



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute

Nr. 58

Einführung internes Settlement

Zum 07.05.2012 wird es den Kreditinstituten optional möglich sein, das Settlement von Geschäften eines vom Institut definierten Kreises von CBF-Nummern (Verbund) selbst (intern) vorzunehmen. Geschäfte, die zwischen CBF-Konten dieses Nummernkreises entstehen, werden nicht an Clearstream weitergeleitet, so dass bei der Clearstream keine Buchung erfolgt.

Diese Regelung gilt für alle Geschäfte (maklervermittelt, börslich, außerbörslich, Bankdirekt) außer für INVESTRO-Geschäfte. Es gibt allerdings die konfigurierbare Verarbeitungsvariante, dass nur maklervermittelte (börsliche und außerbörsliche) Geschäfte intern abgewickelt werden, d.h. Bankdirektgeschäfte werden wie bisher an CBF gesendet. Stornierungen und Durchlieferungen werden immer so behandelt, wie das Ursprungsgeschäft; d. h. wurde das Geschäft nicht an Clearstream geliefert, so wird auch die Stornierung bzw. das Durchlieferungsgeschäft nicht an Clearstream geliefert und zwar unabhängig davon, ob sich der Nummernkreis für das interne Settlement zwischenzeitlich geändert hat.

Die Umbuchung von Stücken und Geld aus diesen Geschäften muss das Kreditinstitut intern selbst vornehmen.

Eventuell angefallene Kursdifferenzen und Courtage sind von der Regelung unberührt und werden wie bisher mit allen übrigen Geschäften automatisch über die Geldverrechnung bei der Clearstream verrechnet.

Geschäfte, die nicht an die Clearstream weitergeleitet werden, werden in den Schlussnoten entsprechend gekennzeichnet (außer im Online-Abruf in der Kurzform BxAG AK).

Da sich nicht alle Börsen dieser Maßnahme angeschlossen haben, können in die Verbundnummernkreise nur Kontonummern der teilnehmenden Börsen aufgenommen werden. Teilnehmende Börsen sind Berlin, Düsseldorf, Hamburg, Hannover, Stuttgart und München.

Der „Verbund“-Inhaber muss sicherstellen, dass alle Schlussnoten der Verbundnummern an die für ihn notwendige Adresse (Abwicklungsnummer) geschickt werden. Sollten hierzu Änderungen an dem bestehenden Schlussnotenversand notwendig sein, ist dies mit dem bekannten Formular für den Schlussnotenversand an BrainTrade zu melden.

Es ist auch möglich, eine Kassenvereinsnummer mehreren Verbundnummernkreisen zuzuordnen. Diese Geschäfte werden ebenfalls nicht an Clearstream weitergeleitet. In diesem Fall ist ein "Spitzenausgleich" zwischen den Abwicklern der Verbunde erforderlich. Die Institute müssen sich dann darüber einigen, wer den Spitzenausgleich vornimmt. Der Spitzenausgleich kann entweder durch ein Bankdirektgeschäft via separater (und dem Verbund nicht zugeordneter) KV-Nummern erfolgen, oder der Verbund, der den Spitzenausgleich vornimmt, entscheidet sich dafür, nur maklervermittelte Geschäfte nicht an CBF weiterzuleiten.

Die Einrichtung eines Verbunds kann ab dem produktiven Einsatz jederzeit erfolgen. Eine Vorgabe zur Einrichtung oder Änderung eines Verbundes, die der BrainTrade dienstags vorliegt, wird jeweils zum nächsten Montag umgesetzt. Test und Simulation sind ab sofort möglich.

Nachfolgend ist für jede Variante die Kennzeichnung gesondert beschrieben:

1) Online Abruf Langform (BxAG AL)

Auf der Schlussnote wird der Zusatz „NON-CBF-GESCHAEFT“ vermerkt.

```
TRAN: BRAG FC: AL SB: 010312#G#000001#####
XONTRO / ANZEIGE NACHWEISE (LANGFORM)                6123/99 FILDERBANK
                                                    ABRUF-NR.: G      1
KAUF - SCHLUSSNOTE                GNR      : S 120301 1080001
DE0005810055 DEUTSCHE BOERSE NA O.N.
                                                    V-ART: GS
NOM.: ST      22
                                                    KUNDENGESCHAEFT
KURS   : 50,0000      K-WERT: 1.100,00
KONT.: 6789 BAD SODENER BANK
EING.: 6321 MAKLER
                                                    NON-CBF-GESCHAEFT
ABR.-BETRAG: 1.100,00      EUR
BOSS/
      EINGABE: 1.03.12 09.11.26
      ABSCHLUSS: 1.03.12 07.11.00 AB
-- ID-KZ: 612356789 -- PW:      ----- B999805A -- 07/03/12 -- 08:20:14 --
BC0020I WEITERE DATEN VORHANDEN: PF8
```

2) SNO-DTA und Realtime-Note SWIFT-Format

Im MT 512 wird das Etikett 57B zur Kennzeichnung verwendet:

Etikett 57B: Informationen bei einem CCP-Geschäft 1a[/4n]
- Kennzeichen-CCP-Geschäft 1a
 'J' – CCP-Geschäft liegt vor
 'I' - internes Settlement liegt vor
- CBF-Nummer [4n]
 - des Clearing Teilnehmers bei einem CCP-Geschäft
 - des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei internem Settlement

Etikett 57B: Informationen bei einem CCP-Geschäft***Feld: Kennzeichen 'CCP-Geschäft' bzw. 'Internes Settlement':***

Alle Parkett- und Xetra-Geschäfte sowie OLN-Schlussnoten (Orderlevel Netting in Xetra Frankfurt bzw. Xetra Frankfurt 2) mit Kontrahent CCP, die zu einem so genannten CCP-Geschäft geführt haben, werden als solche gekennzeichnet. Diese CCP-Geschäfte sind im Brutto Liefermanagement (BLM) des CCP enthalten.

Geschäfte des internen Settlements werden mit der Konstanten „I“ gekennzeichnet; die mit 'I' gekennzeichneten Geschäfte werden nicht zur Belieferung an Clearstream weitergeleitet und müssen vom Empfänger (identisch mit dem Etikett 72, 2. Zeile) selbst verbucht werden.

Feld: CBF-Nummer (Clearing Teilnehmer bzw. Empfänger)

Hier wird der Clearer des Handelsteilnehmers (= NCM gemäß CCP-Kriterien) bei einem CCP-Geschäft (Xetra Frankfurt, Xetra Frankfurt 2 und Parkett) mit seiner CBF-Nummer mitgeteilt. In den Fällen, wo ein Eintrag in den Kundenstammdaten nicht vorhanden ist, wird dieses Feld nicht belegt.

Bei Geschäften des internen Settlements wird hier die CBF-Nummer des Empfängers der Geschäftsbestätigung (identisch mit dem Etikett 72, 2. Zeile) eingetragen.

3) Realtime-Note FIX-Format

Bei Tag 452 Party-Role = „21“ wird bei Non-CBF-Geschäften im Tag 448 Party-ID die Nummer des Schlussnoten-Empfängers geliefert.