

Update	Tag	T2S Release Zeitplan	CBF / T2S Business Day (MEZ)	Revision	Revidierte Zeit (MEZ)	Beschreibung des Ereignisses / Prozesses im regulären T2S Operational Day	Hinweise von CBF
	Montag, 4. November 2021					Operational News #1 SET-GO: Pre-Migration - Pflege von Kontostammdaten	Vorübergehende Einstellung der Pflege von statischen Daten, die für die Vorbereitung der Migration von nicht abgewickelten Börsengeschäften (non-CCP SE Trades) erforderlich sind.
	Freitag, 12. November 2021					Operational News #2 SET-GO: Abschluss Pre-Migration	Vorbereitung der schwebenden Instruktionen für non- CCP SE Trades in der Verwahrart AKV und WPR für die Migration.
	Montag, 15. November 2021					Operational News #3 CBF: November Release - Wochenendplanung - Finale Aktualisierung	Letzte Aktualisierung der „Indicative Timeline“ in Vorbereitung auf das Implementierungswochenende.
	Freitag, 19. November 2021				13:30	Versand der Verarbeitungsergebnisse von Instruktionen für non-CCP SE Trades in der Verwahrart AKV, die auf Creation erzeugt wurden	Das Ergebnis basiert auf der Übertragung um ca. 10:00 Uhr von CBF an Creation. Vorbehaltlich der erfolgreichen Migration wird CBF in Zukunft non-CCP SE Trades „OTC-like“ verarbeiten. Die relevanten Geschäfte werden über das Stock Exchange Transaction Interface (SETI) an Creation weitergeleitet.
	Freitag, 19. November 2021				14:00	Operational News #4 SET-GO: Übertragung LION Reporting	Bestätigung über die Verfügbarkeit der Verarbeitungsergebnisse für non-CCP SE Trades in der Verwahrart AKV.
		bis 18:45				T2S Operational Day und CBF T2S Business Day werden gemäß des regulären Zeitplans durchgeführt	
		18:45			Samstag, 20. November 2021, <u>16:05</u>	<a href="#">T2S – Continue with Operating Day</a>	Der neue Geschäftstag beginnt auf T2S, sobald die Implementierungsaktivitäten beendet wurden.
			19:00			CBF – Start of Day	CBF ändert den Valutatag, Montag, 22. November 2021, gemäß des regulären Zeitplans.
			19:00			LION – Beginn der STD Abwicklung von non-T2S Instruktionen (AKV, STR, WPR)	Die STD Abwicklung wird mit dem Beginn der Migration deaktiviert. Die Regulierung von STR ISINs wird letztmalig am Freitag, 19. November 2021, in der SDS2 Verarbeitung erfolgen. Schwebende Instruktionen in AKV- und WPR-Titeln werden an diesem Wochenende migriert und können zukünftig „OTC-like“ auf Creation verarbeitet werden.
			19:00			CBF Print Report: Regulierungsliste (settlement list)	

Update	Tag	T2S Release Zeitplan	CBF / T2S Business Day (MEZ)	Revision	Revidierte Zeit (MEZ)	Beschreibung des Ereignisses / Prozesses im regulären T2S Operational Day	Hinweise von CBF
			19:15	➔	Montag, 22. November 2021, 01:30	LION – Start LION Online	Über LION werden Geschäfte in der Verwahrart GS und NCSC-T angezeigt. Über das Xact Web Portal können die Informationen für ISINs der Verwahrart AKV abgerufen werden.
	Freitag, 19. November 2021			✕	19:30	Operational News #5 CBF: Tagesende für den Abwicklungstag	
			19:30	➔	Freitag, 19. November 2021, 23:00	KADI Reporting: MT564 – Notification MT568 – Narrative	Die CBF-Verarbeitung für Kapitalmaßnahmen (KADI) wird weiterhin nach den allgemeinen Verfahren durchgeführt. Das KADI Reporting wird an diesem Freitag später ausgeliefert. Mit dieser Maßnahme kann erreicht werden, dass alle Informationen aus der KADI Verarbeitung taggleich gesendet werden.
			19:30	➔	Sonntag, 21. November 2021, 08:00	KADI Reporting: MT566 – Confirmations	Die Bestätigungen zu Kapitalmaßnahmen (MT566) werden am Sonntag, 21. November 2021, ab 08:00 Uhr zur Verfügung gestellt.
			20:00	✓		Clearstream Online Funktionalität	Die CASCADE Online Funktionalität (HOST / PC) und das Xact Web Portal werden während der Implementierungsphase nicht vollumfänglich zur Verfügung stehen. <a href="#">Ein gesondertes Zeitfenster für den Zugriff auf Xact Web Portal für Abstimmungsaktivitäten bezüglich SET-GO</a> wird am Samstag, 20. November 2021, zwischen 15:30 und 18:00 angeboten. <a href="#">Zusätzlich werden die Clearstream Online Funktionalitäten</a> am Sonntag, 21. November 2021, zwischen 06:30 Uhr und 11:00 Uhr zur Verfügung sein.



Update	Tag	T2S Release Zeitplan	CBF / T2S Business Day (MEZ)	Revision	Revidierte Zeit (MEZ)	Beschreibung des Ereignisses / Prozesses im regulären T2S Operational Day	Hinweise von CBF
			20:00		Sonntag, 21. November 2021, 06:00	CBF's Realtime Schnittstelle an T2S	<p>Clearstream wird die technische Anbindung (T2S-I) zu T2S während der Durchführung der Implementierungsaktivitäten schließen. Dennoch werden alle technischen Anbindungsvarianten von CBF den Kunden zur Verfügung stehen. Jede für T2S bereitgestellte Instruktion wird in die Warteschleife bis zum Abschluss der Implementierungsphase von CBF, Sonntag, 21. November 2021, gegen 06:00 Uhr übernommen. Das bedeutet, dass alle Instruktionen, die erfolgreich gesendet wurden, auf der Anbindungsebene gehalten werden. Dieser Zeitraum gilt auch für Kunden, die ClearstreamXact über SWIFT nutzen. Das bedeutet, dass auch diese Instruktionen in der Zeit von Freitag, 19. November 2021, 20:00 Uhr bis Sonntag, 21. November 2021, gegen 06:00 Uhr in der Warteschleife stehen.</p> <p><u><a href="#">Für das Settlement Reporting im Zusammenhang mit SET-GO wird die Xact A2A Anbindung am Samstag, den 20. November 2021, zwischen 18:00 und 19:00 Uhr geöffnet. Danach muss das Übertragungsfenster wegen der T2S Release 5.2 Implementierungsaktivitäten geschlossen werden. Die Kunden berücksichtigen bitte, dass ggf. nicht alle ausgehenden Nachrichten, die aus der SET-GO ICSD Migration resultieren, innerhalb des benannten Zeitrahmens gesendet werden können. In diesem Fall werden die verbleibenden Nachrichten im Clearstream-Backend in eine Warteschlange gestellt und nach den Implementierungsaktivitäten am Sonntag, 21. November 2021, ab 05:00 Uhr bis spätestens 11:00 Uhr, übermittelt.</a></u></p>
	Freitag, 19. November 2021				20:15	Operational News #6 T2S: Ende der Verarbeitung eingehender Nachrichten	Basierend auf dem T2S Playbook wird T2S die CSDs informieren, dass eingehende Nachrichten ab diesem Zeitpunkt nicht mehr zur Verarbeitung gelangen, sondern in eine Warteschlange bis zum Ende der Implementierungsaktivitäten gestellt werden. Kunden, die im DCP Modus operieren, werden gebeten, ab diesem Zeitpunkt den Nachrichtenfluss mit T2S zu überwachen.
	Freitag, 19. November 2021				20:30	Operational News #7 T2S: „Green Light“ für die Implementierung der Software	T2S wird das "Green Light" für den Start der Implementierungsaktivitäten in Abstimmung mit den T2S Settlement Managern erteilen.

Update	Tag	T2S Release Zeitplan	CBF / T2S Business Day (MEZ)	Revision	Revidierte Zeit (MEZ)	Beschreibung des Ereignisses / Prozesses im regulären T2S Operational Day	Hinweise von CBF
i		20:00		→	Samstag, 20. November 2021, <u>17:20</u>	T2S – Start Night-time Settlement (NTS), Start First NTS Cycle	Die von den Kunden über TARGET2 am Freitag, 19. November 2021, angestoßenen Liquiditätstransfers sollen am Samstag, 20. November 2021, gegen <u>17:00</u> Uhr ausgeführt werden, so dass die Liquidität auf den DCAs kurz vor Beginn der Nachtverarbeitung bereitgestellt werden kann. T2S wird die Anbindungsvarianten (automatisiert (A2A) und T2S GUI (U2A)) schließen. Die technische Anbindung soll am Samstag, 20. November 2021 in der Zeit von <u>20:05</u> Uhr bis <u>20:35</u> Uhr wieder geöffnet werden.
			20:30	✓		CASCADE Reporting: MT535 – Statement of Holdings	
			21:00	✗		CASCADE-RS – 4. Allocation run	Während des T2S Release Wochenendes wird dieser Prozess nicht ausgeführt.
			21:30	→	Samstag, 20. November 2021, 19:00	LION – Ende der STD Abwicklung von non-T2S Instruktionen (AKV, STR, WPR)	Nach der erfolgreichen Migration von Instruktionen für non-CCP SE Trades in den Verwahrarten AKV und WPR werden die auf Creation erzielten Abwicklungsergebnisse am Samstag, 20. November 2021, bereitgestellt, nachdem das SWIFT Release implementiert wurde. Die Verarbeitung von Instruktionen non-CCP SE Trades in der Verwahrart STR wird nach der Migration nicht mehr unterstützt.
			21:30	→	Sonntag, 21. November 2021, 06:00	CASCADE – Verarbeitung der Preisdifferenzen von BrainTrade	Zahlung ohne Lieferung Instruktionen (Payment Free of Delivery, PFOD) für die Abwicklung von Preisdifferenzen werden am Sonntag, 21 November 2021, gegen 06:00 Uhr an T2S versendet. Sie werden zur Verarbeitung im T2S Real-time Settlement (RTS) Zyklus zur Verfügung gestellt.
			21:30	✓		CASCADE-RS – Automatisierte Umschreibung	
i		22:20		→	Samstag, 20. November 2021, <u>18:50</u>	T2S – End First NTS Cycle	Gemäß des T2S Deployment Playbooks wird das Ende des „First NTS Cycle“ für Samstag, 20. November 2021, erwartet. Der „Last NTS Cycle“ beginnt unmittelbar danach.

Update	Tag	T2S Release Zeitplan	CBF / T2S Business Day (MEZ)	Revision	Revidierte Zeit (MEZ)	Beschreibung des Ereignisses / Prozesses im regulären T2S Operational Day	Hinweise von CBF
		22:20		→	Samstag, 20. November 2021, <u>18:50</u>	T2S – Start Last NTS Cycle	T2S stellt den „camt.025“ Report bereit, um über den Status der von den Zentralbanken initiierten Liquiditätsaufträge zu berichten. Das Reporting ist abhängig von der Nachrichtenkonfiguration, die durch den Kunden, der im DCP-Modus operiert, hinterlegt ist.
			22:30	✓		LION – Non-CCP SE Trades werden von Börsensystemen des Handelstags empfangen	„Tagesgeschäfte“ werden mit der Einführung der SET-GO ICSD Migration (Phase 1) entsprechend der Verwahrart zur Abwicklung weitergeleitet. Instruktionen in ISINs der Verwahrart AKV und WPR werden über Creation „OTC-like“ verarbeitet. Die Abwicklung und das Reporting für Instruktionen in der Verwahrt GS und NCSC-T erfolgt wie bisher.
				→	Samstag, 20. November 2021, 14:00	LION – Schwebende non-CCP SE Trades in der Verwahrart AKV und WPR werden an Creation zur Abwicklung weitergeleitet	Auf Basis des Migration Approach findet die Übermittlung der „Restanten“ via SET1 statt.
				→	Samstag, 20. November 2021, 17:00	LION – Neue non-CCP SE Trades in der Verwahrart AKV und WPR werden über SET1 an Creation zur Abwicklung weitergeleitet	Die Weiterleitung der „Tagesgeschäfte“ erfolgt nach der Implementierung der SET-GO ICSD Migration (Phase 1) wie bisher nach 22:00 Uhr.
		22:30		→	Sonntag, 21. November 2021, 09:30	LION – Non-CCP SE Trades in der Verwahrart GS und NCSC-T werden zur Abwicklung an T2S weitergeleitet	Non-CCP SE Trades mit einem Intended Settlement Date (ISD) Trade Date +1 werden für den T2S RTS Zyklus bereitgestellt. Bei Geschäften mit Trade Date +2 gilt das übliche Verfahren.
		22:30		✗		CASCADE-RS – Übermittlung von RS Aufträgen an das Aktionärsregister für die automatisierte Umschreibung	Der „CASCADE-RS 4. Allocation run“ wird nicht durchgeführt und daher werden diese Details nicht zur Verfügung stehen.
		23:00		→	Sonntag, 21. November 2021, beginnend gegen 08:00	CASCADE Reporting: MT536 – Statement of Transactions (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 100) MT537 – Statement of Pending OTC Transactions (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 651) MT586 – Statement of Allegements (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 451)	Die Abwicklungsergebnisse, die automatisiert (CBF Outbound) versendet werden, werden bis Sonntag, 21. November 2021, 08:00 Uhr, in die Warteschlange gestellt. Die voraussichtliche Übertragungszeit kann sich in Abhängigkeit zu den Implementierungsaktivitäten ändern. Das heißt, das Reporting wird nach Abschluss des zugehörigen Meilensteins versendet.
		23:00		→	Samstag, 20. November 2021, beginnend um 19:00	Xact Settlement Reporting für Wertpapiere in AKV	Mit der Einführung der SET-GO ICSD Migration (Phase 1) werden spezielle Reportdefinitionen für OTC und SE Instruktionen zur Verfügung gestellt, die eine Separierung des Nachrichtenflusses ermöglichen.

Update	Tag	T2S Release Zeitplan	CBF / T2S Business Day (MEZ)	Revision	Revidierte Zeit (MEZ)	Beschreibung des Ereignisses / Prozesses im regulären T2S Operational Day	Hinweise von CBF
				➔	Sonntag, 21. November 2021, beginnend nach 08:00	LION Reporting: MT537 – Statement of Pending SE Transactions (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 200)	LION Instruktionen, die während des Migrationswochenende storniert wurden, zeigen den „Cancellation Reason Code LC“
	Freitag, 19. November 2021			✘	23:00	Operational News #8 SET-GO: Erhalt der täglichen Schlussnoten	
				➔	Freitag, 19. November 2021, 23:00	KADI Reporting: MT566 - Confirmation	Bedingt durch die Änderung der Versandzeit des KADI Reportings (MT564, MT568) von 19:30 Uhr auf 23:00 Uhr, werden die zugehörigen Bestätigungen (MT566) am Sonntag, 21. November 2021, 08:00 Uhr, zur Verfügung gestellt.
			23:45	➔	Sonntag, 21. November 2021, beginnend nach 10:00	LION Reporting für Wertpapiere in GS und NCSC- T: MT537 – Statement of Pending SE Transactions (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 250)	Die voraussichtliche Übertragungszeit kann sich im Abhängigkeit zu den Implementierungsaktivitäten ändern. Das heißt, das Reporting wird nach Abschluss des zugehörigen Meilensteins versendet. CBF wird die Nachrichten in der festgelegten Abfolge übermitteln. Dabei werden die Werte der Reporting Intervalle berücksichtigt. Abhängig von der Verarbeitungszeit in T2S können Reports ohne Inhalt („empty“) sein.
	Samstag, 20. November 2021			✘	10:00	Operational News #9 SET-GO: „Green Light“ für den Einsatz der Software	
	Samstag, 20. November 2021			✘	13:30	Operational News #10 SET-GO: Versand der Migrations- reports 1 und 2	
				➡	Samstag, 20. November 2021, 15:30	Öffnung von Xact Web Portal	Die Onlineabfrage wird für Abstimmungsaktivitäten der SET-GO ICSD Migration (Phase 1) am Samstag, 20. November 2021, bis 18:00 Uhr geöffnet werden. Es kann nur auf Abwicklungs-instruktionen zugegriffen werden.
	Samstag, 20. November 2021			✘	16:30	Operational News #11 SET-GO: Versand der Migrationsreports 3	
	Samstag, 20. November 2021			✘	18:00	Operational News #12 SET-GO: Abschluss der Implementierungsaktivitäten	
	Samstag, 20. November 2021			✘	18:15	<u>Operational News #13</u> <u>SET-GO: Versand [A2A] von CBL Nachrichten</u> <u>und Reports aus der Abwicklung</u>	



Update	Tag	T2S Release Zeitplan	CBF / T2S Business Day (MEZ)	Revision	Revidierte Zeit (MEZ)	Beschreibung des Ereignisses / Prozesses im regulären T2S Operational Day	Hinweise von CBF
	Freitag, 19. November 2021	23:30			Samstag, 20. November 2021, <u>19:40</u>	T2S – End Last NTS Cycle, End Night-time Settlement (NTS)	Gemäß des T2S Deployment Playbooks wird die Nachtverarbeitung am Samstag, 20. November 2021, <u>19:40</u> Uhr, beendet sein. <u>Im Anschluss wird T2S prüfen, ob die A2A-Anbindungen geöffnet werden können.</u>
	Samstag, 20. November 2021				<u>20:25</u>	<u>Operational News #14</u> <u>T2S: Versand (A2A) von Nachrichten und Reports aus der Abwicklung</u>	
	Freitag, 19. November 2021	23:30			Samstag, 20. November 2021, <u>21:15</u>	T2S – Start Real-time Settlement (RTS)	Gemäß des T2S Deployment Playbooks wird die Echtzeitverarbeitung am Samstag, 20. November 2021, durchgeführt.
					Sonntag, 21. November 2021, 06:00	Öffnung der technischen Anbindungsvarianten von CBF und der CASCADE Online Funktionalitäten	Die technischen Anbindungsvarianten sowie die CASCADE Online Funktionalität (HOST / PC) werden bis zum Beginn der Wartungsfenster am Sonntag, 21. November 2021, gegen 11:00 Uhr zur Verfügung stehen.
	Sonntag, 21. November 2021				08:00	Operational News #15 CBF Start für den Versand von (A2A) Abwicklungsergebnissen (Settlement Reporting)	
			Samstag, 02:00		Sonntag, 21. November 2021, beginnend um 10:00	CASCADE Reporting: MT536 – Statement of Transactions (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 200) MT537 – Statement of Pending OTC Transactions (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 801) MT586 – Statement of Allegements (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 801)	Mit diesem Reportingintervall werden die T2S-Abwicklungsergebnisse aus der Nachtverarbeitung („First and Last NTS Cycle“) bereitgestellt. Zusätzlich können Abwicklungsergebnisse aus dem RTS Zyklus einbezogen werden, wenn T2S vor Beginn der Erstellung des CBF Reportingintervalls Ergebnisse geliefert hat. Das Reporting wird frühestens ab 10:00 Uhr übermittelt und spätestens mit Beginn des CBF Wartungsfensters abgeschlossen sein.
		02:30			Sonntag, 21. November 2021, 10:50	T2S – End Real-time Settlement (RTS)	
		02:30			Sonntag, 21. November 2021, 11:00	T2S – Start Maintenance Window (MNTW)	<u>Nachdem die Zentralverwahrer und Zentralbanken entschieden haben, dass der reguläre Ablauf eines Geschäftstags starten kann, beginnen die Wartungsfenster.</u>
			03:00		Sonntag, 21. November 2021, 11:00	CASCADE – Ende CASCADE Online	Die CASCADE Online Funktionalität (HOST / PC) wird ab Montag, 22. November 2021, gegen 01:30 Uhr zur Verfügung stehen.

Update	Tag	T2S Release Zeitplan	CBF / T2S Business Day (MEZ)	Revision	Revidierte Zeit (MEZ)	Beschreibung des Ereignisses / Prozesses im regulären T2S Operational Day	Hinweise von CBF
			03:00	➔	Sonntag, 21. November 2021, 11:00	Clearstream – Start Wartungsfenster	Das CBF Wartungsfenster wird verschoben. Die Wartungsaktivitäten beginnen, sobald CBF alle vorausgehenden T2S Release 5.2 Aktivitäten abgeschlossen hat. Der Zeitraum des ClearstreamXact Wartungsfenster ist ebenfalls betroffen. Es ist bis Sonntag, 21. November 2021, 21:00 Uhr geplant. Der reguläre Zeitraum für den „read-only“ Zugriff wird nicht verfügbar sein.
			ca.03:00	➔	Sonntag, 21. November 2021, 11:00	CBF Print Report: Lieferliste (list of pending stock exchange trades)	Das Reporting wird mit dem Beginn des CBF Wartungsfenster zur Verfügung gestellt.
	Sonntag, 21. November 2021			✉	11:15	Operational News #16 T2S: Abschluss der Echtzeitverarbeitung (RTS) und Start der T2S und CBF Wartungsfenster	
	Montag, 22. November 2021		05:00	➡	Montag, 22. November 2021, 01:30	CASCADE – Start CASCADE Online	Die CBF Online Funktionalität (HOST / PC) wird für den kommenden Geschäftstag geöffnet.
		02:30		✓	<u>Montag, 22. November 2021, 02:30</u>	T2S – End Maintenance Window	
		02:30		✓	<u>Montag, 22. November 2021, 02:30</u>	T2S – Start Real-time Settlement (RTS)	
		05:00		✓		CASCADE Reporting: MT537 – Statement of Pending OTC Transactions (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 041) MT586 – Statement of Allegements (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 041)	Diese Nachrichten können die T2S Verarbeitungsergebnisse aus dem RTS Zyklus beinhalten, der am Sonntag, 21. November 2021, gegen 21:00 Uhr startet.
		05:00		✓		KADI – Reporting und Verarbeitung von Market / Reverse Claims und Transformationen, die aus den in der T2S Nachtverarbeitung (NTS Cycle) abgewickelten Instruktion resultieren	Diese Nachrichten werden die Ergebnisse des üblichen T2S Operational Day beinhalten.
		Beginnend um 06:00		✓		Der CBF T2S Business Day wird nach dem üblichen Zeitplan durchgeführt	
		10:00		✓		LION Reporting: MT537 – Statement of Pending SE Transactions (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 400)	Dieses Reporting wird keine Angaben zu non-CCP SE Trades in der Verwahrart AKV enthalten.

Update	Tag	T2S Release Zeitplan	CBF / T2S Business Day (MEZ)	Revision	Revidierte Zeit (MEZ)	Beschreibung des Ereignisses / Prozesses im regulären T2S Operational Day	Hinweise von CBF
			23:00	✓		LION Reporting: MT537 – Statement of Pending SE Transactions (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 200)	LION Instruktionen, die während des Migrationswochenende storniert wurden, werden mit dem Cancellation Reason Code „LG“ ausgewiesen.
	Dienstag, 23. November 2021		10:00	✓		LION Reporting: MT537 – Statement of Pending SE Transactions (Reporting Interval: Value in TAG 13A = 400)	LION Instruktionen, die während des Migrationswochenende storniert wurden, werden nicht mehr Bestandteil dieses Reports sein. Dennoch können während dieses Geschäftstags solche Instruktionen über die LION Online Funktionalität abgerufen werden

Legende:

Revision



Verarbeitung gemäß des täglichen operative Zeitplans



Prozess / Reporting wird nicht durchgeführt



Prozess wird früher als im täglichen operativen Zeitplan durchgeführt; siehe revidierte Zeit



Prozess wird später als im täglichen operativen Zeitplan durchgeführt; siehe revidierte Zeit



Veröffentlichung der Operational News

Update



Aktualisierung: Änderungen sind unterstrichen und farblich gekennzeichnet



Prozess durchgeführt