL PARTY - EMPFAENGER: P1 – P5	<p>Kontrahent in CBF / Kontrahent in einem T2S Out-CSD auf der Last-Seite:</p> <p>In P1 ist der dem entsprechenden Gut-Konto zugeordnete T2S Party BIC und (im Falle eines 7-stelligen Gut-Kontos) SAC vorausgefüllt. Die Eingabe von P2 – P5 ist optional, erlaubt sind die Attribute KTO, ACC, BIC, DSS und BLZ. Für das Befüllen gibt es je nach gewähltem Level genaue Vorgaben zu Inhalt und Reihenfolge (es gilt das in Kapitel 3 unter (c) Feldbesonderheiten 0 beschriebene Eingabeschema). Freie Felder können mit dem Attribut TXT für Freitext genutzt werden (z. B. Name und Adresse). Die in Textfeldern verwendeten Zeichen müssen dem Zeichensatz (Character Set) X entsprechen.</p> <p>Kontrahent in einem T2S In-CSD / Kontrahent in einem T2S Out-CSD auf der Gut-Seite:</p> <p>Die Eingabe ist gemäß den Angaben im jeweiligen CASCADE Link Guide erforderlich.</p>

(D) Abhängigkeitsprüfungen

P2 – P5	Wird das Präfix mit KTO, ACC, BLZ oder BIC gefüllt, so erwartet das System die Eingabe einer zugehörigen Schlüsselnummer.
P3 – P5	Wird eines dieser Felder gefüllt, so darf das darüberliegende Feld nicht leer sein.

3.1.4.5 Folgedaten (Linkages)

Siehe Kapitel [3.1.1.3](#).

3.1.5 Erfassung TEFRA D Freigabe (TD)

3.1.5.1 Basisdaten

(A) Allgemeine Beschreibung

Gemäß der vom U.S. Internal Revenue Service erlassenen „Tax Equity and Fiscal Responsibility Act of 1982“, kurz TEFRA D Regel, darf eine darunterfallende Wertpapieremission (kurz: TEFRA D Wertpapier oder TEFRA D Gattung) vom Emittenten oder seinen Vertriebspartnern innerhalb einer Frist von 40 Kalendertagen ab Begebung nicht an

- US-Bürger sowie
- Personen, die länger als 183 Tage in den USA leben und damit als US-Steuerinländer gelten,

verkauft werden. Dies ist von der jeweiligen depotführenden Bank im Rahmen der Geschäftstätigkeit für die bei CBF gehaltenen TEFRA D Wertpapiere zu prüfen und an CBF zu melden. CBF informiert nach Ablauf der Frist auf Basis dieser Meldungen das emissionsbegleitende Institut über den auf TEFRA D bezogenen Status der Investoren, damit die Nominale der endgültigen Globalurkunde bestätigt werden kann.

Die CBF bietet zwei weitgehend automatisierte Verfahren zu Abwicklung von TEFRA D Wertpapieren innerhalb der Frist an, die den vormals papiergebundenen Prozess ersetzen. Beide Verfahren bilden die Regeln der US-amerikanischen Steuervorschriften in der erforderlichen Weise ab. Wegen der genauen Implikationen der TEFRA D Regelungen und der Wahl eines bestimmten Verfahrens wird der Kunde gebeten, seine steuerrechtlichen Berater zu konsultieren, da diese Beratung nicht im Service der CBF enthalten ist.

(B) Mögliche Verfahren

Verfahren mit instruktionsbezogenem Freigabe- und Zertifizierungsprozess („Striktes Verfahren“)

Das sogenannte „Strikte Verfahren“ ist von der CBF als Standard vorgesehen und umfasst einen instruktionsbezogenen Freigabe- und Zertifizierungsprozess. Nach jeder Gutschrift eines TEFRA D Wertpapiers innerhalb der 40-tägigen Frist erfolgt eine automatische Umbuchung und damit Sperre der Wertpapiere auf das Unterkonto /671. Positionen auf diesem Unterkonto können über die CASCADE-Transaktion „KVEE TD“ freigegeben werden. Freigaben sind bis einschließlich des dritten Bankarbeitstages nach Fristende möglich. Die Freigabe gilt rechtlich als Erklärung des Verfügenden, dass der CBF-Kunde bzw. dessen Kunde nicht US Tax Subject, d. h. Steuerinländer im Sinne der US-amerikanischen Steuervorschriften ist und daher keine TEFRA D Relevanz besteht.

Die weitere Verarbeitung wird durch das vom Empfänger für sein Depotkonto gewählte Verfahren bestimmt. Nimmt der Empfänger am „strikten Verfahren“ teil, wird die Lieferung automatisch auf dessen TEFRA Unterkonto gebucht und muss damit erneut freigegeben werden. Sofern der Empfänger am nachfolgend beschriebenen „Flexiblen Verfahren“ teilnimmt, verbleibt der Bestand auf dem Hauptkonto des Empfängers und unterliegt dessen zwingend vorzuhaltenden Prüfverfahren bezüglich der TEFRA D Regeln. In diesem Fall verlangt das System die Zertifizierung der Gesamtposition am Ende der 40-tägigen Frist in der nachfolgend beschriebenen Weise.

Verfahren zur technischen Abbildung der Mindestanforderungen zu TEFRA D („Flexibles Verfahren“)

Innerhalb der 40-tägigen Frist für TEFRA D Wertpapiere erfolgt zunächst keine Sperre bzw. Umbuchung auf das Unterkonto /671 und folglich keine TEFRA D relevanten Erklärungen durch den Kontoinhaber bei CBF. Voraussetzung für die Teilnahme am „Flexiblen Verfahren“ ist eine gegenüber der CBF abzugebende Selbstverpflichtung des Kontoinhabers, die Einhaltung der TEFRA D Regeln durch eigene Prüfverfahren zu überwachen. Am Ende der vorgenannten Sperrfrist wird der dann auf dem Hauptkonto verfügbare Bestand auf das Unterkonto gebucht und damit gesperrt. Danach ist eine Freigabe noch weitere drei Geschäftstage über die CASCADE-Transaktion „KVEE TD“ möglich. Die Freigabe-Instruktionen können auch vor der automatischen Sperre, d. h. der Umbuchung auf Unterkonto /671, mit zukünftiger Valuta erfasst werden. Bestandsbezogene Vorabinformationen in TEFRA D Gattungen, für die die 40-tägige Frist ab Begebung läuft, werden zum 20., 30. und geschäftstäglich vom 36. bis 39. Tag der Frist in Form von Listen versendet. Die Teilnahme am „Flexiblen Verfahren“ muss mit einem separaten Formular bei der CBF beantragt werden (verfügbar über Client Services Frankfurt).

(C) Prozessbeschreibung

Durch eine TEFRA D Freigabe über die CASCADE Transaktion „KVEE TD“ erfolgt eine Umbuchung per Sperrdepot zu Gunsten des angegebenen Abwicklungskontos (in der Regel des Hauptkontos xxxx/000). Die Freigabe gilt als Erklärung des verfügenden CBF-Kunden, dass der übertragene Bestand nicht für im Sinne der TEFRA D Regeln dazu Nichtberechtigten gehalten wurde. Sollte ein Teil des gesperrten Bestandes zu Gunsten einer nicht berechtigten Person gebucht sein, so hat dieser Teilbestand auf dem Sperrdepot zu verbleiben. Die Verpflichtung zur Prüfung der Ordnungsmäßigkeit der Freigabe liegt beim bestandsführenden CBF-Kunden.

Gemäß der TEFRA D Regeln dauert die Sperrfrist, wenn vom Emittenten nicht anders verfügt wird, 40 Tage ab Begebung. Die CBF bietet eine Frist von nochmals drei Geschäftstagen zur systemgestützten Abgabe der erforderlichen bestand bezogenen Erklärungen nach TEFRA D an. Das Einräumen dieser zusätzlichen Frist befindet sich im Einklang mit der US-amerikanischen Steuergesetzgebung. Am Ende des 43. Tages informiert die CBF das emissionsbegleitende Institut gemäß den Anforderungen der TEFRA D Regeln über die Bestände der Gattung in ihrem System. Wenn zu diesem Zeitpunkt noch Bestände auf Sperrdepots von CBF-Kunden liegen, gilt dies als Erklärung des Kontoinhabers, dass diese Positionen von im Sinne der TEFRA D Regeln nicht Berechtigten gehalten werden. Das trifft sowohl auf das „Strikte Verfahren“ wie auf das „Flexible Verfahren“ zu.

Das emissionsbegleitende Institut ist für die Information des von ihm betreuten Emittenten des jeweiligen TEFRA D Wertpapiers verantwortlich, da die CBF im Regelfall keine direkte Geschäftsbeziehung zum Emittenten unterhält.

Nach der von CBF vorgenommenen Meldung an das emissionsbegleitende Institut liegt die weitere Bearbeitung der Gattung gemäß der TEFRA D Regeln bei diesem. Daher kann eine Freigabe drei Bankarbeitstage nach Ablauf der Frist seitens des bestandsführenden Kunden nur noch mit Zustimmung des emissionsbegleitenden Instituts erfolgen. Dies erfolgt systemseitig durch den vom Kunden zu veranlassenden Übertrag des freizugebenden Bestandes über dessen Sperrdepot auf das Sonderdepot (yyyy/670) des emissionsbegleitenden Instituts. Nach der Zustimmung des Emittenten entsperrt das emissionsbegleitende Institut den Bestand und überträgt den freigegebenen Anteil auf das Hauptkonto des betreffenden Kunden.

Erträgnis- und Rückzahlungen werden auf gesperrte Bestände im Sperrdepot xxxx/671 nicht vorgenommen.

(D) Eingabemaske TEFRA D Freigabe

TRAN: KVEE FC: TD SB:			
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / TEFRA-D FREIGABE	ERFASSUNGSSTATUS	
PRIMANOTE: _____	AUFTNR: _____	VWA: GS	TR: _
LAST : _____		/	
GUT : _____		/	
WKN : I _____			
NOMINALE : _____	EINHEIT: _____	DISPO-PRIORITAET: _	
GEGENWERT: _____	WRG : EUR	PARTY-HOLD (J/B/C/N) : N	
DCA/REF : _____		EMISS-EINF (J/N) : N	
SET-DAY : 08.01.2020	EX-TRD : _	BATM/ADEA (J/N) : N	
BOERSENPL: _____	OPT-OUT: _	CLRNG PL :	
SCHLUSSTAG: _____	REFERENZ-NR : _____		
KURS / WRG: _____	AUFTRAGS-REFERENZ: _____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch			

(E) Felddesonderheiten

Bei der Erfassung einer TEFRA D Freigabe sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

AUFTNR	
VWA	„GS“ = Girosammelverwahrung
LAST	Unterkonto /671 der Bank-Nr. des erfassenden Kunden der CBF
GUT	Leer/Unterkonto des emissionsbegleitenden Instituts /670 nach Ende der 40-Tage Frist (TEFRA D Frist)
WKN-KENNUNG	„I“ (änderbar in „W“)
WKN	
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag
EMISS-EINF	„N“ = NEIN
PARTY HOLD	„N“ = NEIN
BATM/ADEA	„N“ = NEIN

Ansonsten gelten die Felddesreibungen für die Einzelerfassung eines WP-Übertrages (siehe Kapitel [3.1](#)) auch für TEFRA D Freigaben.

(F) Eingabemaske TEFRA D Freigabe/Erfassung-2

Sind die Mussfelder (vgl. Abschnitt D) ausgefüllt, so wechselt PF8 auf die zweite Seite der Eingabemaske:

TRAN: KVEE FC: TD SB:		
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / ERFASSUNG-2	ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: 123	AUFTNR: 456789	WKN: I DE000A1KXXR3
UEB-GRUND : ____		
EXT SET-DAY: _____	RUECKUEBERTRAG (J/N) : N	
ALREADY MATCHED (J/) : _	PARTIAL SETTL.INDICATOR: _____	
ISO TRANSACTION CODE : _____		
BELEGSCHAFT-SP: N	SP-DATUM: _____	
KUPONINFO/RECORD-DATE: _____		
TEXT: _____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF7:Zurück PF8:Vor		

(G) Abhängigkeitsprüfungen

Die Prüfungen werden wir für die Einzelerfassung eines WP-Übertrages durchgeführt mit folgenden Besonderheiten:

LAST	LAST wird mit dem TEFRA D Sperrdepot (xxxx/671) des erfassenden Kunden vorbelegt.
GUT	GUT wird nur nach Ablauf der TEFRA D Frist (40 Tage) mit der speziellen Unterkontonummer des emissionsbegleitenden Instituts (xxxx/670) vorbelegt; innerhalb der Frist wird GUT nicht vorbelegt. Für eine Lieferung muss das GUT zum gleichen Kontostamm wie LAST gehören.
GEGENWERT	Für eine Freigabe ist eine Eingabe nicht zulässig.
WRG	Für eine Freigabe ist eine Eingabe nicht zulässig.
ALREADY MATCHED	Für eine Freigabe ist eine Eingabe nicht möglich.
PARTIAL SETTL.INDICATOR	Für eine Freigabe ist das Feld mit „NPAR“ vorgefüllt; eine Änderung ist nicht möglich.

3.1.5.2 Folgedaten

Für die Folgedaten gelten die allgemeingültigen Felddescriptions für die Einzelerfassung eines WP-Übertrages (siehe oben) auch für TEFRA D Freigaben.

(A) Allgemeine Beschreibung

Befindet sich der Kontrahent des WP-Übertrages im Ausland oder wird ein Auftrag frei von Zahlung erfasst, so *müssen* zusätzliche Daten in einer Folgemaske eingegeben werden.

(B) Folgemaske TEFRA D Freigabe

```
TRAN: KVEE FC: TD SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / SETL.PTY-ERFASSUNG      ERFASSUNGSSTATUS
                          PRIMANOTE: 123      AUFTNR: 456789      WKN: I DE000A1KXXR3
SETTL PARTY - LIEFERER
P1: _____
P2: _____
P3: _____
P4: _____
P5: _____
SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: _____
P2: _____
P3: _____
P4: _____
P5: _____
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF7:Zurück
```

(C) Feldbesonderheiten

Es gelten dieselben Felddescriptions wie für die Einzelerfassung eines WP-Übertrages (siehe Kapitel [3.1](#)).

Freigabe und Lieferung von TEFRA D Wertpapieren (für beide Verfahren)

Abhängig vom jeweiligen Prozessschritt bestehen verschiedene Möglichkeiten der Freigabe von Lieferungen oder Verkaufsinstruktionen von TEFRA D Wertpapieren in und nach der 40-tägigen Frist:

- Die TEFRA D Wertpapiere sind bereits vom verfügbaren CBF-Kunden (Striktes Verfahren) freigegeben worden oder das empfangende Konto nimmt am „Flexiblen Verfahren“ teil, die TEFRA D Gattung befindet sich nicht auf dem Sperrdepot xxxx/671: Die Wertpapiere können per Wertpapierübertrag (WPÜ) ohne Gegenwert instruiert werden. Die weitere Verarbeitung beim empfangenden CBF-Kunden hängt vom Set up des Empfängerkontos ab.
- Die TEFRA D Wertpapiere werden innerhalb der 40-tägigen Frist auf dem Sperrdepot xxxx/671 als Bestand geführt: Die Wertpapiere können über die Freigabefunktion in CASCADE (KVEE TD) zu Gunsten des Abwicklungskontos (in der Regel das Hauptkonto) umgebucht werden, sofern dies nach Prüfung des Kunden den TEFRA D Regeln entspricht. Eine Abwicklung in Fremdwährung ist beim „strikten“ Verfahren innerhalb der 40-tägigen Frist nicht möglich.
- Die TEFRA D Wertpapiere befinden sich nach Ablauf der 40-tägigen Frist noch auf dem Sperrdepot xxxx/671: Eine Freigabe nach Ablauf der Laufzeit und weiteren drei Bankarbeitstagen kann nur noch nach Zustimmung des emissionsbegleitenden Instituts erfolgen. Daher wird systemseitig nur die Umbuchung auf das Unterkonto /670 des emissionsbegleitenden Instituts zugelassen. Diese Umbuchung erfolgt über die TEFRA D Freigabefunktion (KVEE TD); nach Eingabe der ISIN oder Wertpapierkennnummer wird das Sonderkonto des emissionsbegleitenden Instituts als GUT-Konto vorgegeben. Bei der Eingabe einer anderen Kontonummer wird durch eine Fehlermeldung auf diesen Sachverhalt hingewiesen. Nach der Löschung der fehlerhaften Kontonummer und nochmaliger Freigabe wird das korrekte Sonderkonto des emissionsbegleitenden Instituts eingeblendet. Das emissionsbegleitende Institut nimmt nach Zustimmung des Emittenten den Umtausch in den freigegebenen Bestand vor und überträgt den Anteil auf das Hauptkonto des betreffenden Kunden.
- Nach Ablauf der 40-tägigen Frist können die TEFRA D Wertpapiere als regulärer Wertpapierübertrag (WPÜ) mit und ohne Gegenwert erfasst werden. Eine Umbuchung auf ein Sperrdepot erfolgt danach nicht mehr.

3.1.6 Einzelerfassung von Überträgen an die Deutsche Finanzagentur (BE)

(A) Allgemeine Beschreibung

Nach Eingabe des Funktionscodes „BE“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung zur Verfügung gestellt.

WP-Überträge in Einzelschuldbuchforderung sind WP-Überträge einer Bank (Teilnehmer CBF) an die Deutsche Finanzagentur, um einen Anteil aus der Sammelschuldbuchforderung, lautend auf die Clearstream Banking AG, Frankfurt, in eine Einzelschuldbuchforderung zugunsten eines Einzelschuldbuchgläubigers umzuwandeln. Auftraggeber dieser Übertragungsart ist der Teilnehmer der CBF, Empfänger ist die Deutsche Finanzagentur.

(B) Eingabemaske Einzelerfassung

TRAN: KVEE FC: BE SB:		
AUFTRAGSABWICKLUNG	BSV-UEBERTRAG / EINZELERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: _____	UEBERTRAG-ART: 1 AN SV	AUFTNR: _____ VWA: GS
LAST : _____		/
GUT : _____		/
WKN : I _____		
NOMINALE : _____	EINHEIT:	
SET-DAY : 20.11.2014	DISPO-PRIORITAET: 1	
KUPONINFO: _____	ST-ZINS: _____ EUR	ERWERBS-TAG : _____
ERWORBEN/VERW. (J/N) : _	ERWERBS-PREIS: _____	EUR
SV-KTO : _____	PERSON : _	
NAME1 : _____	VORNAME1: _____	
NAME2 : _____	VORNAME2: _____	
STRASSE: _____		
LKZ : D	PLZ/ORT : _____	
TEXT : _____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch		

(C) Felddesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines Übertrages an die Deutsche Finanzagentur sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
UEBERTRAG-ART	„1“
AUFTNR	
VWA	„GS“ = Girosammelverwahrung
LAST	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
GUT	SV-Konto der Deutsche Finanzagentur (7950)
WKN	„I“ änderbar in „W“
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag
ST-ZINS	EUR
SV-KONTO	
PERSON	17
NAME1	
VORNAME1	
STRASSE	
LKZ	„D“ = Deutschland
PLZ/ORT	

¹⁷ Muss nur gefüllt werden, wenn im Feld SV-KONTO „Neueintrag“ eingegeben wurde.

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Einzelerfassung eines Übertrages an die Deutsche Finanzagentur folgende Feldbesonderheiten:

PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld PRIMANOTE mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
UEBERTRAG-ART	Nur „1“ für Übertragung an die Deutsche Finanzagentur zulässig.
VWA	Nur „GS“ für Girosammelverwahrung möglich.
LAST	Nur inländisches Konto erlaubt. Darüber hinaus ist für das LAST-KTO nur Konto-Art 1 (Kundenkonto), 10 (Kundenkonto) oder 14 (Verfügungskonto) zulässig.
GUT-	Es darf nur ein Konto der Deutschen Finanzagentur (Kontoart 7) eingegeben werden.
DISPO-PRIORITAET	Das Feld ist mit Dispositionsriorität „1“ („Reserved“) vorbelegt; eine Änderung ist nicht möglich.
KUPON-INFO	Dies Feld ist als freies Feld definiert und hat damit keine Auswirkungen auf die Zinsverrechnung.
ST-ZINS	Aufgrund der Zinsabschlagssteuer müssen auch bei Übertragungen an die Deutsche Finanzagentur die gezahlten Stückzinsen mitangegeben werden.
ERWERBS-PREIS	In diesem Feld ist der steuerlich relevante Aufwand für den Erwerb der WKN anzugeben, d. h. der reine Nettokaufpreis ohne Provisionen und Gebühren. Aufgewandte Stückzinsen sind in diesem Preis nicht zu berücksichtigen. Sie werden im separaten Feld ST-ZINS (vgl. dort) angegeben. Ab November 2001 ist EUR möglich. Bei nachfolgenden Wertpapierarten muss dieses Feld gefüllt werden: Bundesschatzbriefe Typ A und Typ B nach dem 1. Januar 1994 begebene zinsvariable oder Strip-fähigen Anleihen
ST-ZINS	Aufgrund der Zinsabschlagssteuer müssen auch bei Übertragungen an die Landesschuldenverwaltung die gezahlten Stückzinsen mitangegeben werden.
SV-KONTO	Hier ist stets die 7-stellige Schuldbuch-Kontonummer einzugeben, die mit 0, 1, 3, 4, 6, 8 oder 9 beginnen muss (6-stelligen Kontonummern ist die „0“ voranzustellen). Sofern für den Begünstigten noch kein Schuldbuchkonto besteht, ist „NEU-EINTRAG“ in das Feld einzugeben. Das Feld PERSON ist dann ein Mussfeld.
NAME 1 / VORNAME 1	Hier sind Name und Vorname des Schuldbuchkonto-Inhabers, bei Neueintragen Name und Vorname des Begünstigten einzutragen. Namenszusätze und Berufsbezeichnungen sind nicht einzugeben. Vorsatzwörter wie „von“ sind hinter dem Vornamen möglich. Beispiel: Peter von Müller ist im Feld „NAME“ mit „Müller“ und im Feld „VORNAME“ mit „Peter von“ zu erfassen. Entsprechendes gilt für akademische Grade (z. B. Prof., Dr., Dipl.-Ing.) und für historisch bedingte Namenszusätze (Baron, Freiherr, Graf). Bei bereits bestehenden Schuldbuchkonten ist die Angabe akademischer Grade und historisch bedingter Namenszusätze nicht erforderlich. Ansonsten gelten für die Schreibweise von Namen die Regeln der DIN-Norm 5007 in ihrer jeweils gültigen Fassung.
NAME 2 / VORNAME 2	Bei Gemeinschaftskonten sind hier Name und Vorname des 2. Kontoinhabers einzutragen. Bei Neueintragen kann – wenn gewünscht – ein zweiter Begünstigter eingegeben werden.
STRASSE / PLZ / ORT	Weichen bei Neueintragen für zwei Begünstigte die Anschriften voneinander ab, sind hier die Angaben zum ersten Begünstigten einzugeben.
LKZ	Zulässig sind die im Anhang in der entsprechenden Tabelle angegebenen Länderkurzbezeichnungen. Enthält die Liste für das Land des Begünstigten keine Kurzbezeichnung, ist „XXX“ einzutragen.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST / GUT	Lastschrift-Konto und Gutschrift-Konto dürfen nicht gleich sein.
LAST / USER-ID	Die ersten vier Stellen der Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.
GUT / WKN	<p>Bei Überträgen an die Deutsche Finanzagentur (GUT = Konto der Deutschen Finanzagentur) sind im Feld WKN nur folgende Wertpapierarten erlaubt:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Anleihen des Bundes und seiner Sondervermögen • Anleihen der Deutschen Ausgleichsbank • Schatzanweisungen (Kassenobligationen) des Bundes und seiner Sondervermögen • Bundesschatzbriefe • Bundesobligationen • Finanzierungsschätze <p>Voraussetzung: Für das zu erfassende Wertpapier muss die „Umwandlung in Einzelschuldbuchforderung“ möglich sein.</p>
SV-KONTO / PERSON	<p>Wurde das SV-KONTO mit der Bezeichnung „NEUEINTRAG“ gefüllt, so muss im Feld PERSON angegeben werden, ob sich die Eingaben auf</p> <ul style="list-style-type: none"> • eine natürliche Person (Feldeingabe: „P“ für persönlich) oder • eine juristische Person (Feldeingabe: „U“ für unpersönlich) <p>beziehen. Darüber hinaus ist vom Begünstigten ein Antrag auf Eröffnung eines Schuldbuchkontos bei der Deutsche Finanzagentur zu stellen.</p>
PERSON / VORNAME 1	Wurde das Feld PERSON mit „U“ für unpersönlich gefüllt, dann ist im Feld VORNAME1 (= Mussfeld) ein „X“ einzugeben.
ERWERBSTAG / ST-ZINS	Wird das Feld ST-ZINS gefüllt, so muss auch das Feld ERWERBSTAG gefüllt werden.
ERW-PREIS / ERWERBSTAG	<p>Wird das Feld ERW-PREIS gefüllt, so sind auch Eintragungen im Feld ERWERBSTAG erforderlich.</p> <p>Wird das Feld ERW-PREIS gefüllt, so muss auch die Währungsangabe gefüllt sein (EUR).</p>

3.1.7 Erfassung von LSV-Überträgen (LE)

(A) Allgemeine Beschreibung

Nach Eingabe des Funktionscodes „LE“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung zur Verfügung gestellt.

Bei Überträgen an eine Landesschuldenverwaltung wird ein Anteil aus der Sammelschuldbuchforderung, lautend auf die Clearstream Banking AG, Frankfurt, in eine Einzelschuldbuchforderung zugunsten eines Einzelschuldbuchgläubigers umgewandelt. Auftraggeber dieser Übertragungsart ist der Kunde der CBF, Empfänger ist eine Landesschuldenverwaltung.

Es können nur solche Wertpapiere übertragen werden, bei denen ausdrücklich eine Umwandlung in eine Einzelschuldbuchforderung möglich ist.

(B) Eingabemaske Einzelerfassung LSV-Übertrag

```
TRAN: KVEE FC: LE SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          LSV-UEBERTRAG / EINZELERFASSUNG          ERFASSUNGSSTATUS

PRIMANOTE: _____          UEBERTRAG-ART: 1 AN SV AUFTNR: _____          VWA: GS

LAST      : _____          /
GUT       : _____          /
WKN       : I _____

NOMINALE  : _____          EINHEIT:
SET-DAY   : 20.11.2014          DISPO-PRIORITAET: 1
KUPONINFO : _____          ST-ZINS: _____          EUR ERWERBS-TAG : _____
ERWORBEN/VERW. (J/N): _          ERWERBS-PREIS: _____          EUR
SV-KTO    : _____          PERSON   : _
NAME1     : _____          VORNAME1: _____
NAME2     : _____          VORNAME2: _____
STRASSE   : _____
LKZ       : D                    PLZ/ORT  : _____
TEXT      : _____

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch
```

(C) Felddesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines LSV-Übertrages sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
UEBERTRAG-ART	„1“
AUFTNR	
VWA	„GS“ = Girosammelverwahrung
LAST	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
GUT	
WKN	„I“ änderbar in „W“
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag
SV-KONTO	
PERSON	^a
NAME1	
VORNAME1	
STRASSE	
LKZ	„D“ = Deutschland
PLZ/ORT	

a. Muss nur gefüllt werden, wenn im Feld SV-KONTO „Neueintrag“ eingegeben wurde.

Neben der allgemeingültigen Felddescription (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Einzelerfassung eines LSV-Übertrages folgende Felddesonderheiten:

PRIMANOTE	Bei Fortsetzung der Erfassung wird das Feld PRIMANOTE mit der Nummer aus der vorhergehenden Erfassung vorbelegt.
UEBERTRAG-ART	Nur „1“ für Übertragung an die Landesschuldenverwaltung zulässig.
VWA	Nur „GS“ für Girosammelverwahrung zulässig.
LAST	Nur inländisches Konto erlaubt. Darüber hinaus ist für das LAST-KTO nur Konto-Art 1 (Kundenkonto), 10 (Kundenkonto) oder 14 (Verfügungskonto) zulässig.
GUT	Es darf nur ein LSV-Konto (Kontoart 8) eingegeben werden.
DISPO-PRIORITAET	Das Feld ist mit Dispositionspriorität „1“ („Reserved“) vorbelegt; eine Änderung ist nicht möglich.
KUPON-INFO	Dies Feld ist als freies Feld definiert und hat damit keine Auswirkungen auf die Zinsverrechnung.
ST-ZINS	Aufgrund der Zinsabschlagssteuer müssen auch bei Übertragungen an die Landesschuldenverwaltung die gezahlten Stückzinsen mitangegeben werden.
ERWERBS-TAG	Als Erwerbtag ist der Abrechnungstag anzugeben. (vgl. Mitteilung des Bundesministeriums für Finanzen -> IV B4 - S2400 -136 vom 25. Oktober 1994). Das Feld ermöglicht der Deutsche Finanzagentur im Rahmen der steuerlichen Behandlung des Zinsabschlages die korrekte Zuordnung von gemeldeten Stückzinsen zum jeweiligen Kalenderjahr vorzunehmen.

ERWORBEN/VERW.	<p>Das übertragende Institut hat hier eine Eintragung bezüglich des Erwerbs und der Verwahrung der Wertpapiere vorzunehmen:</p> <p>J = JA: Das übertragende Institut hat die Wertpapiere für den Kunden am Markt erworben oder aus ihrem Eigenbestand veräußert und seitdem verwahrt und verwaltet.</p> <p>N = NEIN: Das übertragende Institut hat die Wertpapiere bspw. aus einem Depotübertrag des Kunden erhalten.</p>
ERWERBS-PREIS	<p>In diesem Feld ist der steuerlich relevante Aufwand für den Erwerb der Wertrechte anzugeben, d. h. der reine Nettokaufpreis ohne Provisionen und Gebühren. Aufgewandte Stückzinsen sind in diesem Preis nicht zu berücksichtigen. Sie werden im separaten Feld ST-ZINS (vgl. dort) angegeben.</p> <p>Bei nachfolgenden Wertpapierarten muss dieses Feld gefüllt werden: Bundesschatzbriefe Typ A und Typ B und nach dem 1. Januar 1994 begebene zinsvariable Anleihen oder Stripped Bonds</p>
SV-KONTO	<p>Hier ist stets die Landesschuldbuch-Kontonummer einzutragen. Sofern für den Begünstigten noch kein Schuldbuchkonto besteht, ist „NEUEINTRAG“ in das Feld einzugeben. Das Feld PERSON ist dann ein Mussfeld.</p>
NAME 1/ VORNAME 1	<p>Hier sind Name und Vorname des Schuldbuchkonto-Inhabers, bei Neueintragungen Name und Vorname des Begünstigten einzutragen. Namenszusätze und Berufsbezeichnungen sind nicht einzugeben. Vorsatzwörter wie „von“ sind hinter dem Vornamen möglich. Beispiel: Peter von Müller ist im Feld „NAME“ mit „Müller“ und im Feld „VORNAME“ mit „Peter von“ zu erfassen. Entsprechendes gilt für akademische Grade (z. B. Prof., Dr., Dipl.-Ing.) und für historisch bedingte Namenszusätze (Baron, Freiherr, Graf). Bei bereits bestehenden Schuldbuchkonten ist die Angabe akademischer Grade und historisch bedingter Namenszusätze nicht erforderlich.</p> <p>Ansonsten gelten für die Schreibweise von Namen die Regeln der DIN-Norm 5007 in ihrer jeweils gültigen Fassung.</p>
NAME 2 / VORNAME 2	<p>Bei Gemeinschaftskonten sind hier Name und Vorname des 2. Kontoinhabers einzutragen. Bei Neueintragungen kann – wenn gewünscht – ein zweiter Begünstigter eingegeben werden.</p>
STRASSE / PLZ / ORT	<p>Weichen bei Neueintragungen für zwei Begünstigte die Anschriften voneinander ab, sind hier die Angaben zum ersten Begünstigten einzugeben.</p>
LKZ	<p>Zulässig sind die im Anhang in der entsprechenden Tabelle angegebenen Länderkurzbezeichnungen. Enthält die Liste für das Land des Begünstigten keine Kurzbezeichnung, ist „XXX“ einzutragen.</p>

(D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST / GUT	Lastschrift-Konto und Gutschrift-Konto dürfen nicht gleich sein.
LAST / USER-ID	Die ersten vier Stellen der Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.
GUT / WKN	Bei Überträgen an die LSV (GUT = LSV-Konto) sind im Feld WKN nur Länderanleihen erlaubt. Grundsätzlich müssen für diese Anleihen Eintragungen in das Landesschuldbuch möglich sein.
SV-KONTO/PERSON	Wurde das SV-KONTO mit der Bezeichnung „NEUEINTRAG“ gefüllt, so muss im Feld PERSON angegeben werden, ob sich die Eingaben auf <ul style="list-style-type: none">• eine natürliche Person (Feldeingabe: „P“ für persönlich) oder• eine juristische Person (Feldeingabe: „U“ für unpersönlich) beziehen. Darüber hinaus ist vom Begünstigten ein Antrag auf Eröffnung eines Schuldbuchkontos bei der Landesschuldenverwaltung zu stellen.
ERWERBSTAG / ST-ZINS	Wird das Feld ST-ZINS gefüllt, so müssen auch die Felder ERWERBSTAG und die Währungsbezeichnung gefüllt werden.
ERW-PREIS / ERWERBSTAG	Wird das Feld ERW-PREIS gefüllt, so sind auch Eintragungen in den Feldern ERWERBSTAG und die Währungsbezeichnung erforderlich.

3.1.8 Erfassung Umtausch GBC (UT)

(A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Umtausch Global Bearer Certificates (GBC) wird der Tausch von bestimmten Aktien bei der entsprechenden Lagerstelle der CBF in Anteile an dem Inhabersammelzertifikat der CBF vorgenommen.

Der gültig erteilte Umtauschauftrag wird mit einem „Hold“ Flag nach T2S weitergeleitet und erst durch CBF freigegeben, wenn die Stücke bei der Lagerstelle der CBF eingegangen sind.

Nach Eingabe des Funktionscodes „UT“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

Detaillierte Beschreibungen finden Sie auch auf unserer Website unter [Global Bearer Certificates](#).

(B) Eingabemaske Umtausch GBC

TRAN: KVEE FC: UT SB:		
AUFTRAGSABWICKLUNG	UMTAUSCH / ERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: _____	AUFTNR: _____	VWA: _____
LAST : 7961 000	CBF TRESORBESTAND SVG	/ DAKVDEFFXXX
GUT : _____		/
WKN : I _____		
NOMINALE : _____	EINHEIT: _____	ST-ART: _____
TRADE-DATE: _____	EXT.SET-DAY: _____	
CBF-LAG : _____		
KUNDENREFERENZ: ____ - _____ - _____		
LIEFERUNG-VON NAME: _____		
TEXT: _____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch		

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung eines Umtausches sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
AUFTNR	
GUT	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
WKN-KENNUNG	„I“ änderbar in „W“
WKN	
NOMINALE	
TRADE-DATE	
LIEFERUNG-VON NAME	<p>Verschlüsselung der ISIN in WSS mit LGL/LGS 271/001</p> <p>Die Instruktionseingabe muss mit dem Wert „CRST/“ eingegeben werden. Bei fehlerhafter Eingabe wird folgende Fehlermeldung angezeigt: KV0779F Nur Eingaben mit „CRST/“ erlaubt. 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.</p> <p>Verschlüsselung der ISIN in WSS ohne LGL/LGS 271/001</p> <p>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 dazugehörigen 8-stelligen BIC aufweisen. Es wird geprüft, dass die ersten sechs Stellen nur Großbuchstaben und die letzten zwei Stellen Großbuchstaben oder Zahlen enthalten. Alle anderen Angaben werden mit Fehlerhinweis „FÜR DIESE ISIN NUR BIC DES KONTRAHENTEN MÖGLICH“ abgelehnt.</p>

Neben der allgemeingültigen Feldbeschreibung (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Erfassung eines Umtauschauftrages folgende Feldbesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 5000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
VWA	Die Verwahrart wird nach Eingabe der jeweiligen WKN automatisch vom System zugesteuert.
LAST	LAST wird automatisch mit dem Tresorkonto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar.
GUT	Das Gut-Konto muss nachfolgender Kontoart entsprechen: <ul style="list-style-type: none"> • Kundenkonten Wird eine BIC eingegeben, so muss diese als T2S Party BIC für ein Konto der o.g. Kontoart in CBF hinterlegt sein.
WKN	Die eingegebene WKN muss die entsprechende Verwahrmöglichkeit ausweisen.
CBF-LAG	Ergibt sich aus der WKN und ist nicht änderbar.
LIEFERUNG-VON NAME	Siehe oben

(D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST / GUT	LAST und GUT dürfen nicht gleich sein.
GUT / USER-ID	Die ersten vier Stellen der Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

3.1.9 Erfassung Rücktausch GBC (RT)

(A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Rücktausch Global Bearer Certificates (GBC) werden Anteile an dem Inhabersammelzertifikat der CBF in bestimmte Aktien bei der entsprechenden Lagerstelle der CBF in im betreffenden Land lieferbare Originalaktien getauscht.

Die Buchung in T2S erfolgt an dem vom Eingaber vorgegebenen Settlement-Day.

Nach Eingabe des Funktionscodes „RT“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

Detaillierte Beschreibungen finden Sie auch auf unserer Website unter [Global Bearer Certificates](#).

(B) Eingabemaske Rücktausch GBC

TRAN: KVEE FC: RT SB:		
AUFTRAGSABWICKLUNG	RUECKTAUSCH / ERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: _____	AUFTNR: _____	VWA: _____
LAST : _____		/
GUT : 7961000	CBF TRESORBESTAND SVG	/ DAKVDEFFXXX
WKN : I _____		
NOMINALE : _____	EINHEIT: _____	ST-ART: _____
SET-DAY : 20.11.2014		
TRADE-DATE: _____	EXT.SET-DAY: _____	
CBF-LAG :		
KUNDENREFERENZ: ____ - _____ - _____		
LIEFERUNG-AN NAME :		
ADRESSE: _____		
BEGUENSTIGTER NAME: _____		
ADRESSE: _____		
TEXT : _____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch		

(C) Felddesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines Rücktausches sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
AUFTNR	
LAST	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
WKN-KENNUNG	„I“ änderbar in „W“
WKN	
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag
TRADE-DATE	
LIEFERUNG-AN NAME	<p>Verschlüsselung der ISIN in WSS mit LGL/LGS 271/001</p> <p>Die Instruktionseingabe muss mit dem Wert „CRST/“ eingegeben werden. Bei fehlerhafter Eingabe wird folgende Fehlermeldung angezeigt: KV0779F Nur Eingaben mit „CRST/“ erlaubt. Danach ist nur noch die Eingabe von bis zu fünf Stellen (alphanumerisch) möglich. Alle anderen Angaben werden je nach erfasster ISIN mit einer Fehlermeldung abgelehnt.</p> <p>Verschlüsselung der ISIN in WSS ohne LGL/LGS 271/001</p> <p>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 dazugehörigen 8-stelligen BIC aufweisen. Es wird geprüft, dass die ersten sechs Stellen nur Großbuchstaben und die letzten zwei Stellen Großbuchstaben oder Zahlen enthalten. Alle anderen Angaben werden mit Fehlerhinweis („FÜR DIESE ISIN NUR BIC DES KONTRAHENTEN MÖGLICH“) abgelehnt.</p>

Neben der allgemeingültigen Felddescription (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Felddesreibungen und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Erfassung eines Rücktauschauftrages folgende Felddesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 5000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
VWA	Die Verwahrart wird nach Eingabe der jeweiligen WKN automatisch vom System zugesteuert.
LAST	Das Last-Konto muss nachfolgender Kontoart entsprechen: <ul style="list-style-type: none"> • Kundenkonten Wird eine BIC eingegeben, so muss diese als T2S Party BIC für ein Konto der o.g. Kontoart in CBF hinterlegt sein.
GUT	GUT wird automatisch mit dem Tresorkonto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar.
WKN	Die eingegebene WKN muss die entsprechende Verwahrmöglichkeit ausweisen.
CBF-LAG	Ergibt sich aus der WKN und ist nicht veränderbar.
LIEFERUNG-AN NAME/ADRESSE	Siehe oben
BEGÜNSTIGTER	Hier kann der Endbegünstigte eingetragen werden, dessen Depot die Stücke über eine Drittbank oder einen Broker gutzuschreiben sind.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST / GUT	LAST und GUT dürfen nicht gleich sein.
LAST / USER-ID	Die ersten vier Stellen der Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.

3.1.10 Erfassung Optionsscheintrennung (OT)

(A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Optionsscheintrennung kann die Bestandstrennung einer Optionsanleihe cum (WKN-Cum) in die Bestände Optionsanleihe ex (WKN-Ex) und nur Optionsscheine (WKN-Opt) durchgeführt werden. Bei der Auftragserteilung ist jeweils nur die gewünschte WKN und Nominale der Cum-Anleihe vorzugeben. Die erforderlichen Zusatzbuchungen werden in CASCADE erzeugt und in T2S gebucht. Die Umsätze aus den Trennvorgängen können über ein abweichendes Depotkonto des Teilnehmers abgewickelt werden.

Nach Eingabe des Funktionscodes „OT“ in das Erfassungsauswahlménü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

(B) Eingabemaske Optionsscheintrennung

TRAN: KVEE FC: OT SB:		
AUFTRAGSABWICKLUNG	OPT.TRENNUNG / ERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: _____	AUFTNR: _____	HLG: 01 GS
LAST : _____		
GUT : 7926000	CBF W/OPT.TREN.U.BOND STRIPPING	/
WKN : - _____		/
NOMINALE : _____	EINHEIT:	ST-ART:
SET-DAY : 20.11.2014		
KUNDENREFERENZ: _____ - _____		
ES WERDEN ZUSAETZLICH _____	BUCHUNGEN ZU GUNSTEN _____	VORGENOMMEN: _____
WKN		NOMINALE/ST.
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch		

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Erfassung eines Auftrages zur Optionsscheintrennung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
AUFTNR	
HLG	„GS“ = Girosammelverwahrung
LAST	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
WKN	„I“ änderbar in „W“
WKN	
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag
ZU GUNSTEN-KONTO	Kontonummer der erfassenden Bank

Neben der allgemeingültigen Felddescription (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Felddescriptionen und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Erfassung eines Auftrages zur Optionsscheintrennung folgende Felddesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 5000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
HLG	Folgende Ausprägungen sind möglich: 01 = GS (Girosammelverwahrung) Die für die jeweilige WKN festgelegte Verwahrmöglichkeit muss mit der HLG-CBF übereinstimmen.
LAST	Die Kontonummern müssen nachfolgenden Kontoarten entsprechen: <ul style="list-style-type: none"> • Kundenkonten (auch Treuhand/Vorratslager/Rückgabe, Spezialabwicklung) • EUREX-Sicherheiten • Konto der CBF • Verleih-Konto Wird eine BIC eingegeben, so muss diese als T2S Party BIC für ein Konto der o.g. Kontoarten in CBF hinterlegt sein.
GUT	In diesem Feld wird automatisch ein internes Konto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar.
WKN	Folgende Wertpapierarten sind für eine Opt.-Trennung zugelassen: <ul style="list-style-type: none"> • Optionsanleihe cum Optionsschein • Doppelwährungs-Optionsanleihe cum • Wandelanleihe cum OS • Zero-Optionsanleihe cum OS • Opt. Gen. Rechte cum
BUCHUNGEN/ BUCHUNGS-ZEILE	Nach Datenfreigabe der Auftragsdaten wird gleichzeitig die Anzahl der möglichen Umsätze angezeigt. Angaben zu den einzelnen Zusatzbuchungen erfolgen jeweils mit der WKN, WP-Bezeichnung und Nominale in der Buchungszeile. Diese ergeben sich automatisch aus dem Trennungsverhältnis Optionsanleihe-cum in Optionsanleihe ex-Optionsscheine und nur-Optionsscheine. Bei mehr als sechs Zusatzbuchungen wird auf diesen Sachverhalt hingewiesen. Gebuchte Depotumsätze sind vollständig in der Umsatzanzeige (KVDU) abrufbar.

ZU-GUNSTEN-KTO	Haupt- und Unterkonto des zu-Gunsten-Kontos werden automatisch durch das System analog dem Last-Konto vorbelegt. Wird das Unterkonto des Last-Kontos durch den Eingabe verändert, verändert sich das zu-Gunsten-Konto nicht automatisch mit. Sofern gewünscht, kann die Unterkontonummer geändert werden.
----------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST / USER-ID	Die ersten vier Stellen der Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.
WKN / SETTLEMENT-DAY	Der Settlement-Day (auch der Settlement-Day Vortrag) muss innerhalb der Umtauschfrist für die eingegebene WKN liegen.

3.1.11 Erfassung Optionsscheinzusammenführung (OZ)

(A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Optionsscheinzusammenführung kann die Bestandszusammenführung aus den Beständen Optionsanleihe-ex (WKN/-Ex) und nur-Optionsscheine (WKN/-Opt) zur Optionsanleihe cum (WKN/-Cum) durchgeführt werden. Bei der Auftragserteilung ist jeweils nur die gewünschte WKN und Nominale der Cum-Anleihe vorzugeben. Die erforderlichen Zusatzbuchungen werden in CASCADE erzeugt und in T2S gebucht. Die Umsätze aus den Vorgängen zur Zusammenführung können über ein abweichendes Depotkonto des Teilnehmers abgewickelt werden.

Nach Eingabe des Funktionscodes „OZ“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

(B) Eingabemaske Optionsscheinzusammenführung

```

TRAN: KVEE FC: OZ SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG   OPT.ZUSAMMENFUEHRUNG/ ERFASSUNG           ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: _____ AUFTNR: _____ HLG: 01 GS
LAST      : 7926000    CBF W/OPT.TREN.U.BOND STRIPPING /
GUT      : _____ /
WKN      : - _____
NOMINALE : _____ EINHEIT:           ST-ART:
SET-DAY  : 20.11.2014
KUNDENREFERENZ: _____ - _____ - _____
ES WERDEN ZUSAETZLICH _____ BUCHUNGEN ZU LASTEN _____ VORGENOMMEN:
WKN                                           NOMINALE/ST.

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch

```

(C) Felddesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines Auftrages zur Optionsscheinzusammenführung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
AUFTNR	
HLG	„GS“ = Girosammelverwahrung
GUT-KONTO	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
WKN-KENNUNG WKN	„I“ änderbar in „W“
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag
ZU-LASTEN-KONTO	Internes Konto der CBF

Neben der allgemeingültigen Felddescription (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Felddescriptions und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Erfassung eines Auftrages zur Optionsscheinzusammenführung folgende Felddesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 5000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
CBF	Folgende Ausprägungen sind möglich: 01 = GS (Girosammelverwahrung) Die für die jeweilige WKN festgelegte Verwahrmöglichkeit muss mit der HLG-CBF übereinstimmen.
LAST	In diesem Feld wird automatisch ein internes Konto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar
GUT	Die Kontonummern müssen nachfolgenden Kontoarten entsprechen: <ul style="list-style-type: none"> • Kundenkonten (auch Treuhand/Vorratslager/Rückgabe, Spezialabwicklung) • EUREX-Sicherheiten • Verleih-Konto. Wird eine BIC eingegeben, so muss diese als T2S Party BIC für ein Konto der o.g. Kontoart in CBF hinterlegt sein.
WKN	Folgende Wertpapierarten sind für eine Opt.-Trennung zugelassen: <ul style="list-style-type: none"> • Optionsanleihe cum Optionsschein • Doppelwährung-Optionsanleihe cum • Wandelanleihe cum OS • Zero-Optionsanleihe cum OS • Opt. Gen. Rechte cum
BUCHUNGEN/ BUCHUNGS-ZEILE	Nach Datenfreigabe der Auftragsdaten wird gleichzeitig die Anzahl der möglichen Umsätze angezeigt. Angaben zu den einzelnen Zusatzbuchungen erfolgen jeweils mit der WKN, WP-Bezeichnung und Nominale in der Buchungszeile. Diese ergeben sich automatisch aus dem Trennungsverhältnis Optionsanleihe ex-Optionsscheine und nur-Optionsscheine in Optionsanleihe-cum. Bei mehr als sechs Zusatzbuchungen wird auf diesen Sachverhalt hingewiesen. Gebuchte Depotumsätze sind vollständig in der Umsatzanzeige (KVDU) abrufbar.

ZU-GUNSTEN-KTO	Haupt- und Unterkonto des zu-Gunsten-Kontos werden automatisch durch das System analog dem Gut-Konto vorbelegt. Wird das Unterkonto des Gut-Kontos durch den Eingabe verändert, verändert sich das zu-Gunsten-Konto nicht automatisch mit. Sofern gewünscht, kann die Unterkontonummer geändert werden.
----------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(D) Abhängigkeitsprüfungen

GUT / USER-ID	Die ersten vier Stellen der Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.
WKN / SETTLEMENT-DAY	Der Settlement-Day muss innerhalb der Umtauschfrist für die eingegabene WKN liegen.

3.1.12 Erfassung Strip-Aufteilung (SA)

(A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Strip-Aufteilung kann die Trennung einer cum-Anleihe (WKN/-Cum) in die Komponenten Mantel und Kupon durchgeführt werden. Bei der Auftragserteilung ist jeweils nur die stripfähige WKN und Nominale der Cum-Anleihe vorzugeben. Die erforderlichen Zusatzbuchungen werden in CASCADE erzeugt und in T2S gebucht.

Hinweis: Während der Sperrfrist von sechs Arbeitstagen vor Zinszahlungen bzw. Rückzahlungen ist eine Strip-Aufteilung nicht möglich.

Nach Eingabe des Funktionscodes „SA“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

(B) Eingabemaske Strip-Aufteilung

```

TRAN: KVEE FC: SA SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          STRIP-AUFTEILUNG / ERFASSUNG          ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: _____      AUFTNR: _____      VWA:  GS
LAST      : _____      /
GUT       : 7926000         CBF W/OPT.TREN.U.BOND STRIPPING      /
WKN       : I _____

NOMINALE  : _____      EINHEIT  :

SET-DAY   : 20.11.2014

STRIPPING-FORM: 2

TEXT      : _____

PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch

```

(C) Felddesonderheiten

Bei der Erfassung eines Auftrages zur Strip-Aufteilung sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	„GS“ =Girosammelverwahrung
LAST	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
GUT	„7926 000“ (Abwicklungskonto CBF)
WKN-KENNUNG	„I“ änderbar in „W“
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag
STRIPPING-FORM	„2“ (Trennung cum Anleihe in Mantel/Kupons)

Neben der allgemeingültigen Felddescription (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Felddescriptionen und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Erfassung eines Auftrages zur Strip-Aufteilung folgende Felddesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 5000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
LAST	Die Kontonummern müssen nachfolgenden Kontoarten entsprechen: <ul style="list-style-type: none">• Kundenkonto nur Zentralen• Lagerstelle• Kundenkonto /Makler• internes Kundenkonto CBF Wird eine BIC eingegeben, so muss diese als T2S Party BIC für ein Konto der o.g. Kontoart in CBF hinterlegt sein.
GUT	In diesem Feld wird automatisch ein internes Konto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar.
WKN	Die WKN muss zur Strip-Aufteilung zugelassen sein. Es kann nur die CUM-WKN eingegeben werden.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

LAST/USER-ID	Die ersten vier Stellen der Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.
WKN/SETTLEMENT-DAY	Der Settlement-Day muss kleiner/gleich der möglichen Stripping-Frist sein, ab dem die eingegebene WKN aufteilbar ist.

3.1.13 Erfassung Strip-Zusammenführung (SZ)

(A) Allgemeine Beschreibung

Mit der Auftragsart Strip-Zusammenführung kann die Zusammenführung aus den Stripping-Komponenten Mantel und Kupon zur cum-Anleihe (WKN-Cum) durchgeführt werden. Bei der Auftragserteilung ist jeweils nur die gewünschte WKN und Nominale der Cum-Anleihe vorzugeben. Die erforderlichen Zusatzbuchungen werden von CASCADE erzeugt und in T2S gebucht.

Hinweis: Während der Sperrfrist von sechs Arbeitstagen vor Zinszahlungen bzw. Rückzahlungen ist eine Strip-Zusammenführung nicht möglich.

Nach Eingabe des Funktionscodes „SZ“ in das Erfassungsauswahlmenü und anschließender Datenfreigabe wird eine Maske zur Erfassung aufgerufen.

(B) Eingabemaske Strip-Zusammenführung

TRAN: KVEE FC: SZ SB:		
AUFTRAGSABWICKLUNG	STRIP-ZUSAMMENFUEHRUNG / ERFASSUNG	ERFASSUNGSSTATUS
PRIMANOTE: _____	AUFTNR: _____	VWA: GS
LAST : 7926000	CBF W/OPT.TREN.U.BOND STRIPPING	/
GUT : _____		/
WKN : I _____		
NOMINALE : _____	EINHEIT :	
SET-DAY : 20.11.2014		
STRIPPING-FORM: 2		
TEXT : _____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch		

(C) Feldbesonderheiten

Bei der Einzelerfassung eines Auftrages zur Zusammenführung einer Anleihe sind folgende Felder als Mussfelder definiert worden, d. h. hier ist eine Eingabe erforderlich:

Feld	Vorbelegt mit:
AUFTNR	
VWA	„GS“ = Girosammelverwahrung
LAST	„7926 000“ (Abwicklungskonto CBF)
GUT	Banknummer des erfassenden Kunden der CBF
WKN-KENNUNG	„I“ änderbar in „W“
	Vorbelegt mit:
NOMINALE	
SET-DAY	Nächster Bankarbeitstag

Neben der allgemeingültigen Felddescription (vgl. Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Felddescriptionen und Formalprüfungen](#)) gelten bei der Erfassung eines Auftrages zur Strip-Zusammenführung folgende Feldbesonderheiten:

AUFTNR	Die eingegebene Auftragsnummer muss kleiner als 5000000 sein. Die Auftragsnummer muss zudem eindeutig sein, d. h. vom Teilnehmer darf im Erfassungs- bzw. Auftragsstatus kein Auftrag mit gleicher AUFTNR existieren.
GUT	Die Kontonummern müssen nachfolgenden Kontoarten entsprechen: <ul style="list-style-type: none">• Kundenkonto nur Zentralen• Lagerstelle• Kundenkonto/Makler• Internes Kundenkonto CBF Wird eine BIC eingegeben, so muss diese als T2S Party BIC für ein Konto der o.g. Kontoart in CBF hinterlegt sein.
LAST	In diesem Feld wird automatisch ein internes Konto der CBF vorbelegt und ist nicht veränderbar.
WKN	Die WKN muss zur Strip-Zusammenführung zugelassen sein. Es kann nur die CUM-WKN eingegeben werden.

(D) Abhängigkeitsprüfungen

GUT/USER-ID	Die ersten vier Stellen der Banknummer müssen mit den ersten vier Stellen der USER-ID übereinstimmen.
WKN/SETTLEMENT-DAY	Der Settlement-Day muss größer/gleich dem Stripping-Datum sein, ab dem die eingegebene WKN zusammenführbar ist.

3.2 Auftragsbearbeitung im Erfassungsstatus (EA)

3.2.1 Änderung von Aufträgen (EA)

Ein Auftrag kann im Erfassungsstatus nur dann geändert werden, wenn er *noch nicht kontrolliert* oder wenn er bei der Kontrolle als *fehlerhaft* gekennzeichnet wurde. Es können sowohl bereits vorhandene Daten durch Überschreiben der alten Feldinhalte geändert als auch neue Daten durch Füllen leerer Felder hinzugefügt werden.

Unter dieser Transaktion werden auch die im Auftragsstatus zur Änderung markierten und daraufhin in den Erfassungsstatus generierten Aufträge bearbeitet.

```

TRAN: KVEA FC:      SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG      A E N D E R U N G / L O E S C H U N G      ERFASSUNGSSTATUS
                           G I R O B E R E I C H

AN  AENDERUNG EINES AUFTRAGES      : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
AT  AENDERUNG EINER TEFRA-D FREIGABE : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
AF  AENDERUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE

LN  LOESCHUNG EINES AUFTRAGES      : ..... (AUFTRAGS-NUMMER)
LF  LOESCHUNG FEHLERHAFTER AUFTRAEGE

KV0013F Feld muß einen der angezeigten Auswahlcodes enthalten
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

Folgende Funktionen sind möglich:

„AF“	Änderung fehlerhafter Aufträge
„AT“	Änderung einer TEFRA D Freigabe
„AN“	Änderung eines einzelnen Auftrages

3.2.1.1 Änderung fehlerhafter Aufträge (AF)

(A) Allgemeine Beschreibung

Mit dem Einstieg „AF“ werden alle vom Kontrolleur als fehlerhaft gekennzeichneten Aufträge angezeigt.

Zunächst erfolgt die tabellarische Kurzanzeige aller fehlerhaften Aufträge. Diese sind sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung.

Hier können nur die *buchungsrelevanten Felder* wiedergegeben werden. Mit Ausnahme des Feldes KZ sind alle Felder gesperrt, d. h. in dieser Kurzanzeige kann *nicht geändert* werden.

(B) Tabellarische Anzeige/Änderung Erfassungsstatus

TRAN: KVEA FC: AF SB:						
AUFTRAGSABWICKLUNG		AUFTRAEGE / AENDERUNG GIROBEREICH			ERFASSUNGSSTATUS	
KZ	PRIM	AUFTNR	LAST	GUT	WKN	NOMINALE
.		7321962	7930	6789	DE0005003211	200
.	1	45	7930	5678	DE0005003211	50

SEITE 1
GEGENWERT

PF3: VERARBEITUNG PF4: ABRUCH

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion des Auftrages zur Vollanzeige
„X“	Selektion des Auftrages zur Änderung

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an. Da es sich bei allen Aufträgen um fehlerhafte Aufträge handelt, wird das Kennzeichen immer leer angezeigt.

Es ist jeweils nur *ein* „I“ bzw. *ein* „X“ auf einer Maskenseite erlaubt, d. h. es können nicht gleichzeitig mehrere Aufträge zur Vollanzeige selektiert werden.

„X“ und „I“ dürfen auch nicht miteinander kombiniert werden.

Der einzige Unterschied zwischen „X“ und „I“ besteht darin, dass man nach „I“ nicht ändern kann, während man nach „X“ den Auftrag in der Vollanzeige ändern darf.

Zur Änderung wird der gewünschte Auftrag durch Eingabe eines „X“ in der Spalte KZ der entsprechenden Zeile ausgewählt.

Nach Datenfreigabe werden dem Benutzer *alle bisher gespeicherten Daten* des Auftrages angezeigt.

(D) Vollanzeige/Änderung WP-Übertrag

TRAN: KVEA FC: AN SB: 000001723##			
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / AENDERUNG	ERFASSUNGSSTATUS	
PRIMANOTE: 256	AUFTNR: 1723	VWA: GS GS,	TR: _
LAST : 7931000	HANDELSBANK AG	/ BANKDEFFXXX	
GUT : 7930000	TESTBANK AG	/ TESTDEFFXXX	
WKN : I DE0007236101	SIEMENS AG NA		
NOMINALE : 1.000	EINHEIT: ST	DISPO-PRIORITAET: _	
GEGENWERT: _____	WRG : _____	PARTY-HOLD (J/B/C/N) : N	
DCA/REF: _____		EMISS-EINF (J/N) : N	
SET-DAY : 08.01.2020	EX-TRD : _____	BATM/ADEA (J/N) : N	
BOERSENPL: _____	OPT-OUT: _	CLRNG PL :	
SCHLUSSTAG: 07.01.2020	REFERENZ-NR : _____		
KURS / WRG: _____	AUFTRAGS-REFERENZ: _____		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF8:Vor			

In dieser *Vollanzeige* können jetzt die vorgesehenen *Änderungen* eingegeben werden. Neben der Prüfung, ob alle Mussfelder vorhanden sind, werden die Eingaben auf formale Richtigkeit und auf gültige Abhängigkeiten zueinander geprüft. Es werden dieselben Folgemasken und Plausibilitäten wie in der Erfassung angewandt.

Nach der Verarbeitung mit PF3 kehrt das System zur tabellarischen Kurzanzeige zurück, in der der Benutzer den nächsten zu ändernden Auftrag auswählen kann. Nach der Änderung eines fehlerhaften Auftrages wird dieser Auftrag aus der tabellarischen Anzeige entfernt, da er jetzt nicht mehr als fehlerhaft gilt. Sind alle fehlerhaften Aufträge abgearbeitet, kehrt das System automatisch in die Menümaske zurück.

3.2.1.2 Änderung eines Auftrages über die Auftragsnummer (AN)

(A) Allgemeine Beschreibung

Kennt der Benutzer die Auftragsnummer des zu ändernden Auftrages, steigt er mit dem Transaktionscode KVEA und dem Funktionscode „AN“ sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erfolgt die Vollanzeige *aller bisher gespeicherten Daten* dieses Auftrages.

Unter der Funktion „AN“ sind folgende Aufträge änderbar:

- Ein noch nicht kontrollierter Auftrag
- Ein in der Kontrolle als fehlerhaft markierter Auftrag
- Ein aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag

3.2.2.1 Löschung fehlerhafter Aufträge (LF)

(A) Allgemeine Beschreibung

Mit dem Einstieg „LF“ werden alle vom Kontrolleur als fehlerhaft gekennzeichneten Aufträge angezeigt.

Zunächst erfolgt die tabellarische Kurzanzeige aller fehlerhaften Aufträge. Diese sind sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung.

Hier können nur die *buchungsrelevanten Felder* wiedergegeben werden. Mit Ausnahme des Feldes KZ sind alle Felder gesperrt. Nur hier in der Kurzanzeige können Aufträge gelöscht, d. h. *Löschkennzeichen* in den entsprechenden Zeilen gesetzt werden.

(B) Tabellarische Anzeige/Löschung Erfassungsstatus

TRAN: KVEA FC: LF SB:									
AUFTRAGSABWICKLUNG			AUFTRAEGE / LOESCHUNG GIROBEREICH				ERFASSUNGSSTATUS		
KZ	PRIM	AUFTNR	LAST	GUT	WKN	NOMINALE	SEITE 1		GEGENWERT
—		7644962	7930	6789	DE0005003211	200			
—	1	45	7930	5678	DE0005005432	50			

PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige
„X“	Löschung des Auftrages

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische anzeige

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an. Da es sich bei allen Aufträgen um fehlerhafte Aufträge handelt, wird das Kennzeichen immer leer angezeigt.

Es darf jeweils nur *ein* „I“ auf einer Maskenseite eingegeben werden, da nur ein Auftrag zur Vollanzeige selektiert werden kann.

„X“ und „I“ dürfen nicht miteinander kombiniert werden. Es ist jedoch möglich, mehrere Aufträge auf einer Seite mit „X“ zur Löschung zu kennzeichnen.

3.2.2.2 Löschung eines Auftrages über die Auftragsnummer (LN)

(A) Allgemeine Beschreibung

Kennt der Benutzer die Auftragsnummer des zu löschenden Auftrages oder der TEFRA D Freigabe, steigt er mit dem Transaktionscode KVEA und dem Funktionscode „LN“ sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erfolgt die tabellarische Kurzanzeige der buchungsrelevanten Daten dieses Auftrages.

Im Unterschied zur Änderung eines einzelnen Auftrages wird bei der Löschung über den Einstieg „LN“ die tabellarische Form des Auftrages angezeigt, da nur dort das *Löschkennzeichen* gesetzt werden kann.

Unter „LN“ können folgende Aufträge gelöscht werden:

- Ein noch nicht kontrollierter Auftrag
- Ein in der Kontrolle als fehlerhaft markierter Auftrag

3.2.3 Information Erfassungsstatus (EI)

(A) Allgemeine Beschreibung

Im Informationsdienst des Erfassungsstatus können sich die Teilnehmer über selbst eingestellte Aufträge informieren. Es besteht *nicht* die Möglichkeit, von hier aus zu ändern oder zu löschen.

Der Informationsdienst bietet folgende Möglichkeiten:

- Anzeige des Bearbeitungszustandes eines Auftrages (nicht kontrolliert/fehlerhaft)
- Tabellarische Kurzanzeige mehrerer Aufträge
- Vollanzeige eines Auftrages mit allen erfassten Informationen
- Online Druck mit allen erfassten Informationen zu einem Auftrag

(B) Auswahlmaske Information/Erfassungsstatus

```
TRAN: KVEI FC:      SB: #####
AUFTRAGSABWICKLUNG          I N F O R M A T I O N          ERFASSUNGSSTATUS
AA  ALLE AUFTRAEGE
AF  ALLE FEHLERHAFTEN AUFTRAEGE
NR  AUFTRAGS-NUMMER   : _____      EINGEBER: _____
PN  PRIMANOTEN-NUMMER : _____
LK  LASTSCHRIFT-BANK  : _____
GK  GUTSCHRIFT-BANK   : _____
ZUSAETZLICHE AUSWAHL - WKN : _ _____
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

(C) Mögliche Funktionen

„AA“ = Alle Aufträge

„AF“ = Alle Fehlerhaften Aufträge

Zusätzliche Eingaben sind zu den folgenden Funktionen erforderlich:

„NR“ = Auftrags-Nummer

„PN“ = Primanoten-Nummer

„LK“ = Lastschrift-Bank

„GK“ = Gutschrift-Bank

Zusätzliche Eingaben zur Eingrenzung der Auswahl:

Mit der Zusatzeingabe im Feld „WKN“ wird die Auswahl nochmals eingegrenzt.

Bei allen Abfragen in den einzelnen Funktionscodes erfolgt *zuerst* eine tabellarische Anzeige aller mit dem Funktionscode übereinstimmenden Aufträge. Angezeigt wird immer der aktuelle Zustand des Auftrages, da im Erfassungstatus keine Historie geführt wird.

Bereits kontrollierte Aufträge sind aus dem Erfassungsbestand des Eingebers in die Auftragsdatenbank der CBF übergegangen und werden im Informationsdienst des Erfassungstatus nicht mehr angezeigt.

Das Kennzeichen in der ersten Spalte (KZ) gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages an.

Möglicher Bearbeitungsstatus:

„“ = Nicht kontrollierter Auftrag

„F“ = Fehlerhafter Auftrag

„A“ = Aus dem Auftragsstatus zum Ändern generiert

„L“ = Aus dem Auftragsstatus zum Löschen generiert

Hinweis:

Beim Einstieg über den Funktionscode „AF“ (fehlerhafte Aufträge) werden alle Aufträge mit dem Bearbeitungszustand „“ angezeigt, der in diesem speziellen Fall für fehlerhafte Aufträge steht.

Mit der Eingabe der Funktion „AA“ wird eine tabellarische Auswahl angeboten.

(D) Auswahlmaske Information/Tabellarische Anzeige Aufträge

```
TRAN: KVEI FC: AA SB: W##
AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / INFORMATION          ERFASSUNGSSTATUS
                               SEITE 1
K PRIM    AUFTNR LAST  GUT WKN          NOMINALE          GEGENWERT
-   1     4444444 6789 7930 DE0007664000          500
-   444   1234567 6789 7930 DE0007664000          10
-   0     1000309 7930 5678 DE0008474041       1.000.000
-   999   1001222 5678 7930 DE0007463861       2.000.000

GESAMTSUMMEN ANZAHL AUFTRAEGE:      4      3.000.510

PF3:Rücksprung  PF4:AbbruchEingebbares Kennzeichen (KZ):
```

„I“ = Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit „I“ überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, ggf. über mehrere Masken (für bestimmte Auftragsarten).

(E) Vollanzeige von Aufträgen/Information Erfassungsstatus

TRAN: KVEI FC: NR SB: 0007592212			
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / INFORMATION	ERFASSUNGSSTATUS	
PRIMANOTE:	AUFTNR: 7592212	VWA: GS	TR:
LAST : 7930000	TESTBANK AG	/ TESTDEFFXXX	
GUT : 7931000	HANDELSBANK AG	/ BANKDEFFXXX	
WKN : I DE0005000941	MNO AKTIEN		
NOMINALE : 2.700	EINHEIT: ST	DISPO-PRIORITAET:	
GEGENWERT:	WRG :	PARTY-HOLD (J/B/C/N) : N	
DCA/REF :		EMISS-EINF (J/N) : N	
SET-DAY : 08.01.2020	EX-TRD :	BATM/ADEA (J/N) : N	
BOERSENPL:	OPT-OUT:	CLRNG PL :	
SCHLUSSTAG: 07.01.2020	REFERENZ-NR :		
KURS / WRG:	AUFTRAGS-REFERENZ:		
PF2:Druck PF3:Ruecksprung PF4:Abbruch			

Von der Vollanzeige aus kann mittels PF2 ein *Online Druck* des angezeigten Auftrages erfolgen. Wenn die Vollanzeige sich über mehrere Masken erstreckt, werden alle Maskeninhalte ausgedruckt, unabhängig davon, in welcher Maske der Online Druck initiiert wurde.

3.3 Kontrolle (EK)

Um die erfassten Aufträge und TEFRA D Freigaben verbindlich an die CBF zu erteilen, muss das **Vier-Augen-Prinzip gewahrt** werden, d. h. die vom Erfasser in das System eingegebenen Aufträge werden von einer zweiten Person kontrolliert. Vom System wird sichergestellt, dass der Kontrolleur ein vom Erfasser abweichendes ID-KZ hat.

Die Kontrolle bietet folgende Möglichkeiten:

- Kontrolle über Vollanzeige
- Kontrolle über tabellarische Kurzanzeige

Die Bank muss im Rahmen der Security-Angaben entscheiden, über welches Verfahren ihre Kontrolleure Aufträge kontrollieren sollen.

```

TRAN: KVEK FC:      SB: #####I#

AUFTRAGSABWICKLUNG          K O N T R O L L E          ERFASSUNGSSTATUS
                              GIROBEREICH

VOLLANZEIGE                  TABELLARISCHE KURZANZEIGE

VA  ALLE AUFTRAEGE          TA  ALLE AUFTRAEGE
VN  AUFTRAGS-NUMMER : _____ TN  AUFTRAGS-NUMMER : _____
VP  PRIMANOTEN-NUMMER : _____ TP  PRIMANOTEN-NUMMER : _____
VL  LASTSCHRIFT-BANK : _____ TL  LASTSCHRIFT-BANK : _____
VG  GUTSCHRIFT-BANK : _____ TG  GUTSCHRIFT-BANK : _____

                                ZUSAETZLICHE AUSWAHL - WKN : I _____

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch

```

Zusätzliche Eingaben sind zu den folgenden Funktionen erforderlich:

„VN“ / „TN“	Auftrags-Nummer
„VP“ / „TP“	Primanoten-Nummer
„VL“ / „TL“	Lastschrift-Bank
„VG“ / „TG“	Gutschrift-Bank

Zusätzlich ist die Eingabe einer Wertpapierkennung bei allen Funktionscodes erlaubt und bewirkt die Einschränkung der zu bearbeitenden Aufträge auf eine bestimmte Gattung.

3.3.1 Kontrolle über die Vollanzeige (EK)

(A) Allgemeine Beschreibung

Ausgehend von der Hauptauswahl gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes „EK“ in das Menü Kontrolle.

Kontrolle über Vollanzeige bedeutet, dass dem Kontrolleur alle zu den eingegebenen Auswahlkriterien gefundenen Aufträge (sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung) hintereinander mit *allen gespeicherten Daten* angezeigt werden. So hat er die Möglichkeit, alle Daten eines Auftrages zu überprüfen. Erst auf der letzten Seite eines Auftrages erscheint das Feld für das Kontrollkennzeichen.

Die verschiedenen Funktionscodes für die Vollanzeige unterscheiden sich lediglich im Umfang der ausgewählten Aufträge.

Hinweis: Angabe der Primarnoten-Nummer „0“ bei Einstieg mit dem Funktionscode „VP“ bedeutet, dass alle Aufträge angezeigt werden, die keiner Primarnote zugeordnet sind.

Innerhalb eines Auftrages, der über mehrere Seiten geht, bewegt sich der Kontrolleur mit PF8 vorwärts bzw. mit PF7 rückwärts. Wenn er auf der letzten Seite das Kontrollkennzeichen setzt, drückt er PF3 zur Verarbeitung. Es folgt die erste Seite des nächsten zu kontrollierenden Auftrages.

(B) Vollanzeige eines zu kontrollierenden Auftrages

TRAN: KVEK FC: VN SB: 000001723##			
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / KONTROLLE	ERFASSUNGSSTATUS	
PRIMANOTE: 256	AUFTNR: 1723	VWA: GS GS,	TR:
LAST : 7931000	HANDELSBANK AG	/ BANKDEFFXXX	
GUT : 7930000	TESTBANK AG	/ TESTDEFFXXX	
WKN : I DE0007236101	SIEMENS AG NA		
NOMINALE : 1.000	EINHEIT: ST	DISPO-PRIORITAET:	
GEGENWERT:	WRG :	PARTY-HOLD (J/B/C/N): N	
DCA/REF :		EMISS-EINF (J/N): N	
SET-DAY : 08.01.2020	EX-TRD :	BATM/ADEA (J/N): N	
BOERSENPL:	OPT-OUT:	CLRNG PL :	
SCHLUSSTAG: 07.01.2020	REFERENZ-NR :		
KURS / WRG:	AUFTRAGS-REFERENZ:		
PF2:Druck PF4:Abbruch PF8:Vor			

Erste Folgemaske:

```
TRAN: KVEK FC: VN SB: 000001723#I#  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG          WP-UEBERTRAG / KONTROLLE-2          ERFASSUNGSSTATUS  
  
          PRIMANOTE: 256          AUFTNR:          1723          WKN: I DE0007236101  
  
UEB-GRUND  :  
  
EXT SET-DAY:          RUECKUEBERTRAG (J/N)      : N  
ALREADY MATCHED (J/ ) :          PARTIAL SETTL INDICATOR:  
ISO TRANSACTION CODE :          BENE-IND (J/N)      :  
  
BELEGSCHAFT-SP: N          SP-DATUM:  
KUPONINFO/RECORD-DATE:  
  
TEXT:  
  
PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

Zweite Folgemaske:

```
TRAN: KVEK FC: VN SB: 000001723#I#  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG          WP-UEBERTRAG / KONTROLLE FOLGE          ERFASSUNGSSTATUS  
  
          PRIMANOTE: 256          AUFTNR:          1723          WKN: I DE0007236101  
  
SETTL PARTY - LIEFERER  
P1: BANKDEFFXXX DAKV7931000  
P2:  
P3:  
P4:  
P5:  
  
SETTL PARTY - EMPFAENGER  
P1: TESTDEFFXXX DAKV7930000  
P2:  
P3:  
P4:  
P5:  
  
KONTROLLKENNZEICHEN: _  
  
PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„K“	Der Auftrag ist kontrolliert und wird nach PF3 als verbindlicher Auftrag an die Clearstream Banking AG, Frankfurt übergeben.
„F“	Der Auftrag ist fehlerhaft und verbleibt im Erfassungsstatus.
„“	Der Auftrag ist noch nicht kontrolliert.

(C) Abhängigkeitsprüfungen und Feldeingabemöglichkeiten

Im Feld „Kontrollkennzeichen“ (KZ) wird der Bearbeitungsstatus des Auftrages angezeigt.

Mögliche Bearbeitungsstatus:

„“	Nicht kontrollierter Auftrag
„F“	Fehlerhafter Auftrag
„A“	Aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag
„L“	Aus dem Auftragsstatus zur Löschung generierter Auftrag

Einziges eingabefähiges Feld auf der letzten Seite eines Auftrages ist das Kontrollkennzeichen.

Nach betätigen der PF3 Taste wird die erste Seite des nächsten Auftrages mit einer Verarbeitungsbestätigung für den vorherigen Auftrag angezeigt:

(D) Vollanzeige WP-Übertrag / Setzen Kontrollkennzeichen

```
TRAN: KVEK FC: VG SB: 7930#I#  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / KONTROLLE      ERFASSUNGSSTATUS  
PRIMANOTE:              AUFTNR:      1111      VWA: GS  GS,      TR:  
  
LAST      : 7931000      HANDELSBANK AG      / BANKDEFFXXX  
GUT      : 7930000      TESTBANK AG      / TESTDEFFXXX  
WKN      : I DE0008404005 ALLIANZ SE VNA O.N.  
  
NOMINALE :      1.000      EINHEIT: ST      DISPO-PRIORITAET:  
GEGENWERT:      91.500,00      WRG      : EUR      PARTY-HOLD (J/B/C/N): N  
DCA/REF:      EMISS-EINF (J/N): N  
  
SET-DAY   : 08.01.2020      EX-TRD   :      BATM/ADEA (J/N): N  
BOERSENPL:      OPT-OUT:      CLRNG PL :  
  
SCHLUSSTAG: 07.01.2020      REFERENZ-NR      :  
KURS / WRG:      AUFTRAGS-REFERENZ:  
  
PF2:Druck  PF4:Abbruch  PF8:Vor
```

```

TRAN: KVEK FC: VG SB: 7930#I#

AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / KONTROLLE-2      ERFASSUNGSSTATUS
                          PRIMANOTE:          AUFTNR:      1111      WKN: I DE0008404005

UEB-GRUND  :

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

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

TEXT:

PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor

```

```

TRAN: KVEK FC: VG SB: 6662#I#

AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / KONTROLLE FOLGE      ERFASSUNGSSTATUS
                          PRIMANOTE:          AUFTNR:      1111      WKN: I DE0008404005

SETTL PARTY - LIEFERER
P1: BANKDEFFXXX DAKV7931000
P2:
P3:
P4:
P5:

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: TESTDEFFXXX DAKV7930000
P2:
P3:
P4:
P5:

KONTROLLKENNZEICHEN: _

PF2:Druck  PF3:Verarbeitung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück

```

3.3.2 Kontrolle über die tabellarische Kurzanzeige (EK)

(A) Allgemeine Beschreibung

Ausgehend von der Hauptauswahl gelangt man durch Eingabe des Funktionscodes „EK“ in das Menü Kontrolle.

Kontrolle über tabellarische Kurzanzeige bedeutet, dass dem Kontrolleur alle zu den eingegebenen Auswahlkriterien gefundenen Aufträge (sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung) in tabellarischer Form angezeigt werden. Diese Form der Kontrolle ist angebracht, wenn die *buchungsrelevanten Daten* der Aufträge für die Kontrolle ausreichen. Auf einer Seite der tabellarischen Kurzanzeige können die Aufträge dann entweder als Einzel- oder Blockkontrolle freigegeben werden.

Die verschiedenen Funktionscodes für die tabellarische Kurzanzeige unterscheiden sich lediglich im Umfang der ausgewählten Aufträge.

Hinweis: Angabe der Primanoten-Nummer „0“ bei Einstieg mit dem Funktionscode „TP“ bedeutet, dass alle Aufträge angezeigt werden, die keiner Primanote zugeordnet sind.

In der tabellarischen Kurzanzeige werden die selektierten Aufträge sortiert nach Datum und Uhrzeit der Erfassung zur Verfügung gestellt.

Im Feld „Kontrollkennzeichen“ (KZ) wird der Bearbeitungszustand des Auftrages angezeigt:

„“	Nicht kontrollierter Auftrag
„F“	Fehlerhafter Auftrag
„A“	Aus dem Auftragsstatus zur Änderung generierter Auftrag
„L“	Aus dem Auftragsstatus zur Löschung generierter Auftrag

Mögliche Kontrollvorgänge:

- Einzeln (Kennzeichen vor jedem einzelnen Auftrag) oder
- Als Block (Kontrollkennzeichen am Ende der angezeigten tabellarischen Auswahl)

kontrolliert werden. Der Kontrolleur kann beide Möglichkeiten mischen, d. h. er kann eine Seite als Block und die nächste Seite mit Einzelkontrollen abarbeiten.

Eingabefähige Felder auf dieser Maske sind die Kontrollkennzeichen am Anfang jeder Zeile der Tabelle (für die *Einzelkontrolle*) sowie das Kontrollkennzeichen unterhalb der Tabelle (für die *Blockkontrolle*).

(B) Tabellarische Anzeige der zu kontrollierenden Aufträge

TRAN: KVEK FC: TA SB:							
AUFTRAGSABWICKLUNG				AUFTRAEGE / KONTROLLE		ERFASSUNGSSTATUS	
							SEITE 1
KZ PRIM	AUFTNR	LAST	GUTO	WKN	NOMINALE	GEGENWERT	
—	1275921	7930	4567	DE0005000908	1.500	450.100,00	
—	234	453	7930	6789	DE0005003002	200	
—		75922	7930	5678	DE0004895132	50,876	
KONTROLLKENNZEICHEN: _							
PF3:VERARBEITUNG PF4:ABBRUCH PF8:VOR							

Eingebbare Zeilenkennzeichen:

„K“	Der Auftrag ist kontrolliert und wird nach PF3 als verbindlicher Auftrag an CBF übergeben.
„I“	Vollanzeige eines einzelnen Auftrages zur Information
„F“	Der Auftrag ist fehlerhaft und verbleibt im Erfassungsstatus.
„ “	Der Auftrag ist noch nicht kontrolliert.

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur *ein* „I“ eingeben. Außerdem darf „I“ nicht mit anderen Eingaben kombiniert werden, z. B. mit einem „F“ in einer Zeile oder einem „K“ im Kennzeichen Gesamtkontrolle. Es ist jedoch möglich, ein „I“ einzugeben, wenn beim ersten Einstieg in die tabellarische Anzeige ein bereits als fehlerhaft gekennzeichnete Auftrag mit „F“ erscheint und somit überschrieben wird.

Jedoch können *mehrere Aufträge* der Tabelle mit „F“ bzw. „K“ gekennzeichnet werden, d. h. diese beiden Eingaben sind miteinander kombinierbar.

Werden in den einzelnen Zeilen Aufträge mit „K“ gekennzeichnet, darf das Kennzeichen Gesamtkontrolle nicht gesetzt werden.

Einzige Eingabemöglichkeit für das Kennzeichen Gesamtkontrolle ist „K“ für Kontrolle aller Aufträge dieser Seite. Einzelne Aufträge kann man von dieser Kontrolle ausnehmen, indem man sie in der Zeile mit „F“ kennzeichnet.

Eingebbares Kontrollkennzeichen:

„K“	Alle Aufträge dieser Seite (mit Ausnahme der mit „F“ gekennzeichneten) sind damit kontrolliert und werden nach PF3 verbindlich an die Clearstream Banking AG übergeben.
-----	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

3.3.3 Kombination Einzelkontrolle/Blockkontrolle

In bestimmten Fällen können sowohl in den Zeilenkennzeichen als auch im Kennzeichen Blockkontrolle Eingaben gemacht werden.

Will der Benutzer auf einer Seite nur einen Posten kontrollieren, dann setzt er vor dem gewünschten Auftrag ein „K“.

Will er auf einer Seite einen Posten als fehlerhaft kennzeichnen, während alle anderen Posten kontrolliert werden sollen, setzt er vor dem fehlerhaften Auftrag ein „F“ und in das Kontrollkennzeichen unter der Tabelle ein „K“.

Soll auf einer Seite ein Auftrag als unkontrolliert stehen bleiben, während alle anderen Aufträge kontrolliert werden können, so muss er vor jedem kontrollierten Auftrag ein „K“ setzen, während das Kontrollkennzeichen des unkontrollierten Auftrages leer bleibt.

Nach PF3 blättert das System auf die nächste Seite der tabellarischen Anzeige mit weiteren zu kontrollierenden Aufträgen. Auf dieser Seite wird die Verarbeitung der vorherigen Seite bestätigt. Wenn PF3 auf der letzten Seite gedrückt wird, kehrt das System zum Menü der Kontrolle zurück und gibt ebenfalls eine Verarbeitungsbestätigung aus.

Jeder mit „F“ gekennzeichnete Auftrag bleibt im Erfassungsstatus stehen und muss vom Erfasser mit dem Vorgang „Änderung im Erfassungsstatus (EA)“ berichtigt werden. Alle kontrollierten Aufträge werden verbindlich an die CBF übergeben.

Nach erfolgter Kontrolle werden verschiedene Verarbeitungsschritte angestoßen, die im Rahmen des Übergangs vom Erfassungs- in den Auftragsstatus durchlaufen werden müssen und am Ende dieses Kapitels beschrieben sind.

3.4 Auftragsbearbeitung im Auftragsstatus (AA)

3.4.1 Markierung zur Änderung (MA)

(A) Allgemeine Beschreibung

Auch Aufträge, die bereits an T2S übermittelt und parallel in den CASCADE-Auftragsbestand übergeleitet wurden, können unter bestimmten Voraussetzungen noch geändert werden. Dies gilt auch für Match-Instruktionen. Match-Instruktionen frei von Zahlung, die durch die Nutzung des Match-Service als „Passiv Matcher“ für ein betroffenes Konto systemseitig generiert wurden, können nicht zur Auftragsbearbeitung markiert werden.

Änderungen sind jedoch nicht direkt im Auftragsstatus möglich. *Die Aufträge werden im Auftragsstatus nur markiert und damit in den Erfassungsstatus überführt.* Dieses Verfahren ist notwendig, um auch für Änderungen im Auftragsstatus das Vier-Augen-Prinzip sicherzustellen. Änderungen können nur vom Eingebener vorgenommen werden.

Folgende Schritte laufen dabei ab:

1. Markierung des zu ändernden Auftrages im Auftragsstatus
2. Markierung zur Löschung in T2S, Herausnahme des markierten Auftrages aus dem Auftragsstatus und Ablegen in die Historie des Auftragsstatus
3. Generierung des markierten Auftrages in den Erfassungsstatus
4. Änderung des generierten Auftrages im Erfassungsstatus
5. Kontrolle des geänderten Auftrages im Erfassungsstatus
6. Übergang des geänderten Auftrages aus dem Erfassungsstatus in den Auftragsstatus als Neuauftrag und Übermittlung an T2S

Eine Änderung von bereits gematchten Aufträgen ist nur möglich, wenn der Konrahent für die Gegeninstruktion ebenfalls eine Löschanfrage gestellt hat (siehe Kapitel [3.4.3](#)).

Eine Ausnahme stellen die Änderung des Partial Settlement Indicators und der Dispositions-Priorität (siehe Kapitel [3.4.2](#)) sowie das Hinzufügen und Entfernen von Verlinkungen (siehe Kapitel [3.4.4](#)) dar. Diese Änderungen können direkt im Auftragsstatus vorgenommen werden. Ein Vier-Augen-Prinzip kommt hierfür nicht zu Tragen.

```
TRAN: KVAA FC:      SB: #####
AUFTRAGSABWICKLUNG      A E N D E R U N G / L O E S C H U N G      AUFTRAGSSTATUS
MA  MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR AENDERUNG
ML  MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR LOESCHUNG
AA  AENDERUNG EINES AUFTRAGES FUR PARTIAL
    SETTLE.INDICATOR UND DISPO-PRIORITAET
                                         AUFTRAGS-NUMMER      : .....
LM  LOESCHEN MASCHINELL ERZEUGTER AUFTRAEGE
                                         AUFTRAGS-NUMMER      : .....
                                         AUFTRAGSURSPRUNG     : ...
                                         EINGEBER              : ....
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

*** „LM“ kann nur von CBF genutzt werden.

Um einen Auftrag zur Änderung markieren zu können, muss dessen Auftragsnummer bekannt sein. Der Benutzer steigt also mit dem Transaktionscode KVAA und dem Funktionscode „MA“ sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erscheint die tabellarische Anzeige des ausgewählten Auftrages.

(B) Tabellarische Anzeige/Markierung zur Änderung

TRAN: KVA A FC: MA SB: 000107779											
AUFTRAGSABWICKLUNG					AUFTRAEGE / MARKIERUNG			AUFTRAGSSTATUS			
LAST-KTO: 7930 000								SEITE	1		
K	M	S	D	AA	SA	AUFTNR	GUT	WKN	NOMINALE	GEGENWERT	SET-D
_	0	4	01	3		107779	7399	DE0009225401	20.354.980		19.11
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch											

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion des Auftrages zur Vollanzeige
„X“	Markierung des Auftrages zur Änderung
„B“	Markierung des Auftrages zur beidseitigen Änderung (nur für „Already matched“ Aufträge)

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es kann nur ein Auftrag mit „I“, „X“ oder „B“ gekennzeichnet werden.

(D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus

Wird vor dem Auftrag im Feld KZ ein „I“ eingegeben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller gespeicherten Daten dieses Auftrages, ggf. über mehrere Masken (bei bestimmten Auftragsarten).

Das Verzweigen in die Vollanzeige/Information kann notwendig werden, wenn die tabellarische Information nicht ausreicht.

Mit PF3 kehrt man in die tabellarische Kurzanzeige zurück.

(E) Markierung zur Änderung

In der tabellarischen Kurzanzeige wird der Auftrag mit einem „X“ bzw. einem „B“ zur Änderung markiert.

Nach Bestätigung der Markierung mit PF3 springt das System in das Menü der Änderung/Löschung zurück und gibt dort eine Verarbeitungsbestätigung aus.

Der markierte Auftrag wird in T2S und im CASCADE-Auftragsbestand gelöscht. Außerdem werden Datum, Uhrzeit, Terminal und User-ID der Markierung in CASCADE festgehalten. Der Auftrag ist im Informationsdienst des Auftragsstatus als historischer Auftrag abrufbar.

Anschließend wird der markierte Auftrag in den Erfassungsstatus des Eingebers generiert. Dort kann er dann geändert werden. Nach erfolgter Kontrolle wird er als Neuauftrag nach T2S übermittelt und parallel in den Auftragsstatus der CBF übernommen.

Hinweis: Bei einer Änderung darf nicht die AUFTRAGS-REFERENZ der ursprünglichen Instruktion wiederverwendet werden, da die geänderte Instruktion andernfalls von T2S abgelehnt wird.

3.4.2 Änderung von Partial Settl. Indicator, Dispo-Priorität und TIN (AA)

(A) Allgemeine Beschreibung

Für Aufträge, die bereits an T2S übermittelt und parallel in den CASCADE-Auftragsbestand übergeleitet wurden, können der Partial Settlement Indicator und die Dispositions-Priorität direkt im Auftragsstatus geändert werden. Dies gilt auch für Match-Instruktionen.

Bei Aufträgen für Börsengeschäfte kann die Tax Identification Number im Feld „TIN“ geändert werden für Aufträge, die aufgrund von fehlender, falsch formatierter oder falscher TIN abgelehnt wurden.

(B) Tabellarische Anzeige/Änderung von Partial Settl. Indicator, Dispo-Priorität und TIN

TRAN: KVAA FC: MA SB: 000107779											
AUFTRAGSABWICKLUNG				AUFTRAEGE / MARKIERUNG				AUFTRAGSSTATUS			
LAST-KTO: 7930 000								SEITE	1		
K	M	S	D	AA	SA	AUFTNR	GUT	WKN	NOMINALE	GEGENWERT	SET-D
_	0	4	01	3		449311	7930	DE0008032004	4.000		07.02
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch											

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion des Auftrages zur Vollanzeige
„X“	Markierung des Auftrages zur Änderung
„B“	Markierung des Auftrages zur beidseitigen Änderung (nur für „Already matched“ Aufträge)

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es kann nur ein Auftrag mit „I“, „X“ oder „B“ gekennzeichnet werden.

(D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus

Wird vor dem Auftrag im Feld KZ ein „I“ eingegeben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller gespeicherten Daten dieses Auftrages, ggf. über mehrere Masken (bei bestimmten Auftragsarten).

Das Verzweigen in die Vollanzeige/Information kann notwendig werden, wenn die tabellarische Information nicht ausreicht.

Mit PF3 kehrt man in die tabellarische Kurzanzeige zurück.

(E) Vollanzeige von Aufträgen/Änderung

TRAN: KVA A FC: AA SB: 000449311			
AUFTRAGSABWICKLUNG		WP-UEBERTRAG / AENDERUNG	AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR	:	449311	
LAST	:	7931 000	HANDELSBANK AG / BANKDEFFXXX
GUT	:	7930 000	TESTBANK AG / TESTDEFFXXX
WKN	:	I DE0008032004 COMMERZBANK AG O.N.	
NOMINALE	:	4.000	EINHEIT: ST DISPO-PRIORITAET: 4 NOR
GEGENWERT	:	40.000,00	WRG : EUR VWA : GS SVG
DCA/REF	:		EMISS-EINF: N
SET-DAY	:	08.01.2020	EX-TRD : BATM/ADEA : N
BOERSENPL	:		OPT-OUT: CLRNG PL :
			TIN :
MATCH-STATUS	:	02 AUFTRAG BESTAETIGT MIT GEGENAUFTRAG NUMMER 0000013	
PRTYHLD-STATUS	:	0 FREIGEgeben	
DISPO-STATUS	:	4 OFFEN, DA KEIN AUSREICHENDER BESTAND	
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF5:Status PF8:Vor			

Auf Seite eins kann folgendes Feld bearbeitet werden:

DISPO-PRIORITAET	Es ist eine Änderung von „4 – Normal“ auf „3 – Hoch“ und umgekehrt möglich. Siehe auch Kapitel 1.3.3 Dispositionsprioritäten .
TIN	<p>Das TIN-Feld wird nur für non-CCP- Börsengeschäfte verwendet. Es ist nur editierbar, wenn der Auftrag aufgrund einer fehlenden, falsch formatierten oder falschen TIN abgelehnt wurde.</p> <p>Da die TIN für den Kunden und die Gegenpartei benötigt wird, muss ein Kennzeichen eingegeben werden, um den Käufer (/CTX/) bzw. den Verkäufer (/TAX/) zu identifizieren.</p> <p>Die 16-stellige TIN kann nach der folgenden Definition eingegeben oder geändert werden:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Käufer (GUT-BANK)→ /CTX/TIN (Beispiel /CTX/MSTMXA93L41F205F); oder - Verkäufer (LAST-BANK)→ /TAX/TIN (Beispiel /TAX/MSTMXA90L01F205F). <p>Es ist wichtig, dass vor und nach dem Kennzeichen "CTX" und "TAX" ein Schrägstrich eingefügt wird und die TIN ohne führendes Leerzeichen eingegeben wird. Sobald der Kunde die TIN eingegeben hat, wird der Auftrag erneut validiert. Nur wenn die TIN-Validierung erfolgreich durchgeführt wurde, wird die Instruktion zur weiteren Validierung an T2S übermittelt.</p> <p>Instruktionen, die für das TIN-Verfahren recycelt werden, können nicht gleichzeitig für den OTC-Recycling-Service berücksichtigt werden. CBF legt fest, dass nach der Erstellung der Instruktion durch SET1 in einem ersten Schritt die TIN-Validierung durchgeführt wird.</p> <p>Die Instruktion wartet auf die TIN Informationen, bevor sie an T2S weitergeleitet wird.</p>

Mit PF3 erfolgt die Verarbeitung, mit PF5 können Statusinformationen zum Auftrag angezeigt werden (keine Änderungen möglich) und mit PF8 kann auf Seite zwei gewechselt werden.

```

TRAN: KVA A FC: AA SB: 000449311

AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / AENDERUNG      AUFTRAGSSTATUS

AUFTNR:      449311      WKN: I DE0008032004

T2S ACTOR BIC: BANKDEFFXXX      T2S ACTOR REF      : ABC123456789012
MITI REF      : 123456789012345
REFERENZ-NR      :      AUFTRAGS-REFERENZ: ABC123456789012
ALREADY MATCHED(J/ ) :      PARTIAL SETTL IND: NPAR      BENE-IND:
ISO TRANSACTION CODE : TRAD      REASON CODE      : LACK
T2S ACCEPTED : 03.05.2019 12:34:56 T2S MATCHED      : 03.05.2019 13:45:00
SCHLUSSTAG      : 03.05.2019      KURS / WRG      :
EXT SET-DAY      :
UEB-GRUND      :
URSPR-NOM      :      RUECKUEBERTRAG      : N      TR:
BELEGSCHAFTS-SP: N      SP-DATUM      :
KUPONINFO/RECORD-DATE:

TEXT:

PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF5:Status PF7:Zurück

```

Auf Seite zwei kann folgendes Feld bearbeitet werden:

PARTIAL SETTL.INDI-CATOR	<p>In diesem Feld kann angegeben werden, ob für die Instruktion eine Teilabwicklung erlaubt ist. Für mögliche Eingabewerte, siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen.</p> <p>Eine Änderung ist nicht möglich für WP-Überträge Emissionseinführung und WP-Überträge Teil-/Vollrechte.</p>
--------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

Mit PF3 erfolgt die Verarbeitung, mit PF5 können Statusinformationen zum Auftrag angezeigt werden (keine Änderungen möglich) und mit PF8 kann auf weitere Seiten (Settlement Parties und Linkages – keine Änderungen möglich) gewechselt werden.

Änderungen des Partial Settlement Indicators und der Dispositions-Priorität sind nur möglich, wenn sich zu dem entsprechenden Parameter keine vorherige Änderungsanfrage mehr in der Bearbeitung befindet.

3.4.3 Markierung zur Löschung (ML)

(A) Allgemeine Beschreibung

Auch Aufträge, die bereits an T2S übermittelt und parallel in den CASCADE-Auftragsbestand übergeleitet wurden, können unter bestimmten Voraussetzungen noch gelöscht werden. Dies gilt auch für Match-Instruktionen. Ungematchte Instruktionen können einseitig durch den Eingabe vorgenommen werden (unilaterale Löschung). Für bereits gematchte Instruktionen kann der Eingabe eine Löschanfrage stellen, diese führt jedoch erst zu einer Löschung des Auftrages, wenn auch der Kontrahent eine Löschanfrage für die Gegeninstruktion stellt (bilaterale Löschung). Für „Already matched“ Aufträge kann der Eingabe beide Seiten zur Löschung markieren. Solange eine Löschung nur einseitig angefragt ist, kann der Auftrag weiterhin zur Abwicklung gelangen. Soll dies verhindert werden, kann der Auftrag durch den Eingabe zusätzlich gesperrt werden (siehe Kapitel [3.6.1](#)).

Folgende Schritte laufen dabei ab:

1. Markierung des zu löschenden Auftrages im Auftragsstatus
2. Die Löschanfrage wird an T2S weitergeleitet.
3. Ist die Instruktion ungematcht oder handelt es sich um einen „Already matched“ Auftrag, erfolgt direkt Schritt 6.
4. Ist die Instruktion bereits gematcht, wird der Kontrahent von CASCADE und/oder T2S über die Löschanfrage informiert.
5. Stell der Kontrahent eine Löschanfrage für die Gegeninstruktion, erfolgt Schritt 6.
6. Der Auftrag wird in T2S und im CASCADE-Auftragsbestand als gelöscht markiert und kann nicht mehr zur Abwicklung gelangen.

```
TRAN: KVAA FC:      SB: #####  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG      A E N D E R U N G / L O E S C H U N G      AUFTRAGSSTATUS  
  
MA  MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR AENDERUNG  
ML  MARKIERUNG EINES AUFTRAGES ZUR LOESCHUNG  
  
AA  AENDERUNG EINES AUFTRAGES FUR PARTIAL  
    SETTL.INDICATOR UND DISPO-PRIORITAET  
  
                                AUFTRAGS-NUMMER      : .....  
  
LM  LOESCHEN MASCHINELL ERZEUGTER AUFTRAEGE  
  
                                AUFTRAGS-NUMMER      : .....  
                                AUFTRAGSURSPRUNG     : ...  
                                EINGEBER            : ....  
  
PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
```

*** „LM“ kann nur von CBF genutzt werden.

Um einen Auftrag zur Löschung markieren zu können, muss dessen Auftragsnummer bekannt sein. Der Benutzer steigt also mit dem Transaktionscode KVAA und dem Funktionscode „ML“ sowie der Auftragsnummer ein. Nach Datenfreigabe erscheint die tabellarische Anzeige des ausgewählten Auftrages.

(B) Tabellarische Anzeige/Markierung zur Löschung

TRAN: KVAA FC: ML SB: 000107779											
AUFTRAGSABWICKLUNG					AUFTRAEGE / MARKIERUNG			AUFTRAGSSTATUS			
LAST-KTO: 7930 000								SEITE	1		
K	M	S	D	AA	SA	AUFTNR	GUT	WKN	NOMINALE	GEGENWERT	SET-D
_	0	4	01	3		107779	7399	DE0009225401	20.354.980		19.11
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch											

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion des Auftrages zur Vollanzeige
„X“	Markierung des Auftrages zur Löschung
„B“	Markierung des Auftrages zur beidseitigen Änderung (nur für „Already matched“ Aufträge)

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es kann nur ein Auftrag mit „I“, „X“ oder „B“ gekennzeichnet werden.

(D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus

Wird vor dem Auftrag im Feld KZ ein „I“ eingegeben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller gespeicherten Daten dieses Auftrages, ggf. über mehrere Masken (bei bestimmten Auftragsarten).

Das Verzweigen in die Vollanzeige/Information kann notwendig werden, wenn die tabellarische Information nicht ausreicht und der Benutzer sich vergewissern will, dass er den richtigen Auftrag bearbeitet.

Mit PF3 kehrt man in die tabellarische Kurzanzeige zurück.

(E) Markierung zur Löschung

In der tabellarischen Kurzanzeige wird der Auftrag mit einem „X“ oder „B“ zur Löschung markiert.

Nach Bestätigung der Markierung mit PF3 springt das System in das Menü der Änderung/Löschung zurück und gibt dort eine Verarbeitungsbestätigung aus.

Der Status der Löschung kann im Informationsdienst des Auftragsstatus abgerufen werden. Ist die Löschung abgeschlossen, ist der Auftrag im Informationsdienst des Auftragsstatus als historischer Auftrag abrufbar. Datum, Uhrzeit, Terminal und User-ID der Lösch-Markierung sind dort festgehalten

3.4.4 Link-Dienst (AL)

(A) Allgemeine Beschreibung

Das Hinzufügen bzw. Entfernen von Verlinkungen von OTC-Geschäften mit anderen OTC-Geschäften oder nicht-CCP Börsengeschäften in GS-Wertpapieren ist über die Funktion „Linkage-Änderung CASCADE“ möglich. Verlinkungen über eine Pool-Referenz können nicht geändert werden, es ist lediglich eine Löschung der im Pool enthaltenen Instruktionen (siehe Kapitel [3.4.3](#)) und eine anschließende Neuerfassung

der WP-Überträge bzw. Match-Instruktionen ohne Pool / mit geänderten Pool-Parametern (siehe Kapitel 3.1) möglich.

Ausgehend vom Hauptauswahlmenü „Auftragsabwicklung“ erfolgt der Einstieg durch die Eingabe des Funktionscodes „AL“ in die Auswahlmaske „Link-Dienst“. Der sog. Experteneinstieg ist aus jeder beliebigen Maske über den Transaktionscode „KVAL“ möglich:

```

TRAN: KVAL FC: AL SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          L I N K - D I E N S T          AUFTRAGSSTATUS

LC  LINKAGE-AENDERUNG CASCADE
    AUFTRAGS-NUMMER          : . . . .
  
```

Hinweis: Geschäfte gegen Zahlung in Fremdwährungen sowie Geschäfte mit Kontrahent in einem T2S Out-CSD dürfen grundsätzlich mit keinen anderen Geschäften verlinkt werden, da dies zu Verarbeitungsproblemen führen kann. CBF behält sich in solchen Fällen einen manuellen Eingriff vor, um eine ordnungsgemäße Verarbeitung dieser Geschäfte zu gewährleisten. Für TEFRA D Wertpapiere darf bei Nutzung des strikten Verfahrens innerhalb der 40-tägigen Frist keine Verlinkung zwischen einer Empfangs- und Lieferinstruktion des gleichen Wertpapiers zur gemeinsamen Abwicklung vorgenommen werden, da eine Abwicklung sonst nicht möglich ist.

Mögliche Funktionen:

Der Funktionscode in Verbindung mit den Feldeingaben und deren Kombination ist im LinkDienst wie nachfolgend aufgeführt anwendbar:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
LC	Linkage-Änderung CASCADE	<i>Eingabepflichtig:</i> <ul style="list-style-type: none"> Auftrags-Nummer

(B) Tabellarische Anzeige Linkage-Änderung CASCADE (LC)

```

TRAN: KVAL FC: LC SB:

AUFTRAGSABWICKLUNG          CASCADE / LINKAGE-AENDERUNG          AUFTRAGSSTATUS

LAST-KTO: 7930                                     SEITE      1

K M S D AA  AUFTNR GUT  WKN          NOMINALE          GEGENWERT SET-D
_ 2 0 4 01  699999 5678  DE0008404005      9.000             9.000,00 12.02

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
  
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Vollanzeige des Auftrages
„X“	Vollanzeige Linkage-Änderung CASCADE für den betreffenden Auftrag
„B“	Vollanzeige Linkage-Änderung CASCADE für beide Seiten des Auftrages (nur für „Already matched“ Aufträge)

(C) Vollanzeige Linkage-Änderung CASCADE (LC)

Wird vor einer Auftrag das Feld KZ mit „X“ oder „B“ überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Vollanzeige Seite eins bis drei zu Informationszwecken wie sie im „Information zum Auftragsstatus“ (siehe Kapitel [3.4.5](#)) erläutert wird. Die Vollanzeigen werden deshalb an dieser Stelle nicht beschrieben. Seite vier zeigt bestehende Verlinkungen an und erlaubt das Hinzufügen und Entfernen von Verlinkungen.

TRAN: KVAL FC: LC SB:					
AUFTRAGSABWICKLUNG		WP-UEBERTRAG / LINKAGE-AENDERUNG		AUFTRAGSSTATUS	
AUFTNR: 6999999		WKN: I DE0008404005			
POOL REF : POOLREF123		SEQUENZ-NR : 2		POOL ZAEHLER : 5	
POOL OWNER BIC : BANKDEFFXXX					
POSN	IND	LINK-REF	LINK OWNER BIC	AEN	STATUS
AFTE	A	8639572IOP526389	BANKDEFFXXX	---	
BEFO	A	8639572IOP526777	BANKDEFFXXX	---	
WITH	A	8639572IOP526888	BANKDEFFXXX	---	
---	A	-----	-----	---	
---	A	-----	-----	---	
---	A	-----	-----	---	
---	A	-----	-----	---	
---	A	-----	-----	---	
---	A	-----	-----	---	
---	A	-----	-----	---	
PF4:Abbruch					

(E) Feldabhängigkeiten/Vollanzeige

Folgende Felder können befüllt werden:

POSN	In diesem Feld kann die Art der Verlinkung (AFTE, BEFO, WITH) eingegeben werden bzw. wird diese für vorhandene Verlinkungen angezeigt. Für Details siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
LINK-REF	In diesem Feld kann die Referenz der zur verlinkenden Instruktion (T2S Actor Reference – 16-stellig alphanumerisch) eingegeben werden bzw. wird diese für vorhandene Verlinkungen angezeigt.
LINK OWNER BIC	In diesem Feld kann der BIC11 des Besitzers der Referenz der zu verlinkenden Instruktion eingegeben werden (muss im BIC-Directory vorhanden sein) bzw. wird dieser für vorhandene Verlinkungen angezeigt. Im Falle von nicht-CCP Börsengeschäften muss hier „DAKVDEFFLIO“ eingegeben werden.
AEN	Wird ein neuer Link hinzugefügt, muss das Feld „AEN“ mit dem Wert „LNK“ gefüllt werden. Soll ein existierender Link entfernt werden, muss dieses Feld in der Zeile, in der der vorhandenen Link angezeigt wird, mit dem Wert „UNL“ gefüllt werden. Für Link-Aufträge, die sich noch in Bearbeitung befinden, ist keine Eingabe möglich. In diesem Fall wird im Feld „AEN“ die Art („LNK“ oder „UNL“) und im Feld „STATUS“ der Status („BEANTRAGT“ oder „ANGENOMMEN“) des Auftrags angezeigt.

Wird eines der Felder gefüllt, sind alle Felder in der gleichen Zeile Pflichtfelder. Nach Abschluss der Eingaben müssen diese mit PF3 bestätigt werden.

Die Felder POOL REF, SEQUENZ NR, POOL ZAEHLER und POOL OWNER BIC werden nur zu Informationszwecken angezeigt.

(F) Vollanzeige von Aufträgen: Information

Wird vor einer Auftrag das Feld KZ mit „I“ überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Vollanzeige Seite eins bis vier zu Informationszwecken wie sie im „Information zum Auftragsstatus“ (siehe Kapitel [3.4.5](#)) erläutert wird. Die Vollanzeigen werden deshalb an dieser Stelle nicht beschrieben.

3.4.5 Information zum Auftragsstatus (AI)

(A) Allgemeine Beschreibung

Im Informationsdienst für die im CASCADE Auftragsstatus befindlichen Aufträge können sich die Kunden über Aufträge informieren,

- die sie selbst in den CASCADE-Auftragsstatus eingestellt haben bzw. die über SETI in CASCADE eingestellt wurden sowie
- die von der Kontrahentenseite eingegeben wurden.

Die Informationsabfrage bietet darüber hinaus folgende Möglichkeiten:

- Kurzanzeige von Aufträgen aufgrund der angegebenen Auswahlkriterien,
- Vollanzeige eines Auftrages mit ausführlicher Statusanzeige bezüglich Matching, Settlement und Disposition,
- Online-Druck eines Auftrages mit allen Informationen.

Es ist zu unterscheiden zwischen *aktuellen* und *historischen* Aufträgen:

(B) Information Hauptauswahl Auftragsstatus

TRAN: KVAI FC: SB:					
AUFTRAGSABWICKLUNG		I N F O R M A T I O N		AUFTRAGSSTATUS	
AA	AUFTRAGSART	:		KZ-AA:
AN	AUFTRAGS-NUMMER	:			
AR	REFERENZ	:			
AD	NICHT ERFOLGREICH DISPONIERTE AUFTRAEGE				
MA	MATCH-AUFTRAEGE	: E	M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)		
MI	MATCH-INSTRUKTIONEN	: .	M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)		
AK	AUFTRAEGE KAPITALDIENSTE	TA : ...		BID	:
CI	ALLE AUFTRAEGE ZU EINER ISIN				
ZUSAETZLICHE	LASTSCHRIFT-BANK	:		WKN	: I
AUSWAHL	GUTSCHRIFT-BANK	:		SETTLEMENT-DAY	:
	GESCHAEFTSART	: .		WRG GEGENWERT	: ...
HA	HISTORISCHE AUFTRAEGE			EINGEBER	:
PF1:	HILFE	PF3:	RÜCKSPRUNG	PF4:	ABBRUCH

Mögliche Funktionscodes für aktuelle Aufträge:

Aktuelle Aufträge sind gültig an CBF erteilte Aufträge im Auftragsstatus. Diese Aufträge können anhand folgender Kriterien selektiert werden:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
AA	Alle Aufträge einer Auftragsart (nach Betätigen der PF1-Taste werden die möglichen Auftragsarten angezeigt)	<p><i>wenn AA = 01 oder 02</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein. • LAST-BANK und GUT-BANK auch beide möglich (optional) *** • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional) • WRG (optional)**** <p><i>wenn AA = 01</i> zusätzliche Auswahl möglich KZ AA:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Art eines WP-Übertrages: <ul style="list-style-type: none"> A CCP-Auftrag B Bestandsübertrag RS E Emissionseinführung RS P Depotübertrag RS W WP-Übertrag <p><i>wenn AA 02</i> zusätzliche Auswahl möglich KZ AA:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Art einer Match-Instruktion: <ul style="list-style-type: none"> A CCP-Instruktion E Emissionseinführung RS W WP-Übertrag <p>wenn AA = 03:</p> <ul style="list-style-type: none"> • entweder LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • LAST-BANK und GUT-BANK auch beide möglich (optional)*** • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional) <p>wenn AA = 07 oder 09:</p> <ul style="list-style-type: none"> • LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • LAST-BANK und GUT-BANK auch beide möglich (optional) ** • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional)*
AA		<p><i>wenn AA = 14 oder 15</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • LAST-BANK oder GUT-BANK auch beide möglich (optional)** • WKN (optional) <p>SETTLEMENT-DAY (optional)</p>

Funktionscode	Funktion	Eingaben
		<p>wenn AA = 16</p> <p>zusätzliche Auswahl möglich</p> <p>KZ AA (Kennzeichen Auftragsart):</p> <ul style="list-style-type: none"> • Art einer Einlieferung <ul style="list-style-type: none"> L Laufende Einlieferung von Einzelkunden und techn. Sammelkunden N Neuzulassung/Aufstockung von Globalkunden/ Jungscheinen V Valutierung von BIS-ZU Globalkunden <p>wenn AA = 17 oder 19:</p> <ul style="list-style-type: none"> • LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein • LAST-BANK und GUT-BANK auch beide möglich (optional) ** • WKN (optional) • SETTLEMENT-DAY (optional) <p>wenn AA = 18</p> <p>zusätzliche Auswahl möglich</p> <p>KZ AA (Kennzeichen Auftragsart):</p> <ul style="list-style-type: none"> • Art einer Einlieferung <ul style="list-style-type: none"> A Laufende Auslieferung von Einzelkunden und techn. Sammelkunden R Auslieferung Rahmenurkunde S Auslieferung stückeloser Werte

-
- **** Durch Auswahl „XXX“ im Feld „WRG GEGENWERT“ können ausschließlich Settlement Instruktionen ohne Gegenwert angezeigt werden, durch die Auswahl „YYY“ ist es möglich, sich ausschließlich Settlement Instruktionen mit Gegenwert in einer der zulässigen Fremdwährungen anzeigen zu lassen. Die Sortierfolge der Anzeige richtet sich hierbei zuerst nach der ISIN und dann nach aufsteigender Nominale.
- *** Wenn die Felder LAST-BANK und GUT-BANK entsprechend gefüllt sind, werden Ihnen im Informationsdienst auch Aufträge der Kontrahentenseite angezeigt.
- ** Das Gegenkonto entspricht jeweils einem internen Abwicklungskonto der CBF.
- * Bei AA 07 entspricht der Set-Day bis zur Freigabe durch die CBF dem Erfassungstag.

Zur Eingabe des zweistelligen Kürzels der Auftragsart bei dem Funktionscode AA kann der Benutzer die PF1-Taste drücken. Ihm werden dann zwei Masken mit den möglichen Auftragsarten, getrennt nach Giro- und Wertebereich, angezeigt:

(B1) Hilfemasken zur Erklärung für Funktionscodes AA

```

TRAN: KVAI FC:      SB: #####I####

AUFTRAGSABWICKLUNG      ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

      ANZEIGE DER MOEGLICHEN AUFTRAGSARTEN --GIROBEREICH--
01  WP-UEBERTRAG
    KZ-AA = A - CCP-AUFTRAG          03  BSV/LSV-UEBERTRAG
          = C - XEMAC-AUFTRAG        04  VERPFAENDUNG
          = E - EMISSIONSEINF. RS    05  FREIGABE
          = P - DEPOTUEBERTRAG RS    07  GBC-UMTAUSCH
          = B - BESTANDSUEBERTRAG RS 09  GBC-RUECKTAUSCH
          = L - ALLEGEMENT           11  WP-LEIHAUFTRAG
          = I - REALIGNMENT          12  WP-LEIHE/RUECKFUEHRUNG
          = R - SETTL.-RESTRICTION   13  KADI NON-INCOME
          = W - OHNE KZ-AA ARTEN     14  BOND-STRIPPING:AUFTEILUNG
02  MATCH-INSTRUKTION
    KZ-AA = A - CCP-INSTRUKTION      15  BOND-STRIPPING:ZUSAMMENFUEHRUNG
          = E - EMISSIONSEINF. RS    17  OPTIONSSCHEINTRENNUNG
          = L - ALLEGEMENT           19  OPTIONSSCHEINZUSAMMENFUEHRUNG
          = I - REALIGNMENT          99  STORNO/NACHBUCHUNG DEPOTUMSATZ
          = W - OHNE KZ-AA ARTEN

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor

```

Folgemaske Wertebereich (mehr Information zur Einlieferung ist CASCADE Handbuch Teil 3 beschrieben):

```

TRAN: KVAI FC:      SB: #####I####

AUFTRAGSABWICKLUNG      ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

      ANZEIGE DER MOEGLICHEN AUFTRAGSARTEN --WERTEBEREICH--
16  EINLIEFERUNG
    KZ-AA
      L          LFD. EINLIEFERUNG
      N          NEUZULASSUNG SAMMELURKUNDE
      V          VALUTIERUNG
      E          NEUZULASSUNG SAMMELURKUNDE EDT
      F          EINLIEFERUNG FREMDTRESOR
      B          EINLIEFERUNG SONDERVERWAHRUNG
      M          EINLIEFERUNG EDELMETALL

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück  PF8:Vor

```

Weitere Folgemaske Wertebereich (mehr Information zur Auslieferung ist CASCADE Handbuch Teil 3 beschrieben):

```

TRAN: KVAI FC:      SB: #####I####

AUFTRAGSABWICKLUNG      ERKLAERUNG FUER FUNKTIONSCODE AA      AUFTRAGSSTATUS

          ANZEIGE DER MOEGLICHEN AUFTRAGSARTEN --WERTEBEREICH--

18  AUSLIEFERUNG
    KZ-AA
    A          LFD. AUSLIEFERUNG
    R          RAHMENURKUNDE / TEILREDUZIERUNG
    S          GLOBALURKUNDE
    F          AUSLIEFERUNG FREMDTRESOR
    M          EDELMETALL
    B          SONDERVERWAHRUNG

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF7:Zurück
  
```

Funktionscode	Funktion	Eingaben
AN	Der Einzelauftrag mit der eingegebenen Auftragsnummer (es können nur eigene Aufträge angeschaut werden).	<ul style="list-style-type: none"> LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein. SETTLEMENT-DAY (optional) WKN (optional) WRG GEGENWERT (optional)
AD	Alle nicht disponierten Aufträge	<ul style="list-style-type: none"> LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein. WKN (optional) WRG GEGENWERT (optional)
AK	Aufträge aus Kapitaldiensten	<ul style="list-style-type: none"> LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein.
AR	Ermöglicht die Abfrage von Aufträgen unter Angabe der „Market Infrastructure Transaction Identification (MITI)“.	<ul style="list-style-type: none"> 16-stellige Referenz (MITI), die von T2S zum Auftrag vergeben wurde, kann erfasst werden.
MA	Alle Match-Aufträge	<ul style="list-style-type: none"> Wenn „M“, „O“ oder „F“ nicht eingegeben wird, erfolgt eine Anzeige aller matchpflichtigen Aufträge. LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein. WKN (optional) SETTLEMENT-DAY (optional) WRG GEGENWERT (optional)
MI	Alle Match-Instruktionen	<ul style="list-style-type: none"> Wenn „M“, „O“ oder „F“ nicht eingegeben wird, erfolgt eine Anzeige aller Match-Instruktionen. LAST-BANK oder GUT-BANK muss gefüllt sein. WKN (optional) SETTLEMENT-DAY (optional) WRG GEGENWERT (optional)

Hinweis: Match-Instruktionen sind nur über den Funktionscode „MI“ oder „AA“ mit Angabe der entsprechenden Auftragsart zu erreichen. Bei allen anderen Einstiegen werden nur Aufträge angezeigt.

Die Zentrale einer Bank kann sich durch Eingabe der Niederlassungs-Kontonummern auch die im Auftragsstatus vorhandenen Niederlassungs-Aufträge angezeigten lassen. Die Bank muss allerdings als Reg-Über-Teilnehmer bei der CBF zugelassen sein.

Erweiterte Optionen mit dem Feld „Geschäftsart“

Für die spezifische Auswahl von Aufträgen kann das Feld Geschäftsart wie folgt genutzt werden:

Funktionscode	Auftragsart/ Settlement-status	KZ-AA	Geschäftsart	Ergebnis
AA	01	leer	leer	Alle Lieferinstruktionen für alle Instruktionsskennzeichen
AA	01	leer	0	Alle OTC- Lieferinstruktionen
AA	01	leer	S	Alle non-CCP-Börsenlieferinstruktionen
AA	01	W	leer	Alle Lieferinstruktionen für OTC-Geschäfte mit Kennzeichen „W“ und alle Lieferinstruktionen für non-CCP-Börsengeschäfte
AA	01	W	0	Alle Lieferinstruktionen für OTC-Geschäfte mit Kennzeichen „W“
AA	01	W	S	Alle non-CCP-Börsenlieferinstruktionen
AA	02	leer	leer	Alle Erhaltinstruktionen für alle Instruktionsskennzeichen
AA	02	leer	0	Alle OTC- Erhaltinstruktionen
AA	02	leer	S	Alle non-CCP-Börsenerhaltinstruktionen
AA	02	W	leer	Alle Erhaltinstruktionen für OTC-Geschäfte mit Kennzeichen „W“ und alle Erhaltinstruktionen für non-CCP-Börsengeschäfte
AA	02	W	0	Alle Erhaltinstruktionen für OTC-Geschäfte mit Kennzeichen „W“
AA	02	W	S	Alle non-CCP-Börsenerhaltinstruktionen
AD	-	-	leer	Die schwebenden Liefer- oder Erhaltinstruktionen für das ausgewählte Last- oder / und Gut-Konto werden angezeigt
AD	-	-	0	Die schwebenden OTC-Liefer- oder Erhaltinstruktionen werden für das ausgewählte Last- oder / und Gut-Konto angezeigt

Funktionscode	Auftragsart/ Settlement-status	KZ-AA	Geschäftsart	Ergebnis
AD	-	-	S	Die schwebenden Liefer- oder Erhaltinstruktionen für non-CCP-Börsengeschäfte werden für das ausgewählte Last- oder / und Gut-Konto angezeigt
MA	M	-	leer	Alle schwebenden gematchten Lieferinstruktionen werden angezeigt
MA	M	-	0	Schwebende gematchte OTC- Lieferinstruktionen werden angezeigt
MA	M	-	S	Schwebende gematchte non-CCP-Börsen-Lieferinstruktionen werden angezeigt
MA	0	-	leer	Alle ungematchten Lieferinstruktionen werden angezeigt
MA	0	-	0	Alle ungematchten OTC-Lieferinstruktionen werden angezeigt
MA	0	-	S	Nicht anwendbar, da Börseninstruktionen immer gematcht sind
MA	F	-	leer	Alle Lieferinstruktionen mit CASCADE-Fehlercode werden angezeigt
MA	F	-	0	Alle OTC-Lieferinstruktionen mit CASCADE-Fehlercode werden angezeigt
MA	F	-	S	Alle non-CCP-Börsen-Lieferinstruktionen mit CASCADE-Fehlercode werden angezeigt
MI	M	-	leer	Alle schwebenden gematchten Erhaltinstruktionen werden angezeigt
MI	M	-	0	Schwebende gematchte OTC- Erhaltinstruktionen werden angezeigt
MI	M	-	S	Schwebende gematchte non-CCP-Börsen-Erhaltinstruktionen werden angezeigt
MI	0	-	leer	Alle ungematchten Erhaltinstruktionen werden angezeigt
MI	0	-	0	Alle ungematchten OTC-Erhaltinstruktionen werden angezeigt
MI	0	-	S	Nicht anwendbar, da Börseninstruktionen immer gematcht sind
MI	F	-	leer	Alle Erhaltinstruktionen mit CASCADE-Fehlercode werden angezeigt

Funktionscode	Auftragsart/ Settlement-status	KZ-AA	Geschäftsart	Ergebnis
MI	F	-	O	Alle OTC- Erhaltinstruktionen mit CASCADE-Fehlercode werden angezeigt
MI	F	-	S	Alle non-CCP-Börsen- Erhaltinstruktionen mit CASCADE-Fehlercode werden angezeigt

Mögliche Funktionscodes für historische Aufträge:

Soll ein aktueller Auftrag geändert oder gelöscht werden, so wird dieser im Auftragsstatus markiert und damit in den Erfassungsstatus überführt. Dadurch wird der Auftrag im Auftragsstatus ungültig. Gleichzeitig wird er als historischer Auftrag in seinem vollen Umfang und mit allen Statusausprägungen, die er zum Zeitpunkt der Markierung hatte, abgelegt.

Funktionscode	Funktion	Eingaben
HA	Anzeige aller historischen Aufträge, die am Tagesdatum abgelegt wurden	Zusätzliche Eingaben sind nicht erlaubt.

Hinweis: Die historische Anzeige erfolgt über alle Auftragsarten.

(A) Allgemeine Beschreibung

Die Maske der tabellarischen Kurzanzeige ist für alle Funktionscodes gleich. Hier werden alle selektierten Aufträge mit den *buchungsrelevanten Feldern* angezeigt. Zusätzlich werden Informationen bezüglich Match-Status („M“), Party Hold-Status („S“) und Dispositions-Status („D“) eines Auftrages angezeigt (vgl. dazu die Feldbeschreibungen im Kapitel „Hinweis“). Als weiteres Auswahlkriterium wurde die Währung Gegenwert mit EUR gewählt.

Hinweis: Wenn das Feld WRG GEGENWERT in der Auswahlmaske nicht gefüllt wird, wird keine Summenzeile ausgegeben, da für die angezeigten Aufträge Gegenwerte in unterschiedlichen Währungen existieren können.

Bei Umtauschaufträgen (AA 07), die von Seiten der Clearstream Banking AG noch nicht zur Abwicklung freigegeben worden sind, wird der Party Hold-Status („S“) mit der Ausprägung „01“ (gesperrt durch den Auftraggeber) belegt und angezeigt.

(B) Tabellarische Anzeige/Information im Auftragsstatus

```

TRAN: KVAI FC: AA SB: 01##7931#I##07.02.2017#
AUFTRAGSABWICKLUNG          AUFTRAEGE / INFORMATION          AUFTRAGSSTATUS
LAST-BANK: 7931              WRG GEGENWERT:                      SEITE 1
K M S D AA RTS  AUFTNR GUT  WKN          NOMINALE          GEGENWERT SET-D
_ 1 0 4 01 N      500 4567 DE0005758650      500              10.000,00 07.02
_ 1 0 4 01 N      504 3456 DE0005758650      5.000            40.000,00 07.02
_ 1 0 4 01 N      106 6789 DE0005878003      1.000            100.000,00 07.02
_ 1 0 4 01 N      100 5678 DE0005878003      5.000            60.000,00 07.02
_ 1 1 4 01 N     2040002 3456 DE0006283302      1.000            12.000,00 07.02
I 2 0 4 01 N      449311 7930 DE0008032004      4.000            40.000,00 07.02
_ 1 4 01          2040006 4567 DE0008404005      1              07.02
_ 1 4 01          2040008 5678 DE0008404005      1              07.02
_ 1 4 01          2040010 3456 DE0008404005      1              07.02

GESAMTSUMMEN ANZAHL AUFTRAEGE:      9          16.503
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige
„D“	Druck aller Daten des selektierten Auftrages nach Betätigung der Taste PF2

(C) Vollanzeige/Information im Auftragsstatus

Mit der Eingabe „I“ wird in die Einzelanzeige eines WP-Übertrages wie folgt verzweigt:

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 01###I##7931#11.05.2019#  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / INFORMATION      AUFTRAGSSTATUS  
  
AUFTNR      :      449311  
  
LAST        : 7931 000      HANDELSBANK AG      / BANKDEFFXXX  
GUT         : 7930 000      TESTBANK AG         / TESTDEFFXXX  
WKN         : I DE0008032004 COMMERZBANK AG O.N.  
  
NOMINALE    :          4.000      EINHEIT: ST      DISPO-PRIORITAET: 4 NOR  
GEGENWERT  :         40.000,00      WRG      : EUR      VWA      : GS SVG  
DCA/REF     :  
SET-DAY    : 08.01.2020      EX-TRD  :      EMISS-EINF: N  
BOERSENPL  :      OPT-OUT:      BATM/ADEA : N  
TIN        :      CLRNG PL  :  
  
MATCH-STATUS : 02 AUFTRAG BESTAETIGT MIT GEGENAUFTRAG NUMMER 0000013  
PRTYHLD-STATUS : 0 FREIGEgeben  
DISPO-STATUS : 4 OFFEN, GELD NICHT AUSREICHEND  
  
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF8:Vor
```

```
TRAN: KVAI FC: AA SB: 01###I##7931#11.05.2019#  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / INFORMATION-2      AUFTRAGSSTATUS  
  
AUFTNR:      449311      WKN: I DE0008032004  
  
T2S ACTOR BIC: BANKDEFFXXX      T2S ACTOR REF      : ABC123456789012  
MITI REF      : 123456789012345  
REFERENZ-NR  :      AUFTRAGS-REFERENZ: ABC123456789012      AL-  
READY MATCHED      :      PARTIAL SETTL IND: NPAR      BENE-IND:  
ISO TRANSACTION CODE : TRAD      REASON CODE      : LACK  
T2S ACCEPTED : 10.05.2019 12:34:56      T2S MATCHED      : 10.05.2019 13:45:00  
SCHLUSSTAG  : 03.05.2019      KURS / WRG      :  
EXT SET-DAY  :  
UEB-GRUND   :  
URSPR-NOM   :      RUECKUEBERTRAG : N      TR:  
BELEGSCHAFTS-SP: N      SP-DATUM      :  
KUPONINFO/RECORD-DATE:  
  
TEXT:  
  
PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück  PF8:Vor
```

```

TRAN: KVAI FC: AA SB: 01###I##7931#07.02.2017#
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / FOLGEINFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
AUFTRNR:      449311      WKN: I DE0008032004

SETTL PARTY - LIEFERER
P1: BANKDEFFXXX DAKV7931000
P2:
P3:
P4:
P5:

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: TESTDEFFXXX DAKV7930000
P2:
P3:
P4:
P5:

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück

```

```

TRAN: KVAI FC: AA SB: 01###I##7931#07.02.2017#
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / LINKAGE-INFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
AUFTRNR:      449311      WKN: I DE0008032004

POOL-REF:      SEQUENZ-NR:      POOL-ZAEHLER:
POOL OWNER BIC:

POSN  IND      LINK-REF      LINK OWNER BIC  AEN  STATUS

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF5:Info  PF7:Zurück

```

Für Informationen zur Bedeutung der angezeigten Felder, siehe Kapitel 1.4.7 [Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen](#).

Mit Betätigung der Taste PF5 wird die Maske „Status-Information“ angezeigt:

TRAN: KVAI FC: AA SB: 01###I##7931#07.01.2020#				
AUFTRAGSABWICKLUNG		WP-UEBERTRAG / STATUS-INFORMATION		AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR:	449311	WKN:	I DE0008032004	
STATUSART	AKT. STATUS	BESCHREIBUNG	BEANTR STATUS	BEARBEITUNGS STATUS
PARTY HOLD-STATUS :	0	FREIGEgeben		
NOM-TEILF: REQ:		0 URSPR:	0	REST: 0
LOESCH-STATUS :	0	KEINE LOESCHANFRAGE		
DISPO-PRIORITAET :	4	NORMALE PRIORITAET		
PARTIAL SETTL IND :	NPAR	KEIN PARTIAL SETTLEMENT		
CSD HOLD-STATUS :	0	FREIGEgeben		
CSD VALHOLD-STATUS:	0	FREIGEgeben		
	RULE-ID :			
CoSD HOLD-STATUS :	0	FREIGEgeben		
	RULE-ID1:			
	RULE-ID2:			
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch				

Die Maske wird wie folgt genutzt:

Feldname	Beschreibung
AKT.STATUS	Zeigt den gegenwärtigen Wert/Status
BESCHREIBUNG	Kurze Beschreibung des gegenwärtigen Wertes/Status. Für mögliche Ausprägungen siehe die Beschreibung des zugrundeliegenden Feldes in Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
BEANTR STATUS	Zeigt an, welcher Wert beantragt wurde. Für mögliche Ausprägungen siehe die Beschreibung des zugrundeliegenden Feldes in Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
BEARBEITUNGS STATUS	Zeigt an, in welchem Status sich der beantragte Wert befindet. Für mögliche Ausprägungen siehe die Beschreibung des zugrundeliegenden Feldes in Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
PARTY HOLD-STATUS	Zeigt den Party Hold-Status des Auftrages. Für mögliche Ausprägungen siehe in Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen . Identisch mit dem Status in Maske 1.
LOESCH-STATUS	Zeigt den Lösch-Status des Auftrages. Für mögliche Ausprägungen, siehe in Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen . Identisch mit dem Status in Maske 1.
DISPO-PRIORITAET	Zeigt die Dispositions-Priorität des Auftrages. Für mögliche Ausprägungen siehe in Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen . Identische mit der Priorität in Maske 1
PARTIAL SETTLE IND	Zeigt den Partial Settlement Indicator an. Für mögliche Ausprägungen siehe Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
CSD HOLD-STATUS	Zeigt den CSD Hold-Status des Auftrages. Für mögliche Ausprägungen siehe in Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
CSD VALHOLD-STATUS	Zeigt den CSD Validation Hold-Status des Auftrages. Für mögliche Ausprägungen siehe in Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
CoSD HOLD-STATUS	Zeigt den CoSD Hold-Status des Auftrages. Für mögliche Ausprägungen siehe in Kapitel 1.4.7 Allgemeingültige Feldbeschreibungen und Formalprüfungen .
RULE-ID	Zeigt die ID der Regel an, auf dessen Grundlage der CSD Validation-Hold gesetzt wurde.
RULE-ID1	Zeigt die ID der Regel an, auf dessen Grundlage der CoSD-Hold gesetzt wurde.
RULE-ID2	Zeigt die ID der Regel an, auf dessen Grundlage der CoSD-Hold gesetzt wurde.

Historische Aufträge

Auf der Kurzanzeige werden alle historischen Aufträge der letzten fünf Geschäftstage, die der Teilnehmer selbst zum Ändern oder Löschen markiert hat, in Kurzform angezeigt.

TRAN: KVAI FC: HA SB:						
AUFTRAGSABWICKLUNG			AUFTRAEGE / INFORMATION			AUFTRAGSSTATUS
HISTORISCHE AUFTRAEGE						SEITE 7
K AA	AUFTNR	LAST-KTO	GUT-KTO	WKN	NOMINALE	GEGENWERT
— 01	9393627	6789 000	6789 491	CH0011075394	150	
— 01	9393632	6789 000	6789 491	CH0011075394	150	
— 01	9393638	6789 000	6789 491	CH0011075394	150	
— 01	9393640	6789 000	6789 491	CH0011075394	150	
— 01	9393569	6789 491	6789 000	CH0012221716	1.000	
— 01	9393582	6789 491	6789 000	CH0012221716	1.000	
— 01	9393600	6789 491	6789 000	CH0012221716	1.000	
— 01	9393615	6789 491	6789 000	CH0012221716	1.000	
— 01	9393630	6789 491	6789 000	CH0012221716	1.000	
— 01	112	7931 000	7930 000	DE000A0Z17A1	5.000	
— 02	212	7931 000	7930 000	DE000A0Z17A1	5.000	
i 01	113	7931 000	7930 000	DE000A0Z17A1	15.000	

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

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige
„D“	Druck aller Daten des selektierten Auftrages nach Betätigung der Taste PF2

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Der Benutzer kann nur einen Auftrag für die Vollanzeige auswählen, d. h. er darf in der Spalte KZ nur ein „I“ eingeben. Außerdem darf „I“ nicht mit der Eingabe eines „D“ kombiniert werden. Die Markierung mehrerer Aufträge mit dem Kennzeichen „D“ ist zulässig.

(D) Vollanzeige von Aufträgen/Information Auftragsstatus

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit „I“ überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, über mehrere Masken.

```

TRAN: KVAI FC: HA SB: #M###I###
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / INFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR      :      9918396                      T2S-SYS-LOESCH-FRIST: 4700
LAST        : 7931 000      HANDELSBANK AG      / BANKDEFFXXX
GUT         : 7930 000      TESTBANK AG          / TESTDEFFXXX
WKN         : I DE000A0E5U85 0,59 % DEPFA FDG III 05/UND. FLR 08.06.G

NOMINALE    :          10.000      EINHEIT: EO      DISPO-PRIORITAET: 4 NOR
GEGENWERT   :                      WRG      :          VWA      : GS  SVG
DCA/REF     :                      EMISS-EINF: N
SET-DAY     : 08.01.2020      EX-TRD  :          BATM/ADEA : N
BOERSENPL   :                      OPT-OUT:          CLRNG PL  :
TIN         :                      TIN      :

MATCH-STATUS : 01 MATCHING OFFEN; KEINEN GEGENAUFTRAG GEFUNDEN
PRTYHLD-STATUS: 0 FREIGEgeben
DISPO-STATUS : 4 OFFEN, GEGENSEITE FEHLT
LOESCH-STATUS : 9 SYSTEMLOESCHUNG T2S

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch  PF8:Vor

```

```

TRAN: KVAI FC: TR SB: AN: KVAI FC: HA SB:
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / INFORMATION-2      AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR:      9918396      WKN: I DE000A0E5U85      T2S-SYS-LOESCH-FRIST: 4700
T2S ACTOR BIC: DAKVDEFFOPS      T2S ACTOR REF      : TEST-INX1
MITI REF      : 1904081322258215
REFERENZ-NR   :          AUFTRAGS-REFERENZ: TEST-INX1
ALREADY MATCHED :          PARTIAL SETTLE IND: PART      BENE-IND:
ISO TRANSACTION CODE: TRAD      REASON CODE      : CANS
T2S ACCEPTED : 07.01.2020 11:34:33 T2S MATCHED      :
SCHLUSSTAG   : 07.01.2020      KURS / WRG      :
EXT SET-DAY   :
UEB-GRUND    :          BUCH-TXT-GELD:
URSPR-NOM    :          10.000
BELEGSCHAFTS-SP: N          SP-DATUM      :
KUPONINFO/RECORD-DATE:          RUECKUEBERTRAG : N          TR:

TEXT:

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

```

Aktuelle Aufträge

Zusätzlich zu den im Erfassungsstatus eingegebenen Daten werden im Auftragsstatus Informationen bzgl. Settlement- und Dispositionsstatus sowie ggfs. Match-, Lösch- oder CSD-Fremdstatus eines Auftrages angezeigt.

Historische Aufträge

Bei der Vollanzeige eines als historisch abgelegten Auftrages wird darüber hinaus der Hinweis „ID AENDERUNG“ oder „ID LOESCHUNG“ und die User-ID des für die Markierung des Auftrages verantwortlichen Teilnehmers angezeigt.

Von der Vollanzeige aus kann mittels PF2 ein *Online-Druck* des angezeigten Auftrages erfolgen. Wenn die Vollanzeige sich über mehrere Masken erstreckt, werden alle Masken ausgedruckt, unabhängig davon, in welcher Maske der Online-Druck initiiert wurde.

Dieser Online-Druck ist sowohl für aktuelle Aufträge als auch für historische Aufträge möglich.

Neben den angezeigten Daten enthält die ausgedruckte Liste auch User-ID, Datum und Uhrzeit der Kontrolle und ggf. der Änderung oder Löschung.

Beim Online-Druck eines WP-Übertrages mit und/ohne Gegenwert, der bereits gematcht wurde, wird der Zeitpunkt des Matchings ebenfalls auf der Liste ausgewiesen.

3.5 Matching

Wertpapier-Überträge gegen/mit und ohne Zahlung sowie Zahlungen ohne Wertpapier-Übertrag (Match-Auftrag) sind vom Empfänger der Lieferung in Form einer Match-Instruktion zu bestätigen, unabhängig davon welche Auftragsseite zuerst in das CASCADE-System eingestellt wird¹⁸. Nur WP-Überträge mit dem Status „matched“ können in T2S am Settlement-Day zur Abwicklung herangezogen werden. Das Matching findet direkt statt, wenn ein erfasster und kontrollierter Wertpapier-Übertrag bzw. eine Match-Instruktion (per File Transfer, MQ, Swift) erteilte Aufträge gelten als kontrolliert) an T2S übermittelt wurden und parallel in CASCADE in den Auftragsstatus gelangen. Der Match-Status eines Auftrages kann im Informationsdienst abgefragt werden.

Das Matching erfolgt in T2S anhand von verpflichtenden, zusätzlichen und optionalen Matchkriterien nach der Kontrolle eines erfassten Auftrags.

Verpflichtende Matchkriterien:

- P1 BIC in Settlement Party – Lieferer¹⁹
- P1 BIC in Settlement Party – Empfänger²⁰
- Wertpapierkennung
- Nennwert/Nominale
- Gegenwert – nur für Aufträge gegen/mit Zahlung
- Währung – nur für Aufträge gegen/mit Zahlung
- Settlementtag
- Schlusstag (Handelstag)
- Art der Zahlung (gegen/mit Zahlung oder ohne Zahlung)²¹
- Richtung der Zahlung (Gutschrift oder Belastung) – nur für Aufträge gegen/mit Zahlung²¹
- Richtung der Wertpapierbewegung (Lieferung oder Empfang)²¹
- CSD der Lastschrift-Bank²¹
- CSD der Gutschrift-Bank²¹

Zusätzliche Matchkriterien:

- Opt-Out für einen laufenden Market Claim / Reverse Claim Prozess
- EX/CUM Kennzeichnung für Market Claim Verarbeitung

Optionale Matchkriterien:

- Referenz-Nr
- P2 in Settlement Party – Empfänger (nur BIC, DSS oder BLZ)²²
- P2 in Settlement Party – Lieferer (nur BIC, DSS oder BLZ)²²
- P1 SAC in Settlement Party – Empfänger²³

¹⁸ Non-CCp-Börsengeschäfte werden über SEIT in CASCADE bereits im Status „Already matched“ eingestellt

¹⁹ Wird in CASCADE automatisch aus LAST übernommen/abgeleitet.

²⁰ Wird in CASCADE automatisch aus GUT übernommen/abgeleitet.

²¹ Kein explizites CASCADE-Feld; wird aus den Auftragsdaten abgeleitet.

²² Eine BIC8 matched in P2 mit einer BIC11, wenn diese aus der gleichen BIC8 + XXX besteht.

Beispiel: BANKDEFF matched mit BANKDEFF und BANKDEFFXXX, aber nicht mit BANKDEFFABC.

Gilt nur, wenn die BIC8 über CASCADE gesendet wurde.

Darüber hinaus matcht eine BIC, ein DSS oder eine BLZ in P2 immer auch mit KTO, ACC und TXT.

²³ Feld wird in CASCADE automatisch befüllt, wenn das Gut-Konto mit einem 7-stellig CBF-Kundenkonto befüllt wurde.

- P1 SAC in Settlement Party – Lieferer²⁴

Die verpflichtenden Matchkriterien müssen sowohl im Auftrag als auch im Gegenauftrag gefüllt sein und die Werte müssen identisch bzw. entgegengesetzt (bei Richtung der Zahlung bzw. Wertpapierbewegung) sein, damit es zum Matching kommt. Darüber hinaus müssen die Werte in den zusätzlichen Matchkriterien übereinstimmen, sofern mindestens eine Seite das entsprechende Feld gefüllt hat. Optionale Matchkriterien können auch gegen leere Felder matchen; geben jedoch beide Seiten Werte an, so müssen diese übereinstimmen. Nur wenn alle diese Bedingungen erfüllt sind, gilt der Auftrag als „matched“.

Für den Abgleich des Gegenwertes bei Wertpapierüberträgen gegen Zahlung gelten Toleranzgrenzen (siehe nachfolgender Abschnitt). Weichen beide Gegenwerte im Rahmen der zulässigen Toleranzgrenze voneinander ab, so wird für die Geldregulierung der Gegenwert aus dem Lieferauftrag des Auftraggebers (Verkäufer) herangezogen.

Wenn die oben genannten Bedingungen für mehr als einen Gegenauftrag erfüllt sind, so matcht T2S den Auftrag und Gegenauftrag mit der geringsten Abweichung des Gegenwertes. Wenn der Auftrag keinen Gegenwert hat oder mehrere Gegenaufträge mit dem gleichen Gegenwert die Bedingungen erfüllen, so matcht T2S den Auftrag und den Gegenauftrag mit dem geringsten Zeitunterschied zwischen deren Eingangszeitpunkt in T2S.

3.5.1 Zusätzliche Kriterien für Matching

3.5.1.1 Gegenwert – Toleranzgrenzen für Wertpapierübertrag mit Gegenwert

Die bei CBF möglichen Währungen, die als Gegenwert über CASCADE instruiert werden können, stehen im CASCADE Handbuch Band 2, als Schlüsseltabelle „Währungsparameter für Gegenwerte“ zur Verfügung. Die aktuellen Toleranzgrenzen können auf der Clearstream Webseite unter [Foreign currency matching tolerance amounts](#) abgerufen werden.

3.5.1.2 Ausnahmen – Matching Wertpapierauftrag ohne Gegenwert

CASCADE bietet verschiedene Auftragsarten zur Erteilung von Wertpapierauftrag ohne Gegenwert (D-FoP). Vom FoP Matching, Eingabe eines entsprechenden Wertpapiererhalt Auftrages ohne Gegenwert (R-FoP) sind nicht alle Wertpapierüberträge dieser Auftragsart betroffen.

Nachfolgend sind die Typen von Wertpapierüberträgen ohne Gegenwert aufgeführt, die der Match-Pflicht unterliegen:

- Wertpapierübertrag ohne Gegenwert (gilt sowohl für D-FoP-Instruktionen mit Inhaberpapieren als auch für D-FoP-Instruktionen mit Namensaktien (RS), die im freien Meldebestand übertragen werden, CCP Surplus Deliveries (CASCADE-Auftragsart 01)
- Emissionseinführung RS ohne Gegenwert (CASCADE-Auftragsart 01)

Die Matchpflicht der D-FoP-Instruktion hängt dabei von der Konstellation der beteiligten CBF-Konten ab.

²⁴ Feld wird in CASCADE automatisch befüllt, wenn das Last-Konto mit einem 7-stellig CBF-Kundenkonto befüllt wurde.

Die nachfolgende Tabelle gibt einen allgemeinen und beispielhaften Überblick über matchpflichtige CBF-Konten.

Kontenbezeichnung	Kontonummer ^{a)}
Kundenkonto	XXXX 000, XXXX 901-906, XXXX 061-062 (u. a.)
Kundenkonto/Makler	XXXX 000
Nicht verkaufte Werte	XXXX 410
Equity CCP	7525 000 und 8501 000
Edelmetalle (Deutsche Börse Commodities GmbH)	7332 000
Eigenbestand Streifband	XXXX 097
Fremdbestand Streifband	XXXX 096
TEFRA D Leadmanager (nur Überträge an Dritte)	XXXX 670

a) CBF nutzt zur Bestimmung der Matchpflicht eines CBF-Kontos einen CBF-internen technischen Schlüssel. Da dieser nicht eindeutig den verschiedenen CBF-Kontonummern zugeordnet werden kann, sind in der Tabelle nur exemplarisch die häufigsten Ausprägungen genannt. Der Platzhalter XXXX entspricht dem vierstelligen CBF-Kontostamm.

Für D-FoP-Instruktionen gilt die Match-Pflicht auch für CBF-Konten zwischen Zentralen und deren Niederlassungen oder CBF-Kunden, die mehrere CBF-Kontostämme unterhalten, da hier verschiedene rechtliche Entitäten involviert sein können.

Die Match-Pflicht von D-FoP-Instruktionen hängt einerseits ab von der Match-Pflicht des im Auftrag angegebenen Last- und/oder Gut-Kontos und andererseits davon, ob es sich bei dem Wertpapierübertrag um eine D-FoP-Instruktion innerhalb eines Institutes (gleicher Kontostamm) oder einem Wertpapierübertrag zwischen zwei unterschiedlichen Instituten (unterschiedliche Kontostämme) handelt.

Generell definiert folgende Logik die Match-Pflicht einer D-FoP-Instruktion:

- Handelt es sich um eine D-FoP-Instruktion innerhalb desselben Institutes (gleicher CBF-Kontostamm), muss dieser nur dann gematcht werden, wenn beide daran beteiligten Konten matchpflichtig sind
- Handelt es sich um eine D-FoP-Instruktion zwischen zwei verschiedenen Instituten (unterschiedliche CBF-Kontostämme), muss dieser dann gematcht werden, wenn das darin angegebene GUT-Konto (Empfängerkonto der Wertpapiere) matchpflichtig ist.

3.5.1.3 Keine FoP Match-Pflicht

Sobald ein CBF-Konto in einer D-FoP-Instruktion enthalten ist, das technisch dafür aufgesetzt ist, Eurex- oder Treuhand-Sicherheiten zu verwahren, gilt keine Matchpflicht. Dasselbe gilt für die CBF-Konten 7399 000 und 7299 000 (beide lautend auf „Clearstream Banking“):

Beispiele für diese CBF-Konten:

- EUREX-Sicherheiten: XXXX 500; XXXX 501
- Treuhand-Sicherheiten: 7695 XX1 und 7697 XX1

3.5.1.4 Aktiv – Passiv Matching für FoP

Das FoP Matching wird unterstützt durch die beiden FoP Matching Dienste Aktiv- und Passiv-Matching. Der Kunde entscheidet für jedes seiner matchpflichtigen siebenstelligen CBF-Konten, welcher der beiden Dienste angewendet werden soll. Kunden erteilen CBF die Weisung zum Aktiv- und Passiv-Matching per Formular.

Kunden, die sich für Aktiv-Matching entscheiden, müssen dabei für matchpflichtige D-FoP-Instruktionen, bei denen sie als Empfänger der Wertpapiere (CASCADE: GUT) genannt sind, jeweils selbst die zugehörige R-FoP-Instruktion in CASCADE einstellen.

Für Kunden, die sich für Passiv-Matching entscheiden, generiert CBF bei Eingang einer matchpflichtigen D-FoP-Instruktion, bei dem diese Kunden als Empfänger der Wertpapiere (CASCADE: GUT) genannt sind, automatisch im Anschluss die zugehörige R-FoP-Instruktion. Dabei findet das Matching der beiden Instruktionen in T2S statt. Passiv-Matching wird ebenfalls auf Ebene des siebenstelligen CBF-Kontos beauftragt, so dass es möglich sein wird, diese Dienstleistung auch für definierte Unterkonten zu wählen.

Retail- und Wholesale FoP

Darüber hinaus ist es möglich, Aktiv- und Passiv-Matching für Retail- und Wholesalegeschäfte unabhängig voneinander zu beauftragen. Die Angabe einer Bankleitzahl (BLZ) in „SETTL PARTY - EMPFAENGER: P2“ der D-FoP-Instruktion definiert dabei ein Retailgeschäft.

3.5.2 Übersicht zum Match-Dienst (AM)

Über den „Match Dienst“ können Match-Aufträge angezeigt und ggf. als fehlerhaft gekennzeichnet werden, bei denen der jeweilige Teilnehmer des Matchdienstes als Gutschrift-Konto eingetragen ist. Zusätzlich können Match-Instruktionen angezeigt und ggf. als fehlerhaft gekennzeichnet werden, bei denen der Teilnehmer des Matchdienstes als Lastschrift-Konto eingetragen ist.

Informationen über selbst erfasste Match-Aufträge/Match-Instruktionen erfolgen nur über den Informationsdienst (KVAI).

```

TRAN: KVAM FC:      SB: ####I##19.11.2014#
AUFTRAGSABWICKLUNG      M A T C H - D I E N S T      AUFTRAGSSTATUS
SETZEN KENNZEICHEN AUF OFFENE MATCH-AUFTRAEGE ODER MATCH-INSTRUKTIONEN

MA  MATCH-AUFTRAEGE      : .  M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)
MI  MATCH-INSTRUKTIONEN : .  M/O/F (MATCHED/OFFEN/FEHLERHAFT)

ZUSAETZLICHE      BANK-NR DES KONTRAHENTEN : ....
AUSWAHL           WKN                      : I .....
                  SETTLEMENT-DAY          : 19.11.2014
                  WRG GEGENWERT           : ...

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch
    
```

Mögliche Funktionen:

„MA“	Setzen Kennzeichen zu Match-Aufträge
„MI“	Setzen Kennzeichen zu Match-Instruktionen

Zusätzliche Eingaben:

Neben dem gewünschten Funktionscode können noch zusätzliche Auswahlkriterien zur Eingrenzung der zu bearbeitenden Aufträge eingegeben werden:

Bank-Nr. des Kontrahenten

Mit einer Eingabe im Feld „Bank-Nr. des Kontrahenten“ kann eingeschränkt werden, dass nur Match-Aufträge/-Instruktionen einer bestimmten Bank angezeigt werden.

WKN

Mit der Angabe einer WKN kann beeinflusst werden, dass nur Match-Aufträge/-Instruktionen mit einer bestimmten Gattung angezeigt werden.

Settlement-Day

Mit der Angabe eines Settlement-Days kann begrenzt werden, dass nur Match-Aufträge/-Instruktionen mit dem angegebenen Settlement-Day ausgewählt werden. Wenn als Settlement-Day das laufende Datum eingegeben wurde, werden auch alle vorgetragenen Aufträge (mit Settlement-Day älter als heute) berücksichtigt.

WRG Gegenwert

Euro ist vorgebelegt. Die Eingrenzung kann auf weitere zugelassene Fremdwährungen vorgenommen werden. Durch Auswahl „XXX“ im Feld „WRG GEGENWERT“ können ausschließlich Settlement Instruktionen ohne Gegenwert angezeigt werden, durch die Auswahl „YYY“ ist es möglich, sich ausschließlich Settlement Instruktionen mit Gegenwert in einer der zulässigen Fremdwährungen anzeigen zu lassen. Die Sortierfolge der Anzeige richtet sich hierbei zuerst nach der ISIN und dann nach aufsteigender Nominale.

3.5.3 Bearbeiten offener Match-Aufträge/Match-Instruktionen (MA / MI)

Mit Eingabe des Funktionscodes „MA“ und der Angabe „0“ für "offen" gelangt man in die Maske „Match-Aufträge / Match-Dienst“, mit „MI“ und „0“ in die Maske „Match-Instruktionen / Match-Dienst“.

TRAN: KVAM FC: MA SB: M##I###										
AUFTRAGSABWICKLUNG					MATCH-AUFTRAEGE / MATCH-DIENST				AUFTRAGSSTATUS	
										WRG GEGENWERT : EUR SEITE 1
KZ	M	S	D	AUFTNR	RTS	BANK	WKN	NOMINALE	GEGENWERT	SET-D
—	01	1	1	1234567		3456	DE0005000608	1.200	24.000,24	06.02
—	01	2	1	934		6789	DE0005503451	37.750	2.000.000,00	06.02
—	03	3	1	75933		5678	DE0005006781	880	3.200,57	06.02
—	01	2	1	19789		3456	DE0005005551	700	42.000,98	06.02
—	01	1	1	22233		3456	DE0005000651	120.000	35.000.000,00	06.02
—	07	1	1	8877		6789	DE0005000701	2.000.000	800.000.000,56	06.02
—	01	3	1	122455		5678	DE0005003331	170.000	134.950.000,00	07.02
—	01	3	1	137943		4567	DE0005000661	95.150	17.322.400,77	07.02
—	01	2	1	51		5678	DE0005000651	30.000	90.000,99	07.02
—	01	1	1	256		5678	DE0005003571	4.000	160.000,44	07.02
—	08	2	1	1342		7930	DE0008404001	700	5.600,40	07.02
—	01	3	1	98765		4567	DE0005007771	1.500	14.242,00	07.02

PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF8:Vor

Bei Aufruf des Funktionscodes „MA“ mit der Angabe „0“ wird eine Maske mit allen offenen Match-Aufträgen, bei denen der Teilnehmer als Gutschrift-Konto eingetragen ist, in tabellarischer Form zur Verfügung gestellt. Daraus sind alle wichtigen Matchkriterien ersichtlich.

In der tabellarischen Anzeige kann mit PF8 vorwärts geblättert werden.

Die einzigen eingabefähigen Felder auf dieser Maske sind das Kennzeichen (KZ) und der Match-Status (M).

Der Match-Status gibt den Bearbeitungszustand des Auftrages hinsichtlich Matching an. Folgende Match-Status können bei offenen Match-Aufträgen/Match-Instruktionen auftreten:

Matching offen; kein Gegenauftrag mit übereinstimmenden Matchkriterien gefunden; mögliche Gründe:

- Es ist noch kein Gegenauftrag erfasst und an CBF oder T2S übertragen worden.
- Der Gegenauftrag ist mit abweichenden Matchkriterien erfasst worden.

Nur bei Out-CSD gematched, d.h. in T2S ist noch kein Matching erfolgt (es handelt sich hierbei lediglich um einen technischen Zwischenstatus).

Eingebbare Kennzeichen (KZ)

„F“ + Ablehnungsgrund	Ablehnung Match-Auftrag/Match-Instruktion
„I“	Vollanzeige

Kennzeichnung mit Ablehnungsgrund (F)

Wenn der Benutzer einen angezeigten Auftrag ablehnt, gibt er ein „F“ vor diesem Auftrag ein. Die Eingabe eines „F“ bedeutet, dass dieser *Auftrag als fehlerhaft zurückgewiesen* wird.

Bei Kennzeichnung mit „F“ muss auch ein *numerischer Fehlercode im Feld Match-Status* eingegeben werden, damit der Kontrahent erkennen kann, aus welchem Grund der Auftrag nicht bestätigt wurde.

Die Fehlercodes (siehe Kapitel [3.5.4](#)) gelten nur als Information und haben keine Auswirkungen auf das Matching in T2S. Soll für einen in T2S gematchten Auftrag eine Abwicklung verhindert werden, so kann eine Settlement-Sperre gesetzt werden (siehe Kapitel [3.6.1](#)) und der Auftrag zur Löschung markiert werden (siehe Kapitel [3.4.3](#)).

Kennzeichnung nur für Information (I)

Wenn dem Benutzer die angezeigten tabellarischen Informationen nicht ausreichen, gibt er im Kennzeichen ein „I“ ein, um in die Vollanzeige zu verzweigen.

Das Mischen eines „I“ mit anderen Kennzeichen ist nicht erlaubt. Es darf nur *ein* „I“ eingegeben werden, denn es können nicht gleichzeitig mehrere Aufträge zur Vollanzeige selektiert werden. Bei Eingabe eines „I“ darf keine Eingabe im Feld Match-Status erfolgen.

Aus der Vollanzeige gelangt man mit PF3 zurück in die tabellarische Anzeige im Match-Dienst.

3.5.4 Fehlerhafte Match-Aufträge/Match-Instruktionen (MA/MI)

Fehlerhafte Match-Aufträge/Match-Instruktionen erreicht man über den Funktionscode „MA“ / „MI“ und die zusätzliche Angabe „F“ für „fehlerhaft“.

3.5.4.1 Matchverarbeitung möglich

Folgenden Fehlercodes sind möglich (nur zur Information, keine Auswirkung auf das Matching in T2S):

Maske	Bedeutung
10	Zusätzliche Kontrahentenabsprache notwendig
11	Keine Instruktion durch den Endbegünstigten
12	Endbegünstigten-Instruktion lautet: „Empfang der Stücke frei“
13	Auftrag betrifft uns nicht.
20	Gegenwert außerhalb der Toleranz: zu hoch.
21	Gegenwert außerhalb der Toleranz: zu niedrig.
22	Gegenwert in falscher Währung
23	Gegenwert bereits separat verrechnet.
24	Abweichen des Settlement-Days
30	Nominalbetrag/Stückzahl unstimmig
31	Wertpapier-Nummer unstimmig
33	Lieferung unvollständig, Telefonabsprache nötig
35	Ausm. Betrag-Rücknahme außerhalb der Toleranz: zu hoch
36	Ausm. Betrag-Rücknahme außerhalb der Toleranz: zu niedrig
37	Abweichen des Rücknahmedatums
40	Endbegünstigter unbekannt bzw. nicht vorhanden
41	Original-Auftraggeber unbekannt bzw. nicht vorhanden
50	Kursangabe unstimmig
51	Schlussstag unstimmig
60	Abweichender Settlement-Markt
61	Abweichende Depotbank
62	Mögliches Duplikat
63	Abweichendes Settlement System/Period
70	Abweichende Zahlungstyp
71	Abweichende Wertpapier Richtung
72	Abweichende Geld Richtung
73	Abweichender Lieferer CSD
74	Abweichender Empfänger CSD
75	Abweichendes opt out flag

Auftrag bestätigt mit Gegenauftrag Nummer; Gegenauftrag mit übereinstimmenden Matchkriterien gefunden (in diesem Fall erhalten Match-Auftrag und Match-Instruktion diesen Status).

TRAN: KVM FC: MA SB: M##I###										
AUFTRAGSABWICKLUNG					MATCH-AUFTRAEGE / MATCH-DIENST				AUFTRAGSSTATUS	
WRG GEGENWERT : EUR SEITE 1										
KZ	M	S	D	AUFTNR	RTS	BANK	WKN	NOMINALE	GEGENWERT	SET-D
-	02	1	1	1234567		3456	DE0005000608	1.200	24.000,24	06.02
-	02	2	1	934		6789	DE0005503451	37.750	2.000.000,00	06.02
-	02	3	1	75933		5678	DE0005006781	880	3.200,57	06.02
-	02	2	1	19789		3456	DE0005005551	700	42.000,98	06.02
-	02	1	1	22233		3456	DE0005000651	120.000	35.000.000,00	06.02
-	02	1	1	8877		6789	DE0005000701	2.000.000	800.000.000,56	06.02
-	02	3	1	122455		5678	DE0005003331	170.000	134.950.000,00	07.02
-	02	3	1	137943		4567	DE0005000661	95.150	17.322.400,77	07.02
-	02	2	1	51		5678	DE0005000651	30.000	90.000,99	07.02
-	02	1	1	256		5678	DE0005003571	4.000	160.000,44	07.02
-	02	2	1	1342		7930	DE0008404001	700	5.600,40	07.02
-	02	3	1	98765		4567	DE0005007771	1.500	14.242,00	07.02

PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF8:Vor

3.5.6 Already Matched Instruktionen

Non-CCP-Börsengeschäfte werden über SETI werden im Status „already matched“ in CASCADE eingestellt.

Es gibt darüberhinaus bestimmte Konstellationen, in denen es für T2S-Teilnehmer vorteilhaft ist, für Already Matched Instruktionen unterschiedliche Settlement Parameter zu verwenden:

- Settlement Transaction Type:**
 CBF schickt den Transaction Code über ISO 15022 Nachrichten für jede Transaktionsseite an die Kunden. Beispiel: Kunden instruieren eine Already Matched Instruktion DELI mit dem Transaction Code COLO. CBF sendet beide Transaktionsseiten mit DELI COLO und RECE COLI.

ISO Transaction Code der instruierten Transaktionsseite	ISO Transaction Code der zweiten Transaktionsseite
COLI	COLO
COLO	COLI
SECL	SECB
SECB	SECL
SBBK	BSBK
BSBK	SBBK
REPU	RVPO
RVPO	REPU
TRPO	TRVO
TRVO	TRPO

- **Party hold Indicator:**

Im Falle von non-CCP-Börseninstruktionen wird der Party-Hold-Indikator über die Kontostammdaten vorgegeben.

In bestimmten Konstellationen kann es außerdem gewollt sein, dass nur eine Transaktionsseite als geblockt eingestellt werden soll.

Dazu haben ICP-Kunden die Möglichkeit, jeweils eine Seite der Transaktion zu blocken.

DCP-Kunden können aus vier Optionen wählen:

- J – Nur die instruierte Seite wird geblockt. (Code PTYH wird als „hold indicator“ an T2S geschickt)
- B – Beide Transaktionsseiten werden geblockt (Code BOTH wird als „hold indicator“ an T2S geschickt)
- C – Nur die von T2S eingestellte Gegenseite wird geblockt (Code PRCY wird als „hold indicator“ an T2S geschickt)
- N – Kein Blocken (Code FALSE wird als „hold indicator“ an T2S geschickt)

- **Modification/ Cancellation Allowed – Kennzeichen:**

Bei bestimmten Konstellationen kann es gewollt sein, dass es nur für eine Transaktionsseite erlaubt sein soll, Veränderungen oder Löschungen vorzunehmen.

DCP Kunden können dazu aus vier Optionen wählen:

- TRUE: Nur die instruierte Seite kann verändert/ gelöscht werden
- FALSE: Die instruierte Seite kann nicht verändert/ gelöscht werden, die von T2S eingestellte Gegenseite kann verändert/ gelöscht werden
- NONE: Weder die instruierte Seite noch die von T2S eingestellte Gegenseite können verändert/ gelöscht werden.
- BOTH: Beide Seiten können verändert/ gelöscht werden.

Already Matched Instruktionen im Zusammenhang mit Kapitaldiensten, die über KADI eingestellt werden, werden mit dem Modification/ Cancellation Allowed-Kennzeichen NONE eingestellt.

3.6 Settlement-Sperre/ -Freigabe

OTC-Geschäfte

CASCADE bzw. T2S bieten die Möglichkeit, einen *WP-Übertrag (mit/gegen/ohne Zahlung)* bzw. eine *Match-Instruktion* für die Abwicklung in T2S zu sperren oder freizugeben. Diese *Settlement-Sperre* wirkt sich aus, unabhängig davon, ob der betreffende Auftrag „matched“ ist oder nicht. Andererseits kann aber ein freigegebener, matchpflichtiger Auftrag nur zur Abwicklung gelangen, wenn er „matched“ ist.

Die Settlement-Sperre (Feld PARTY-HOLD) kann schon bei der Erfassung bzw. Änderung im Erfassungsstatus gesetzt werden. Wenn eine Instruktion mit einer automatisch generierten Settlement-Sperre (CoSD HOLD-STATUS) gekennzeichnet ist, kann im Änderungsmodus kein PARTY-HOLD gesetzt werden. Eine Settlement-Freigabe der Instruktion ist jedoch möglich. Durch die *Settlement-Freigabe* kann eine gesetzte Settlement-Sperre wieder aufgehoben und der gesperrte Auftrag damit für die Abwicklung freigegeben werden. Dabei kann die Freigabe auch nur für einen Teil der gesperrten Nominale erfolgen (siehe Kapitel [3.6.1.4](#)).

Settlement-Dienst im Auftragsstatus

Die Settlement-Sperre oder -Freigabe kann im Auftragsstatus über den Settlement-Dienst bis zur tatsächlichen Abwicklung erfolgen. Es können OTC-Geschäfte bearbeitet werden.

Auftraggeber- und Empfänger-Seite können nur den von ihnen selbst eingegebenen WP-Übertrag oder die Match-Instruktion sperren bzw. freigeben.

Eine Sperre durch den Auftraggeber (Eingebener) bewirkt immer die Settlement-Sperre des gesamten Auftrages.

Alle Aufträge, bei denen keine Settlement-Sperre vorliegt, können grundsätzlich zur Abwicklung gelangen.

Diese beiden genannten Möglichkeiten der Settlement-Sperre/-Freigabe ermöglichen zusammengefasst zwei unterschiedliche Arbeitsweisen der CBF-Kunden:

- Sperrung von Aufträgen bei der Erfassung; anschließend über den Settlement-Dienst (teilweise) Freigabe der Aufträge, die zur Abwicklung gelangen sollen.
- Erfassung von Aufträgen ohne Sperrung; anschließend über den Settlement-Dienst Sperrung der Aufträge, die nicht zur Abwicklung gelangen sollen.

TRAN: KVAS FC: SB: V#G#26.11.2021#M#A#E####		
AUFTRAGSABWICKLUNG	SETTLEMENT-DIENST	AUFTRAGSSTATUS
IA	INFO AUFTRAEGE : V S/F (GESPERRT/FREIGEgeben)	
II	INFO MATCH-INSTRUKTIONEN : G S/F (GESPERRT/FREIGEgeben)	
SA	SETTLEMENT-SPERRE AUFTRAG	
SI	SETTLEMENT-SPERRE MATCH-INSTRUKTION	
FA	SETTLEMENT-FREIGABE AUFTRAG	
FI	SETTLEMENT-FREIGABE MATCH-INSTRUKTION	
ZUSAETZLICHE AUSWAHL	SETTLEMENT-DAY : 26.11.2021 WKN : M A LASTSCHRIFT-BANK : E... GUTSCHRIFT-BANK : WRG GEGENWERT : ... KZ-AA : . GESCHAEFTSART : .	
PF3:Rücksprung PF4:Abbruch		

3.6.1 Sperre bzw. Freigabe von Aufträgen (SA, SI, FA, FI)

(A) Allgemeine Beschreibung

Im Rahmen der Funktion Settlement-Sperre/-Freigabe können Aufträge für die Abwicklung gesperrt bzw. freigegeben werden. Dabei gilt die Sperre solange, bis der Auftrag entweder wieder vollständig freigegeben oder aber aus dem Auftragsstatus gelöscht wird. Demgegenüber gilt ein Auftrag solange als freigegeben, bis er über den Settlement-Dienst wieder gesperrt wird bzw. abgewickelt wurde.

Hinweis:

Wenn vom Systembenutzer der SETTLEMENT-DAY mit dem Datum des Arbeitstages gefüllt wird, dann können sich unter den angezeigten Aufträgen auch Aufträge mit früherem Settlement-Day befinden, die noch gesperrt sind.

Die Kurzanzeige kann über mehrere Seiten gehen. Auf der letzten Seite werden Gesamtsummen über die Anzahl der Aufträge, Nominale und Gegenwert angezeigt.

(B) Tabellarische Anzeige

TRAN: KVAS FC: SA SB: 08.01.2020#W###7930##							
AUFTRAGSABWICKLUNG				SPERRE / SETTLEMENT-DIENST		AUFTRAGSSTATUS	
SETTLEMENT-DAY : 08.01.2020				LAST-BANK : 7930		WRG GEGENWERT : SEITE 1	
KZ	S	M D	AUFTNR	GUT-KTO	WKN	NOMINALE	GEGENWERT
—	0	02 1	1214365	4567 000	DE0009990001	10.000	2.500.000,00
—	2	12 1	1245678	4567 000	DE0009990002	200	50.000,00
—	0	01 1	7314276	5678 000	DE0009990003	7.500	1.875.000,00
—	2	01 1	123455	6789 000	DE0009990004	5.000	1.250.000,00
—	0	22 1	532305	4567 000	DE0009990005	31.500	7.875.000,00
—	2	50 1	659032	4567 000	DE0009990009	85.000	21.250.000,00
—	0	02 1	618945	6789 000	DE0009990007	100	25.000,00
GESAMTSUMMEN ANZAHL AUFTRAEGE:				7		139.300 34.825.000,00	
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch							

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige
„X“	Freigabe einer Match-Instruktion (PRTYHLD-STATUS wird auf „0“ oder „1“ gesetzt)
„T“	Teilweise Freigabe eines Wertpapier-Übertrags (PRTYHLD-STATUS wird auf „0“ gesetzt) – nur unter Funktionalität FA verfügbar. Die Bedingungen der Teilfreigabe werden in Kapitel 3.6.1.4 detailliert erläutert.
„B“	Beidseitige Freigabe einer Match-Instruktion (PRTYHLD-STATUS wird auf „0“ gesetzt) (nur für „Already matched“-Aufträge)

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es können mehrere Aufträge mit „X“ oder „B“ gekennzeichnet werden.

Es darf jedoch nur „I“ zum Verzweigen in den Informationsdienst oder „T“ für die teilweise Freigabe einer Match-Instruktion gesetzt werden.

Darüber hinaus dürfen „I“ und „T“ nicht miteinander und nicht mit „X“ oder „B“ kombiniert werden.

Der in der Kopfzeile aufgeführte SETTLEMENT-DAY sowie das LAST-/GUT-KTO gelten für alle Aufträge. Zusätzlich zu den buchungsrelevanten Feldern wird auch der Party Hold-Status des jeweiligen Auftrages angezeigt:

- Status 0 = Freigegeben
- Status 1 = Gesperrt Auftraggeber
- Status 2 = Gesperrt Empfänger
- Status 3 = Gesperrt beide Seiten

3.6.1.1 Settlement-Sperre durch den Auftraggeber/Verkäufer (SA)

Unter dem Funktionscode „SA“ werden dem Auftraggeber auf der Kurzanzeige alle WP-Überträge angezeigt, die zur Abwicklung freigegeben sind (Status = 0), und alle WP-Überträge, die vom Empfänger durch Sperren der Match-Instruktion bereits einseitig gesperrt wurden (Status = 2).

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige
„X“	Sperrung eines WP-Übertrages (PRTYHLD-STATUS wird auf „1“ oder „3“ gesetzt)
„B“	Beidseitige Sperrung einer Match-Instruktion (PRTYHLD-STATUS wird auf „3“ gesetzt) (nur für „Already matched“ Aufträge)

3.6.1.2 Settlement-Sperre durch Empfänger/Käufer (SI)

Unter dem Funktionscode „SI“ werden dem Empfänger auf der Kurzanzeige alle Match-Instruktionen angezeigt, deren Gegenaufträge zur Abwicklung freigegeben (Status = 0), und solche, die einseitig von der Gegenseite gesperrt worden sind (Status = 1).

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige
„X“	Sperrung einer Match-Instruktion (PRTYHLD-STATUS wird auf „2“ oder „3“ gesetzt)
„B“	Beidseitige Sperrung einer Match-Instruktion (PRTYHLD-STATUS wird auf „3“ gesetzt) (nur für „Already matched“ Aufträge)

3.6.1.3 Settlement-Freigabe durch Auftraggeber/Verkäufer (FA)

Unter dem Funktionscode „FA“ werden dem Auftraggeber auf der Kurzanzeige alle WP-Überträge angezeigt, die er selbst gesperrt hat (Status = 1), sowie die beidseitig gesperrten Aufträge (Status = 3).

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“=	Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige
„X“=	Freigabe eines Match-Auftrages (PRTYHLD-STATUS wird auf „0“ oder „2“ gesetzt)
„T“	Teilweise Freigabe eines Wertpapier-Übertrags (PRTYHLD-STATUS wird auf „0“ gesetzt) Die Bedingungen der Teilfreigabe werden in Kapitel 3.6.1.4 detailliert erläutert.

„B“=	Beidseitige Freigabe einer Match-Instruktion (PRTYHLD-STATUS wird auf „0“ gesetzt) (nur für „Already matched“ Aufträge)
------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

3.6.1.4 Teilweise Settlement-Freigabe durch Auftraggeber/Verkäufer (FA)

(A) Allgemeine Beschreibung

Die Funktionalität der Teilfreigabe einer Nominale in einem schwebenden Wertpapierauftrag steht nur für gesperrte Lieferinstruktionen (Auftragsart AA01: Delivery versus Payment (DvP), Delivery Free of Payment (DFoP) und Delivery with Payment (DwP)) zur Verfügung. Der Auftrag für eine Teilfreigabe kann mit der Funktion „Sperrung / Freigabe (Hold / Release)“ durch Angabe der freizugebenden Stückzahl veranlasst werden (Aufruf der Instruktionendetails in der Maske KVAS unter der Funktionalität FA über die Auswahl „T“).

Die Teilfreigabe kann ab Beginn des vorgesehenen Abwicklungstages (Intended Settlement Date, ISD), d.h. am SD-1 ab 18:45 Uhr, erfasst werden. Die Eingabe endet am Abwicklungstag um 16:00 Uhr für Lieferungen gegen oder mit Zahlung bzw. um 18:00 Uhr für Lieferungen frei von Zahlung. Auch während der „Partial Settlement Windows“ werden Teilfreigaben angenommen und abgewickelt.

Die Abwicklung der teilfreigegebenen Geschäfte erfolgt in den entsprechenden Abwicklungsfenstern („Partial Settlement Windows“), die von T2S regelmäßig aktualisiert werden. Die aktuellen Zeiten dieser Abwicklungsfenster stehen auf der Clearstream Website unter [Partial Settlement Windows](#) zur Verfügung. Über Änderungen wird CBF die Kunden vorab informieren.

Alle nicht erfolgreich abgewickelten Teilfreigaben werden am Tagesende (SD, 18:00 Uhr) zurückgenommen und das zugrundeliegende Geschäft wird solange für diese Nominale wieder gesperrt. Bei Bedarf müssen die Teilfreigaben für den nächsten vorgesehenen Abwicklungstag neu erfasst werden.

Eine Teilfreigabe, die nach dem letzten Abwicklungsfenster, aber noch vor dem Fristende für die Erfassung von Teilfreigaben erteilt wird, kann nicht mehr für diesen Abwicklungstag berücksichtigt werden und wird ebenfalls am Tagesende gelöscht.

Jede Teilfreigabe kann bis zur abschließenden Bearbeitung des Wertpapierauftrags über eine vollständige Sperrung (Maske KVAS, Funktionscode SA) zurückgezogen werden. Ist bereits eine Teilfreigabe erteilt worden und noch nicht ausgeführt, kann nicht gleichzeitig eine zweite Teilfreigabe oder eine vollständige Freigabe erfasst werden. Dazu ist es nötig, die Teilfreigabe zunächst zurückzunehmen.

Folgende Lieferungen sind von der Funktionalität der Teilfreigabe ausgenommen:

- Erhaltinstruktionen (Auswahl „T“ nicht in Maske KVAS, Funktionscode FI, verfügbar)
- Nicht vom Lieferer gesperrte Instruktionen
- Instruktionen im Recycling-Modus
- Verlinkte Instruktionen
- Instruktionen, die gegen T2S Out-CSDs aufgesetzt sind

Für alle anderen gesperrten OTC-Lieferungen sind Teilfreigaben erlaubt, so auch für:

- „already matched“-Instruktionen
- Lieferungen aus Kompensationen und Transformationen
- Lieferungen gegen Passivmatcher, wobei beim Aufsetzen der Match-Instruktion der Standardwert der erhaltenden Partei für Teilbelieferungen eingesetzt wird (Feldbelegung für PARTIAL SETTLEMENT: NPAR, PART, PARC oder PARQ); bei Bedarf kann die erhaltende Partei diesen Wert in der Match-Instruktion anpassen.

Eine Teilfreigabe kann erfasst werden, wenn die Lieferung

- eine MITI (T2S-Referenz) aufweist
- nicht einem CoSD-Hold unterliegt (z. B. bei einem Fremdwährungsgeschäft)
- den vorgesehenen Abwicklungstag (Intended Settlement Date, ISD) erreicht hat

- Partial Settlement erlaubt (PARTIAL SETTL.INDICATOR: PART, PARC oder PARQ bzw. leer für Konten, die teilweise Abwicklung grundsätzlich erlauben)
- eine größere noch zu liefernde Nominale aufweist, als freigegeben werden soll
- sowohl eine Restnominale als auch eine Nominale der Teilbelieferung aufweist, die der kleinsten übertragbaren Einheit und der mindestübertragbaren Einheit entspricht.

Die Teilfreigabe wird abgewickelt, wenn

- die Lieferung offen und gematcht ist
- der Kontrahent ebenfalls „Partial Settlement“ zulässt
- der Schwellenwert für Gegenwerte von Teilbelieferungen nicht unterschritten ist
- die Teilfreigabe T2S vor Fristende erreicht (15 Minuten Vorlaufzeit berücksichtigen).

Die Teilfreigaben in CASCADE Online unterliegen den Regeln und funktionalen Anforderungen des Vier-Augen-Prinzips. Nach erfolgreicher Eingabe und Kontrolle der gewünschten Teilnominale können die Instruktionsdetails der Teilfreigabe unter dem Transaktionscode KVAL mit Funktionscode AA abgerufen werden. In der Vollanzeige des Wertpapierübertrags sind die freigegebene Teilnominale und die ursprüngliche Nominale ersichtlich. Nicht abgewickelte Teilfreigaben werden nicht archiviert, können aber unter dem Transaktionscode KVAL mit Funktionscode HA eingesehen werden.

Vollanzeige Eingabemaske Teilfreigabe

Mit der Auswahl „T“ öffnet sich im Menü KVAS unter Funktionscode FA das Fenster mit den Instruktionsdetails, in dem die freizugebende Teilnominale erfasst werden kann:

TRAN: KVAS FC: FA SB: 08.01.2020#I##7930###			
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / AENDERUNG	AUFTRAGSSTATUS	
AUFTNR	: 5190001		
LAST	: 7930 000	TESTBANK AG	/ TESTDEFFXXX
GUT	: 7931 000	HANDELSBANK AG	/ BANKDEFFXXX
WKN	: I DE0005190003	BAY.MOTOREN WERKE AG ST	
NOMINALE	: 20	EINHEIT: ST	DISPO-PRIORITAET:
GEGENWERT:	600.000,00	WRG : EUR	VWA : GS SVG
DCA/REF :			EMISS-EINF: N
SET-DAY : 08.01.2020		EX-TRD :	BATM/ADEA : N
BOERSENPL:		OPT-OUT:	CLRNG PL :
MATCH-STATUS :	02 AUFTRAG BESTAETIGT MIT GEGENAUFTRAG NUMMER	5190002	
PRTYHLD-STATUS:	1 GESPERRT AUFTRAGGEBER		
DISPO-STATUS :	4 OFFEN WEGEN SETTLEMENT-SPERRE (LIEFERER)		
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF5:Info PF8:Vor			

TRAN: KVAS FC: FA SB: 08.01.2020#I##7930###			
AUFTRAGSABWICKLUNG	WP-UEBERTRAG / AENDERUNG-2	AUFTRAGSSTATUS	
AUFTNR: 5190001	WKN: I DE0005190003		
T2S ACTOR BIC: TESTDEFFXXX	T2S ACTOR REF : C9CG1007308C540		
	MITI REF : 1912161492509655		
REFERENZ-NR :	AUFTRAGS-REFERENZ:		
ALREADY MATCHED :	PARTIAL SETTL IND: PART	BENE-IND:	
ISO TRANSACTION CODE:	REASON CODE : PREA		
T2S ACCEPTED : 07.01.2020 07:08:04	T2S MATCHED : 07.01.2020 08:07:04		
SCHLUSSTAG : 07.01.2020	KURS / WRG :		
EXT SET-DAY :			
UEB-GRUND :		BUCH-TXT-GELD:	
URSPR-NOM :	60		
BELEGSCHAFTS-SP: N	SP-DATUM :		
KUPONINFO/RECORD-DATE:	RUECKUEBERTRAG : N	TR:	
TEXT:			
PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch PF5:Info PF7:Zurück PF8:Vor			

In den folgenden Fällen erscheint nach der Eingabe eine Warnung (*KV0140I Auftrag erfüllt nicht alle Krit. für die Teilfreigabe, Aktiv. Monitoren*), die aber durch eine zweite Verarbeitung (PF3) übersprungen werden kann:

- Kontrahenteninstruktion erlaubt keine Teilabwicklung.
- Wertpapier-Übertrag nicht gematcht.
- Kontrahenteninstruktion ist gesperrt.

Wenn der Kontrahent seine Match-Instruktion im Laufe des Abwicklungstages so anpasst, dass diese Abweichungen entfallen, kann die Teilabwicklung erfolgen. Sonst wird die Instruktion mit der Teilfreigabe am Tagesende gelöscht.

Die Freigabe erfolgt unter Wahrung des Vier-Augen-Prinzips im gleichen Menü mit dem Kontrollkennzeichen K. Mit Enter öffnet sich die Vollanzeige des Wertpapier-Übertrags, in der die freizugebende Teilnominale ersichtlich ist. Mit PF3 wird die Teilfreigabe zur Abwicklung im nächsten T2S Teilabwicklungsfenster freigegeben. Der Sperrestatus des Wertpapier-Übertrags wechselt dabei von 1 bzw. 3 (GESPERRT) zu 0 (FREIGEgeben).

Im Informationsfenster, das über die Funktionstaste PF5 aufgerufen wird, kann die Aufteilung der Nominale im Feld „NOM-TEILF“ abgerufen werden. Hierbei bedeuten:

- REQ: Nominale aller bisherigen Teilfreigaben; nur in der Lieferinstruktion zu sehen. Nach Storno einer Teilfreigabe Summe der bereits ausgeführten Teilfreigaben.
- URSPR: Von T2S bestätigte teilfreizugebende Nominale, die nach der Teilabwicklung wieder mit „0“ ausgegeben wird.
- REST: Bereits instruierte, aber noch abzuwickelnde Teilnominale, die nach der Teilabwicklung wieder mit „0“ ausgegeben wird.

```

TRAN: KVAS FC: FA SB: 08.01.2020#I##7930###
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / STATUS-INFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR:  5190001      WKN: I DE0005190003
STATUSART      AKT.      BESCHREIBUNG      BEANTR      BEARBEITUNGS
                STATUS      STATUS      STATUS      STATUS
PARTY HOLD-STATUS : 0      FREIGEGEREN      FREI      DURCHGEFUEHRT
NOM-TEILF: REQ:  20      URSPR: 20      REST: 20
LOESCH-STATUS : 0      KEINE LOESCHANFRAGE
DISPO-PRIORITAET :
PARTIAL SETTL IND : PART  PARTIAL SETTLEMENT

CSD HOLD-STATUS : 0      FREIGEGEREN
CSD VALHOLD-STATUS: 0      FREIGEGEREN
  RULE-ID :
CoSD HOLD-STATUS : 0      FREIGEGEREN
  RULE-ID1:
  RULE-ID2:

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch

```

Der Beantragungsstatus (BEANTR STATUS) zeigt hier FREI für eine Teilfreigabe an.

Diese Ansicht ist auch unter dem Transaktionscode KVAI, Funktionscode AA, verfügbar.

Alle tabellarischen Ansichten (sowohl unter den Transaktionscodes KVAS als auch KVAI) zeigen das Ursprungsgeschäft solange mit der vollen Nominale an, bis die Teilfreigabe abgewickelt ist:

```

TRAN: KVAI FC: AA SB: 01##7930#I#DE0005190003##08.01.2020#
AUFTRAGSABWICKLUNG      AUFTRAEGE / INFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
LAST-BANK: 7930      WRG GEGENWERT:      SEITE
K M S D AA RTS  AUFTNR GUT  WKN      NOMINALE      GEGENWERT SET-
_ 2 0 1 01 N   5190001 7931 DE0005190003      60      600.000,00 08.01.

PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch

```

Der Vorgang der Teilfreigabe selbst wird unter dem Transaktionscode KVAI, Funktionscode HA, dokumentiert (NOM-TEILFREIGABE:):

```

TRAN: KVAI FC: HA SB: #M###I#DE0005190003##
AUFTRAGSABWICKLUNG      WP-UEBERTRAG / INFORMATION      AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR   :   5190001                      PTYH REQ FREIG      : 7907
LAST     : 7930 000      TESTBANK AG                      / TESTDEFFXXX
GUT      : 7931 000      HANDELSBANK AG                   / BANKDEFFXXX
WKN      : I DE0005190003 BAY.MOTOREN WERKE AG ST

NOMINALE :           60      EINHEIT: ST      DISPO-PRIORITAET:
GEGENWERT:      600.000,00  WRG      : EUR      VWA      : GS  SVG
DCA/REF   :
SET-DAY   : 08.01.2020      EX-TRD  :      BATM/ADEA : N
BOERSENPL:      OPT-OUT:      CLRNG PL  :

MATCH-STATUS : 02 AUFTRAG BESTAETIGT MIT GEGENAUFTRAG NUMMER 5190002
PRTYHLD-STATUS: 1 GESPERRT AUFTRAGGEBER
DISPO-STATUS  : 4 OFFEN WEGEN SETTLEMENT-SPERRE (LIEFERER)

NOM-TEILFREIGABE: 20
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF8:Vor

```

Der Storno einer Teilfreigabe erfolgt durch eine erneute vollständige Sperrung in der Maske KVAS unter Funktionscode SA und unter Wahrung des Vier-Augen-Prinzips:

```

TRAN: KVAS FC: SA SB: 08.01.2020#I#DE0005190003#7930###
AUFTRAGSABWICKLUNG      SPERRE / SETTLEMENT-DIENST      AUFTRAGSSTATUS
SETTLEMENT-DAY : 08.01.2020  LAST-BANK : 7930  WRG GEGENWERT :      SEITE 1
KZ S  M D  AUFTNR  GUT-KTO  WKN      NOMINALE      GEGENWERT
x 0 02 1  5190001  7931 000  DE0005190003      60      600.000,00

GESAMTSUMMEN ANZAHL AUFTRAEGE:      1      60

PF3:Verarbeitung PF4:Abbruch

```

Eine erneute Teilfreigabe oder eine vollständige Freigabe eines Wertpapierübertrags kann erst erfolgen, wenn die bestehende Teilfreigabe durch das Setzen einer Sperre der verbleibenden Nominale storniert ist.

(B) Abhängigkeitsprüfungen

Folgende Felder werden bei einer Teilfreigabe geprüft:

WP-UEBERTRAG	Teilfreigabe nur für Liefer-Instruktionen erlaubt.
PRTYHLD-STATUS	Teilfreigabe nur für durch den Auftraggeber gesperrte Lieferungen erlaubt: <ul style="list-style-type: none"> • 1 GESPERRT AUFTRAGGEBER • 3 GESPERRT BEIDE SEITEN („already matched“ und gegen Passiv-matcher)
NOMINALE	(Rest-)Nominale darf nicht kleiner als „kleinste übertragbare Einheit“ sein. (Rest-)Nominale muss ein Vielfaches der „mindestübertragbaren Einheit“ sein. Teilnominale darf nicht größer als Nominale sein. Teilnominale muss größer als „0“ sein.
SET-DAY	Teilfreigabe nur erlaubt, wenn ISD erreicht ist.
MATCH-STATUS	Teilfreigabe nur für gematchte Geschäfte erlaubt. 02 AUFTRAG BESTAETIGT MIT GEGENAUFTRAG NUMMER XXXXXXX
DISPO-STATUS	Teilfreigabe nur für durch den Auftraggeber gesperrte Lieferungen (4 OFFEN WEGEN SETTLEMENT-SPERRE (LIEFERER)). Teilfreigabe nicht für Instruktionen im Recycling-Modus erlaubt (0 CBF RECYCLING). Teilfreigabe wird nur für die tatsächlich zur Verfügung stehende Stückzahl ausgeführt; auch eine Teilabwicklung mit weniger Stücken ist möglich (T2S Partial Settlement-Funktionalität).
MITI	Teilfreigabe nur für Wertpapier-Übertrage, für die eine MITI von T2S generiert wurde
PARTIAL SETTL IND	Teilfreigabe nur für Geschäfte (Wertpapier-Übertrag und Match-Instruktion), die eine Teilabwicklung erlauben: <ul style="list-style-type: none"> • leer für Konten, die das standardmäßig erlauben • PART • PARC unter Einhaltung des Schwellenwertes für den Gegenwert • PARQ unter Einhaltung des Schwellenwertes für die Mindeststückzahl
POOL	Teilfreigabe nur für nicht verlinkte Instruktionen erlaubt (Wertpapier-Übertrag und Match-Instruktion).
CSD HOLD-STATUS/CoSD HOLD-STATUS	Keine andere Sperre darf die Lieferung blockieren (0=FREIGEgeben).

Darüber hinaus müssen die Bedingungen für eine Teilabwicklung berücksichtigt werden, zum Beispiel die Schwellenwerte für teilabzuwickelnde und verbleibende Gegenwerte, so wie sie von T2S definiert sind (Threshold in cash for UNIT (Euro 10.000,00) or for FAMT (Euro 100.000,00)).

3.6.1.5 Settlement-Freigabe durch Empfänger/Verkäufer (FI)

(A) Allgemeine Beschreibung

Unter dem Funktionscode „FI“ werden dem Empfänger auf der Kurzanzeige alle Match-Instruktionen angezeigt, die er selbst gesperrt hat (Status = „2“), sowie die beidseitig gesperrten Aufträge (Status = „3“).

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit „I“ überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, ggf. über mehrere Masken (für bestimmte Auftragsarten).

(B) Vollanzeige von Aufträgen

```
TRAN: KVAS FC: SI SB: 08.01.2020#I###7930##  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION AUFTRAGSSTATUS  
  
AUFTNR : 443213  
  
LAST : 7931 000 HANDELSBANK AG / BANKDEFFXXX  
GUT : 7930 000 TESTBANK AG / TESTDEFFXXX  
WKN : I DE0008032004 COMMERZBANK AG O.N.  
  
NOMINALE : 4.000 EINHEIT: ST DISPO-PRIORITAET: 4 NOR  
GEGENWERT: 40.000,00 WRG : EUR VWA : GS SVG  
DCA/REF : EMISS-EINF: N  
SET-DAY : 08.01.2020 EX-TRD : BATM/ADEA : N  
BOERSENPL: OPT-OUT: CLRNG PL :  
  
MATCH-STATUS : 02 AUFTRAG BESTAETIGT MIT GEGENAUFTRAG NUMMER 000000011  
PRTYHLD-STATUS: 0 FREIGEgeben  
DISPO-STATUS : 1 STUECKE-DISPOSITION OFFEN  
  
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF5:Info PF8:Vor
```

```
TRAN: KVAS FC: SI SB: 06.05.2019#I###7930##  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION-2 AUFTRAGSSTATUS  
  
AUFTNR: 443213 WKN: I DE0008032004  
  
T2S ACTOR BIC: BANKDEFFXXX T2S ACTOR REF : ABC123456789012  
MITI REF : 123456789012345  
REFERENZ-NR : AUFTRAGS-REFERENZ: ABC123456789012  
ALREADY MATCHED : PARTIAL SETTL IND: NPAR BENE-IND:  
ISO TRANSACTION CODE : TRAD REASON CODE :  
T2S ACCEPTED : 10.05.2019 12:34:56 T2S MATCHED :  
SCHLUSSTAG : 03.05.2019 KURS / WRG :  
  
UEB-GRUND :  
  
TEXT:  
  
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF5:Info PF7:Zurück PF8:Vor
```

```

TRAN: KVAS FC: SI SB: 06.05.2019#I###7930##
AUFTRAGSABWICKLUNG MATCH-INSTRUKTION / FOLGEINFORMATION AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR: 443213 WKN: I DE0008032004

SETTL PARTY - LIEFERER
P1: BANKDEFFXXX DAKV7931000
P2:
P3:
P4:
P5:

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: TESTDEFFXXX DAKV7930000
P2:
P3:
P4:
P5:

PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF5:Info PF7:Zurück

```

Mit Betätigung der Taste PF5 wird die Maske „Status-Information“ angezeigt:

```

TRAN: KVAS FC: SI SB: 08.01.2020#I###7930##
AUFTRAGSABWICKLUNG MATCH-INSTRUKTION / STATUS-INFORMATION AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR: 443213 WKN: I DE0008032004

STATUSART AKT. BESCHREIBUNG BEANTR BEARBEITUNGS
STATUS STATUS STATUS STATUS
PARTY HOLD-STATUS : 0 FREIGEGEREN
NOM-TEILF: REQ: 0 URSPR: 0 REST: 0
LOESCH-STATUS : 0 KEINE LOESCHANFRAGE
DISPO-PRIORITAET : 4 NORMALE PRIORITAET
PARTIAL SETTL IND :

CSD HOLD-STATUS : 0 FREIGEGEREN
CSD VALHOLD-STATUS: 0 FREIGEGEREN
RULE-ID :
CoSD HOLD-STATUS : 0 FREIGEGEREN
RULE-ID1:
RULE-ID2:

PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

```

Die Feldbeschreibungen entsprechen denen der Maske „Status Information“ in KVAI/AA, siehe Information zum Auftragsstatus (AI).

Folgende Funktionen stehen zur Verfügung:

Funktionscode	Funktion	Eingaben
IA / II	Informationsanzeige, WP-Überträge/Match-Instruktionen	<p><i>Eingabepflichtig:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • „S“ für gesperrt • „F“ für freigegeben • SETTLEMENT-DAY • LAST-BANK oder GUT-BANK (je nach Funktionscode) muss mit dem Teilnehmerkonto gefüllt sein • WKN (optional) • LAST-BANK und GUT-BANK auch zusammen möglich (optional)
SA	OTC-Geschäfte: Vom <i>Auftraggeber</i> nicht gesperrte WP-Überträge können gesperrt werden.	<p><i>Eingabepflichtig:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • SETTLEMENT-DAY • LAST-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • GUT-BANK (optional) <p><i>Eingabepflichtig:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • SETTLEMENT-DAY • LAST-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • GUT-BANK (optional)
SI	OTC-Geschäfte: Vom <i>Empfänger</i> nicht gesperrte Match-Instruktionen können gesperrt werden.	<p><i>Eingabepflichtig:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • SETTLEMENT-DAY • GUT-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • LAST-BANK (optional) <p><i>Eingabepflichtig:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • SETTLEMENT-DAY • GUT-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • LAST-BANK (optional)
FA	OTC-Geschäfte: Vom <i>Auftraggeber</i> gesperrte WP-Überträge können (teilweise) freigegeben werden.	<p><i>Eingabepflichtig:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • SETTLEMENT-DAY • LAST-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • GUT-BANK (optional) <p><i>Eingabepflichtig:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • SETTLEMENT-DAY • LAST-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • GUT-BANK (optional)

Funktionscode	Funktion	Eingaben
FI	OTC-Geschäfte: Vom <i>Empfänger</i> gesperrte Match-Instruktionen können freigegeben werden.	<i>Eingabepflichtig</i> <ul style="list-style-type: none"> • SETTLEMENT-DAY • GUT-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • LAST-BANK (optional) <i>Eingabepflichtig:</i> <ul style="list-style-type: none"> • SETTLEMENT-DAY • GUT-BANK = Teilnehmerkonto • WKN (optional) • LAST-BANK (optional)

Im Settlement-Dienst hat der User somit die Möglichkeit:

- Sich über gesperrte/freigegebene WP-Überträge bzw. Match-Instruktionen zu informieren,
- WP-Überträge bzw. Match-Instruktionen für die Abwicklung zu sperren sowie
- WP-Überträge bzw. Match-Instruktionen für die Abwicklung (teilweise) freizugeben.

3.6.2 Informationen

3.6.2.1 Gesperrte und freigegebene Aufträge (IA / II)

Nachfolgend sollen die Informationsmöglichkeiten über gesperrte/freigegebene Aufträge im Rahmen des SETTLEMENT-DIENSTES vorgestellt werden.

(A) Allgemeines

Alle den Auswahlkriterien entsprechenden Aufträge (WP-Überträge oder Match-Instruktionen) werden in Kurzform angezeigt.

Hinweis:

Wenn vom Systembenutzer der SETTLEMENT-DAY mit dem Datum des Arbeitstages gefüllt wird, dann können sich unter den angezeigten Aufträgen auch Aufträge mit früherem Settlement-Day befinden, die noch gesperrt sind.

Die Kurzanzeige kann über mehrere Seiten gehen. Auf der letzten Seite werden Gesamtsummen über die Anzahl der Aufträge, Nominale und Gegenwert angezeigt.

(B) Tabellarische Anzeige aller Geschäfte

TRAN: KVAS FC: II SB: #19.11.2014#W###7930##							
AUFTRAGSABWICKLUNG		INFORMATION / SETTLEMENT-DIENST				AUFTRAGSSTATUS	
SETTLEMENT-DAY : 18.11.2014		GUT-BANK : 7930		WRG GEGENWERT :		SEITE 1	
KZ	S	M D	AUFTNR	LAST-KTO	WKN	NOMINALE	GEGENWERT
—	2	10	1456789	6789 000	DE0004895131	2.500.350,525	2.334.180,55
—	2	21	2234543	6789 000	DE0009996002	100.000	1.307.125,85
—	3	30	214365	6789 000	DE0009992003	200	105.000,00
—	2	31	123455	6789 000	DE0009991004	10.000	2.500.000,50
—	3	33	854721	6789 000	DE0004999996	125.460,175	117.932,41
—	3	10	590760	6789 000	DE0004903207	44.800,500	43.904,49
—	3	51	136238	6789 000	DE0009990005	1.000.000	22.500.000,00
—	2	10	298705	6789 000	DE0009993001	550	482.931,50
GESAMTSUMMEN		ANZAHL AUFTRAEGE:		8		3.781.361,200	29.391.075,30
PF3:VERARBEITUNG PF4:ABBRUCH							

Eingebbares Kennzeichen (KZ):

„I“	Selektion eines Auftrages zur Vollanzeige
-----	-------------------------------------------

(C) Feldabhängigkeiten/Tabellarische Anzeige

Es ist nur *ein* KZ „I“ auf einer Maskenseite erlaubt, d. h. es können nicht gleichzeitig mehrere Aufträge zur Vollanzeige selektiert werden.

Der in der Kopfzeile aufgeführte SETTLEMENT-DAY sowie das LAST-/GUT-KTO gelten für alle Aufträge. Zusätzlich zu den buchungsrelevanten Feldern wird auch der Party Hold-Status des jeweiligen Auftrages angezeigt:

- Status 0 = Freigegeben
- Status 1 = Gesperrt Auftraggeber
- Status 2 = Gesperrt Empfänger
- Status 3 = Gesperrt beide Seiten

Durch die Settlement-Sperre bzw. Freigabe (vgl. unten) wird der Status verändert.

Wird vor einem Auftrag das Feld KZ mit „I“ überschrieben, erfolgt nach Datenfreigabe die Anzeige aller erfassten Felder, ggf. über mehrere Masken (für bestimmte Auftragsarten).

(D) Vollanzeige eines Auftrages im Settlementdienst

```
TRAN: KVAS FC: II SB: F#08.01.2020#I###7931##  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION AUFTRAGSSTATUS  
  
AUFTNR : 8219467  
  
LAST : 7201 000 CLEARSTREAM BANKING S.A.,LUXEMBOURG / CEDELULLXXX  
GUT : 7931 000 HANDELSBANK AG / BANKDEFFXXX  
WKN : I DE0001135424 2,5 % BUNDANL.V. 10/21 04.01.G  
  
NOMINALE : 5.000.000 EINHEIT: EO DISPO-PRIORITAET: 4 NOR  
GEGENWERT: 4.982.061,64 WRG : EUR VWA : GS STV  
DCA/REF : EMISS-EINF: N  
SET-DAY : 08.01.2020 EX-TRD : BATM/ADEA : N  
BOERSENPL: OPT-OUT: CLRNG PL :  
  
MATCH-STATUS : 01 MATCHING OFFEN; KEINEN GEGENAUFTRAG GEFUNDEN  
PRTYHLD-STATUS : 0 FREIGEgeben  
DISPO-STATUS : 1 STUECKE-DISPOSITION OFFEN  
  
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF5:Info PF8:Vor
```

```
TRAN: KVAS FC: II SB: F#08.01.2020#I###7931##  
  
AUFTRAGSABWICKLUNG MATCH-INSTRUKTION / INFORMATION-2 AUFTRAGSSTATUS  
  
AUFTNR: 8219467 WKN: I DE0001135424  
  
T2S ACTOR BIC: T2S ACTOR REF : ABC123456789012  
MITI REF : 123456789012345  
REFERENZ-NR : AUFTRAGS-REFERENZ: ABC123456789012  
ALREADY MATCHED : PARTIAL SETTL IND: NAPR BENE-IND:  
ISO TRANSACTION CODE : TRAD REASON CODE :  
T2S ACCEPTED : 07.01.2020 12:34:56 T2S MATCHED :  
SCHLUSSTAG : 07.01.2020 KURS / WRG :  
  
UEB-GRUND : BUCH-TXT-GELD:  
  
TEXT:  
  
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF5:Info PF7:Zurück PF8:Vor
```

```

TRAN: KVAS FC: II SB: F#08.01.2020#I###7931##
AUFTRAGSABWICKLUNG MATCH-INSTRUKTION / SETL.PTY-INFORMATION AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR: 8219467 WKN: I DE0001135424

SETTL PARTY - LIEFERER
P1: CEDELULLXXX DAKV7201000
P2:
P3:
P4:
P5:

SETTL PARTY - EMPFAENGER
P1: BANKDEFFXXX DAKV7931000
P2:
P3:
P4:
P5:

PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch PF5:Info PF7:Zurück

```

Mit Betätigung der Taste PF5 wird die Maske „Status-Information“ angezeigt:

```

TRAN: KVAS FC: II SB: 08.01.2020#I###7930##
AUFTRAGSABWICKLUNG MATCH-INSTRUKTION / STATUS-INFORMATION AUFTRAGSSTATUS
AUFTNR: 443213 WKN: I DE0008032004

STATUSART AKT. BESCHREIBUNG BEANTR BEARBEITUNGS
STATUS STATUS STATUS STATUS
PARTY HOLD-STATUS : 0 FREIGEGEREN
NOM-TEILF: REQ: 0 URSPR: 0 REST: 0
LOESCH-STATUS : 0 KEINE LOESCHANFRAGE
DISPO-PRIORITAET : 4 NORMALE PRIORITAET
PARTIAL SETTL IND :

CSD HOLD-STATUS : 0 FREIGEGEREN
CSD VALHOLD-STATUS: 0 FREIGEGEREN
RULE-ID :
CoSD HOLD-STATUS : 0 FREIGEGEREN
RULE-ID1:
RULE-ID2:

PF3:Rücksprung PF4:Abbruch

```

Die Feldbeschreibungen entsprechen denen der Maske „Status Information“ in KVAI/AA, siehe Information zum Auftragsstatus (AI).

4 Abwicklung von CCP-Instruktionen

Mit Einführung des zentralen Kontrahenten (CCP) sind mit den weiteren Stufen alle an der Frankfurter Wertpapierbörse (FWB) und/oder Xetra getätigten Geschäfte in deutschen (DE-ISIN) und ausländischen EURO-denominierten GS-verwahrten Aktien, Bonds sowie physische Lieferungen aus dem Eurex-Derivatemarkt in die CCP-Abwicklung einbezogen.

Für den CCP für den deutschen Markt übernimmt Clearstream Banking AG, Frankfurt (CBF) die Abwicklung der nicht aufrechenbaren CCP-Geschäfte, d. h. Lieferspitzen sowie die im CCP-System als Brutto-Geschäfte verarbeiteten Börsengeschäfte (surplus delivery = delivery versus payment oder free of payment) für CBF-Teilnehmer. Wobei in der CASCADE-OTC-Auftragsverarbeitung keine Unterscheidung dieser zwei CCP-Geschäftsarten vorgenommen wird.

Zugelassene Gattungen

Alle für die verschiedenen Produkte zu liefernden Wertpapiere sind zur GS-Verwahrung zugelassen. Dies bedeutet, dass Lieferungen nur über GS-Bestände abgewickelt werden können.

Verrechnung der Gegenwerte aus Kapitaldiensten

Die Verrechnung der Gegenwerte aus Kapitaldiensten auf offene CCP-Geschäfte erfolgt gemäß der durch den Teilnehmer gewählten Kontoverbindung bei der Eurex Clearing AG.

4.1 Auftragserteilung

Die Instruktionen (surplus delivery instructions) aus dem C7 SCS-System werden am Ende des Trade Date an CASCADE übergeleitet und an T2S übertragen.

Die Instruktionen (surplus delivery instructions) für Eurex Repo werden automatisch aus dem Securities CCP-System an S-1 (Settlement-Day -1) vor Beginn des Night-time Settlements (NTS) an CASCADE übergeleitet und an T2S übertragen.

Bis einschließlich Settlement-Day können weitere Instruktionen bzw. Änderungen durch den CCP zu den jeweiligen Dispositionszyklen bzw. in den möglichen Dispositionsarten folgen.

4.2 Auftragsbearbeitung und Settlement in EUR

Für Equities erteilt das C7 SCS-System zentral die Aufträge an CASCADE als OTC-Match-Aufträge bzw. OTC-Match-Instruktionen gegen Zahlung von EUR für Aktien für sein eigenes Konto (8501) und für die Konten der CBF-Teilnehmer („on behalf“).

Für Bonds (FWB) / Eurex Repo werden OTC-Match-Aufträge bzw. OTC-Match-Instruktionen gegen Zahlung von EUR für sein eigenes Konto (7525) und für die Konten der CBF-Teilnehmer erteilt („on behalf“).

Für effektive Lieferungen des Eurex-Derivatemarktes (Bonds) werden OTC-Match-Aufträge bzw. OTC Match-Instruktionen gegen Zahlung von EUR für sein eigenes Konto (7530) und für die Konten der CBF-Teilnehmer erteilt („on behalf“).

4.2.1 Besonderheiten für CBF Equity CCP Konto (8501)

CCP-Instruktionen werden als OTC-Instruktionen an T2S übermittelt und fließen parallel in den CASCADE OTC-Auftragsbestand ein. Für die „on behalf“ eingestellten Aufträge wird ein exklusiver Auftragsnummernkreis (größer 7000000) genutzt.

Die C7 SCS-Instruktionen sind über den Transaktionscode KVAI-AA über die Unterauftragsart „W“ (Auftragsart 01 bzw. 02) selektierbar. Die Buchungstextschlüssel entsprechen denen für OTC-Geschäfte (06).

Die Aufträge werden mit der Dispositionsriorität „2 = TOP - Top“ vom CCP eingestellt. Alle Aufträge werden gegen das Konto des CCP 8501 eingestellt und reguliert.

CCP-Aufträge können sowohl im Night-time Settlement (NTS) als auch im Real-time Settlement (RTS) reguliert werden.

Aufträge, die von C7 SCS kommen, werden nicht am Ende des Settlement Days gelöscht, sondern verbleiben im Status „pending“.

Die CCP-Aufträge werden in den CASCADE-Tageslisten, Regulierungslisten in der Spalte Bemerkungen mit „CI“ und Auftragsnummer, Clearing and Settlement Statement mit einer Zusatzinformation im Feld 94B „ECAG“, „XETR“ (Xetra), „XEUR“ (Eurex) und „XFRA“ (Börse Frankfurt) übernommen.

4.2.2 Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen/mit Zahlung in EUR

Die Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen EUR ist in allen Settlementzyklen möglich.

4.2.3 Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen Zahlung in Fremdwährung

Die Regulierung von Geschäften in Wertpapieren gegen Fremdwährung ist in allen Settlementzyklen möglich.

4.3 Auftragsbearbeitung und Settlement in CHF

Deutsche Eurex-Clearer können über CBF, Schweizer Eurex-Clearer über die SIX SIS AG physische Leistungen zur Erfüllung von CCP Surplus Deliveries in deutschen und Schweizer Basistiteln abwickeln.

Dazu wird die zwischen den beiden beteiligten Zentralverwahrern (CSD-link) bestehende Verbindung genutzt, die eine grenzüberschreitende und garantierte Lieferung gegen Zahlung in Euro bzw. CHF sicherstellt.

Für die Geldabwicklung müssen die Clearing-Mitglieder entweder pro Währung ein Konto nach Maßgabe der Eurex einrichten oder über Korrespondenzbankverbindungen die Geldseite mit Einzugsermächtigungen für „Cash Calls“ sicherstellen. Bei der Alternative einer Konteneinrichtung ist für EUR-Gegenwerte T2S bzw. das TARGET2-System und für CHF-Gegenwerte die Schweizerische Nationalbank (SNB) zuständig.

Die Währung der Geldabwicklung hängt immer von dem Heimatland der jeweiligen Wertpapiergattung ab (EUR für deutsche und ausländische Wertpapiere, CHF für Schweizer Wertpapiere).

Für aus dem Derivatemarkt zu beliefernde Schweizer Wertpapiere gegen Zahlung von CHF erteilt der CCP die Aufträge für CBF-Teilnehmer über sein eigenes SIS Konto als OTC-Match-Auftrag bzw. OTC-Matchinstruktion gegen Zahlung von CHF als Crossborder-Auftrag (SIS Omnibus Konto 7215 unter der Angabe des Endbegünstigten Kontos bzw. Originalauftraggeberkontos des CCP).

4.3.1 Regulierung von Geschäften in Schweizer Wertpapieren gegen Zahlung in CHF via Schweizerische Nationalbank

Die Regulierung von CCP Surplus Deliveries in Schweizer Gattungen erfolgt im Real-time Settlement (RTS). Mitbesitz im GS-Wertpapierbestand in Schweizer Gattungen ist hierfür erforderlich.

Wertpapiere, die gegen Zahlung von CHF durch einen CBF-Kunden geliefert werden, müssen im Depotbuchbestand verbucht sein, d. h. der Verkäufer muss rechtlicher Besitzer der Wertpapiere sein.

Der Erhalt von Schweizer Wertpapieren gegen Zahlung CHF erfolgt immer mit sofortigem Mitbesitzübergang. Auf Zahlungsbestätigungen durch die Schweizerische Nationalbank, die durch die SIS weitergegeben werden, erfolgt immer eine finale Stücke- und Geldebuchung in T2S bzw. bei der CBF.

4.4 Reporting regulierter CCP-Instruktionen

Alle in EUR regulierten CCP Surplus Deliveries werden in der EUR-Regulierungsliste aufgeführt.

Alle in CHF gebuchten CCP Surplus Deliveries werden in der FW-Regulierungsliste nach jedem Settlementzyklus aufgelistet.

4.4.1 Regulierungsliste Euro

Alle in Euro regulierten CCP Surplus Deliveries werden in der bestehenden Euro Regulierungsliste nach jedem Settlementzyklus aufgeführt.

Alle CCP Surplus Deliveries werden als Wertpapierübertrag verbucht und entsprechend mit dem Buchungsschlüssel „06“ ausgewiesen.

Alle CCP-Teilnehmer als Kunden der SIS haben SIS als Korrespondenzbank für die Euro Verrechnung gewählt.

4.4.2 Regulierungsliste für Fremdwährung (FW)

Alle in FW regulierten CCP Surplus Deliveries sind in der Regulierungsliste für Fremdwährung enthalten unter Angabe der Verrechnungsstelle.

Für Ausübungen in Schweizer Gattungen gegen Zahlung von CHF sind die gebuchten CCP Surplus Deliveries weiterhin in der FW-Regulierungsliste nach jedem Settlementzyklus enthalten und die entsprechende Verrechnung der CHF bei der Schweizerischen Nationalbank entsprechend ausgewiesen. Als Gegenkonto wird das CBF SIS Gegenkonto 7215 angezeigt.

4.4.3 Buchungstextschlüssel

Die Reservierungen und Buchungen von CCP Surplus Deliveries in CASCADE werden wie folgt ausgewiesen:

- CBF Konto 8501 – CCP-Aktien mit Euro-Settlement
 - Buchungsschlüssel „06“ für Buchungen von CCP Surplus Deliveries mit Euro-Gegenwert
- CBF Konto 7525 – CCP-Renten mit Euro-Settlement
 - Buchungsschlüssel „50“ für Buchungen von CCP Surplus Deliveries mit Euro-Gegenwert
- CBF Konto 7530 – CCP-Renten mit Euro-Settlement
 - Buchungsschlüssel „50“ für Buchungen von CCP Surplus Deliveries mit Euro-Gegenwert
- CBF SIS Omnibus Konto 7215 – CCP-Renten und -Aktien mit CHF-Settlement
 - Buchungsschlüssel „06“ für finale Buchungen von CCP Surplus Deliveries mit CHF-Gegenwert.

4.4.4 Regulierungsdatenträger MT536

Alle CCP Surplus Deliveries werden einheitlich im Feld (94B) „Handelsort“ / „Trade place“ mit der Ausprägung mit „ECAG“ (Eurex Clearing AG), „XETR“ (Xetra), „XEUR“ (Eurex) und „XFRA“ (Börse Frankfurt) ausgewiesen.

Teilnehmer, die für einen Schweizer Clearer als Korrespondenzbank die EUR-Verrechnung vornehmen, erhalten eine Auflistung über die aufgrund der Korrespondenzbankverbindungen anfallenden Zahlungen.

Details zum MT536 sind im CBF Connectivity Handbook beschrieben.

4.4.5 Swift-Settlement Confirmations (MT544-MT547) und Weiterleitungen (MT578)

Alle CCP Surplus Deliveries werden einheitlich im Feld (94B) „Handelsort“ / „Trade Place“ mit der Ausprägung „ECAG“, „XETR“ (Xetra), „XEUR“ (Eurex) und „XFRA“ (Börse Frankfurt) ausgewiesen.

Details zu den MT544-MT547 und dem MT578 sind im CBF Connectivity Handbook beschrieben.

5 Geldregulierung in Fremdwahrung (GC)

Geldverrechnung in Fremdwahrung wird nur auf Basis von Guthaben in Commercial Bank Money vorgenommen. Die Toleranzgrenzen fur Fremdwahrungen sind Kapitel 3.5 zu entnehmen.

5.1 Information von CASCADE-FWG-Geschaften

(A) Allgemeine Beschreibung

Der Benutzer kann die Auswahl der angezeigten CASCADE-Fremdwahrungsauftrage in der Auswahlmaske einschranken nach

- Kaufe
- Verkaufe oder
- Gesamt, d. h. alle Fremdwahrungsauftrage.

Eine Bearbeitung ist durch den Kunden nicht moglich.

Mit der Auswahl „GC“ wird folgende Auswahlmaske angezeigt:

(B) Auswahlmaske Geldkontrolle Commercial Bank Money

```
TRAN: KVGC FC: SB:
GELDKONTROLLE CBM H A U P T A U S W A H L
BANK CLEARSTREAM BANKING, FRANKFURT
IK INFORMATION KAEUFER BG BEARBEITEN GELDBUCHUNG
IV INFORMATION VERKAEUFER
IG INFORMATION GESAMT
AUSWAHL
BANK : 7930
VALUTA : .....
WRG : ...
VERARB-STATUS : ...
HERKUNFT (ART) : ... (CAS: CASCADE)
AUFTRN/GSNR : .....
PF1:Hilfe PF3:Rucksprung PF4:Abbruch
```

Mögliche Funktionen (FC):

- „IK“ Wählt der Benutzer die Funktion „IK - Information Käufer“ aus, so werden alle CBM-Geldaufträge (und Widerrufe) angezeigt, die zu Lasten der vorgegebenen Bank (des Auftraggebers) ausgeführt wurden oder noch ausgeführt werden.
- „IV“ Wählt der Benutzer die Funktion „IV - Information Verkäufer“ aus, so werden alle CBM-Geldaufträge (und Widerrufe) angezeigt, die zu Gunsten der vorgegebenen Bank (des Auftraggebers) ausgeführt wurden oder noch ausgeführt werden.
- „IG“ Wählt der Benutzer die Funktion „IG - Information Gesamt“ aus, so werden alle CBM-Geldaufträge (und Widerrufe) angezeigt, die zu Lasten oder zu Gunsten der vorgegebenen Bank (des Auftraggebers) ausgeführt wurden oder noch ausgeführt werden.

Funktion Code	Beschreibung
IK IV IG	Die Auswahl IK, IV oder IG kann aufgerufen werden, um sich über den aktuellen Status der Fremdwährungszahlungen und der an Creation übertragenen Widerrufe zu informieren. Hierbei kann weiterhin kontrolliert werden, wann die Zahlungsinstruktion (bzw. der Widerruf) von CBF versendet wurde bzw. wann eine Rückmeldung hierzu eingegangen ist. Beide Teilnehmer (Käufer und Verkäufer) werden gleichermaßen über die Geldüberweisung, die aus ihrem in Auftrag gegebenen erzeugt wurde, informiert. In allen Funktionen besteht keine Änderungsmöglichkeit für CBF-Kunden.

Zusätzlich zur Eingabe des Funktionscodes kann durch weitere Auswahlkriterien die Selektion der Aufträge eingeschränkt werden:

BANK	Dieses Feld wird mit der Banknummer des jeweiligen Benutzers vorbelegt.
VALUTA	Ist in dem Feld das Tagesdatum enthalten, so werden alle aktuellen Fremdwährungsgeldaufträge zu den eingegebenen Auswahlkriterien angezeigt. Wird das Feld mit einem historischen Datum überschrieben, werden alle historischen Geldaufträge (zu den gewünschten Auswahlkriterien) angezeigt. Eine Anzeige ist für maximal zehn Arbeitstage zurück möglich. Dieses Feld wird mit dem Tagesdatum vorbelegt. (Mussfeld außer, die AUFTNR/GSNR wird angegeben)
WRG	Der ISO-Code der Fremdwährung führt zu einer begrenzten Anzeige von nur in dieser Währung gültigen Instruktionen. (Kannfeld)
VERARBEITUNGSSTATUS	Es kann eine zusätzliche Auswahl über den Verarbeitungsstatus erfolgen. Die einzelnen Ausprägungen des Verarbeitungsstatus können über die PF1-Taste angezeigt werden (Kannfeld). (Verarbeitungsstatus siehe Anhang)
HERKUNFT	Mit Abschaltung der LION-Funktionalität bringt nur noch die Eingabe für CASCADE OTC (CAS) Ergebnisse. (Kannfeld)
AUFTNR/GSNR	Soll der Geldauftrag eines bestimmten Auftrags angezeigt werden, so kann durch Eintrag der entsprechenden Auftragsnummer [CASCADE; sowohl Match-Auftrag wie Match-Instruktion ist eingebbar] direkt dieser Geldauftrag eingesehen werden. Existieren zu einer AUFTNR/GSNR mehr als eine Transaktion (Eingabe derselben Nummer erfolgte durch verschiedene Eingaber), werden diese alle angezeigt.

Durch Betätigen der PF1-Taste werden dem Systemnutzer die einzelnen Ausprägungen des „Verarbeitungsstatus“ (VERARB-STATUS) angezeigt.

5.1.1 Anzeige Verarbeitungs-Status

Durch Drücken der PF-1-Taste wird ein Hilfescreen aktiviert, der die Status-Ausprägungen erläutert (CBM steht dabei für Commercial Bank Money, CBL steht für Commercial Bank Money Geldabwicklungssystem).

5.1.1.1 Hilfebildschirm (PF-1-Taste)

```

TRAN: KVGC FC:      SB: #12.06.2009#####

----- ANZEIGE DER VERARBEITUNGS-STATUS UND IHRER BEDEUTUNG -----

100 - CBM Instruktion erstellt und an CBL übertragen
150 - CBM gebucht (Stücke weiterhin nur reserviert)

200 - Stücke und CBM erfolgreich gebucht (automatisch)
290 - Stücke und CBM erfolgreich gebucht (manuell)

500 - CBM gebucht, Rückn. Reservierung Stücke durch CSD (oder EoD-Processing)
501 - Rücknahme Reservierung Stücke durch CSD (oder EoD-Processing)
590 - CBM Instruktion manuell abgelehnt durch CBF

600 - Widerruf der CBM Instruktion an CBL übertragen

800 - Widerruf der CBM Instruktion erfolgt (automatisch)
890 - Widerruf der CBM Instruktion erfolgt (manuell)

900 - Widerruf bei CBL nicht erfolgreich, da Stücke und CBM gebucht (autom.)
990 - Widerruf bei CBL nicht erfolgreich, da Stücke und CBM gebucht (manuell)

PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch

```

Zusätzlicher Hinweis: Eine finale Ablehnung mangels FWG-Bestand ist nicht vorgesehen. Alle Geldinstruktionen werden innerhalb des Real-time Settlements vorgetragen.

5.1.2 Tabellarische Kurzanzeige der FWG-Aufträge

Nach Setzen der Selektionskriterien und Datenfreigabe (Eingabe- oder PF-3-Taste) erhält der Benutzer die Informationen der entsprechenden Fremdwährungs-Buchungen tabellarisch angezeigt.

```

TRAN: KVGC FC: IG SB: #####02.06.2009

GELDKONTROLLE CBM          INFORMATION GELDBUCHUNGEN          SEITE 1

VALUTA: 02.06.2009

      WP-KONTEN
KZ  VS ART  GUT  LAST          GEGENWERT WRG          AUFTNR MI AUFTNR MA          CBM-KONTEN
                                GSNR          SOLL HABEN
- 100 CAS 7930 8501          0,99 USD  123456789 123456788 67930 68501
- 100 CAS 7930 8501          0,01 USD  123456787 123456786 67930 68501
- 590 CAS 7930 6789          5.000,00 USD          99          9 67930 66789
- 290 LIO 7930 6789          200,00 USD          2          2 67930 66789
- 200 LIO 7930 6789          10,00 USD          1          1 67930 66789

GESAMTSUMME :          5.211,00 USD          AUS          5 POSTEN

PF1:Hilfe  PF2:Druck  PF3:Rücksprung  PF4:Abbruch

```

Eingebbare Kennzeichen (KZ):

„I“	Wird eine Transaktion unter der Spalte KZ gekennzeichnet, so gelangt der Benutzer in die Vollanzeige.
„D“	Mit „D“ wird der Ausdruck der Geldbuchung eingeleitet.

Details zur Anzeige

- Die Bezeichnung GESAMTSUMME/AUS wird am Bildschirm ausgewiesen, wenn eine WRG gewählt wurde.
- Die Anzahl Posten wird immer ausgewiesen.
- PF7, PF8-Tasten für Vor/Zurückblättern
- Sortierreihenfolge der angezeigten FWG-Buchungen, sofern nicht durch Auswahl eingeschränkt:
 1. Verarbeitungsstatus analog Aufstellung:
 - 100 - CBM Instruktion erstellt und an CBL übertragen
 - 150 - CBM gebucht (Stücke weiterhin nur reserviert)
 - 200 - Stücke und CBM erfolgreich gebucht (automatisch)
 - 290 - Stücke und CBM erfolgreich gebucht (manuell)
 - 500 - CBM gebucht, Rückn. Reservierung Stücke durch CSD (oder EoD-Processing)
 - 501 - Rücknahme Reservierung Stücke durch CSD (oder EoD-Processing)
 - 590 - CBM Instruktion manuell abgelehnt durch CBF
 - 600 - Widerruf der CBM Instruktion an CBL übertragen
 - 800 - Widerruf der CBM Instruktion erfolgt (automatisch)
 - 890 - Widerruf der CBM Instruktion erfolgt (manuell)
 - 900 - Widerruf bei CBL nicht erfolgreich, da Stücke und CBM gebucht (autom.)
 - 990 - Widerruf bei CBL nicht erfolgreich, da Stücke und CBM gebucht (manuell)
 2. Gegenwert: absteigend („hoch oben“)
 3. WRG absteigend (Währung „ZAR oben“)
 4. GUT – aufsteigend
 5. LAST – aufsteigend
 6. ART (Herkunft) – aufsteigend

5.1.3 Vollanzeige

Durch Markierung einer bestimmten FWG-Buchung (mit „I“) in der tabellarischen Auswahl oder durch Angabe der AUFTNR/GSNR in der Auswahlmaske werden die Details zu der selektierten Buchung angezeigt.

TRAN: KVGC FC: IG SB:	
GELDKONTROLLE CBM	INFORMATION GELDBUCHUNG
GUT : 7930 TESTBANK AG	CBM-KONTO
LAST: 8501 EUREX CLEARING AG EQUITY CCP	SOLL : 67930
	HABEN: 68501
GEGENWERT:999.999.999.999,99 USD	AUFTNR MI: 1234567
NOMINALE : 500,00 ST	AUFTNR MA: 9876543
WKN/ISIN : I DE0009998887 TEST-ISIN AG	HERKUNFT : CASCADE
	SET-DAY : 02.06.2009
VALUTA : 02.06.2009	
STATUS ZEIT DATUM USER-ID REFERENZ-NR MI: 0811-7399860-001	
290 10.35 30.05.2009 7907000100 REFERENZ-NR MA: 0811-7399860-001	
100 22.20 02.06.2009	
PF2:Druck PF3:Rücksprung PF4:Abbruch	

Details zur Anzeige

Der Spaltenkopf USER-ID wird nur angezeigt, wenn mindestens eine User-ID angezeigt werden kann.

Sortier-Reihenfolge der Status-Anzeige: Datum/Zeit absteigend (aktuell = oben)

Kontakt

www.clearstream.com

Veröffentlicht von**Clearstream Banking Frankfurt**

Eingetragene Adresse

Clearstream Banking AG, Frankfurt

Mergenthalerallee 61

65760 Eschborn

Deutschland

Postanschrift

Clearstream Banking AG

60485 Frankfurt /Main

Deutschland
