



# **Schnittstellenbeschreibung für den Zugang zum Sicherheitsmanagement-System der Deutschen Bundesbank**

Version 17.0

# Inhalt

<b>1</b>	<b>ALLGEMEINES.....</b>	<b>5</b>
1.1	<b>EINLEITUNG .....</b>	<b>5</b>
1.2	<b>ZWECK DES DOKUMENTS.....</b>	<b>5</b>
1.3	<b>TECHNISCHE SPEZIFIKATION.....</b>	<b>6</b>
1.4	<b>ZUGANG ZU DEN POSTFÄCHERN FÜR PDF-DOKUMENTE UND XML-DATEIEN .....</b>	<b>8</b>
1.5	<b>ZUGANG ZUR BENUTZEROBERFLÄCHE „COLLATERALMANAGEMENT ACCESS PORTAL“ (CAP) .....</b>	<b>8</b>
<b>2</b>	<b>SICHERHEITENKONTO.....</b>	<b>9</b>
2.1	<b>ABFRAGE DES SICHERHEITENKONTOS.....</b>	<b>10</b>
2.1.1	ABFRAGE DES SICHERHEITENKONTOS A2A.....	10
2.1.1.1	ABFRAGE PER SWIFT MT 298.....	11
2.1.1.2	ANTWORT SICHERHEITENKONTOÜBERSICHT SWIFT MT 298.....	14
2.1.1.3	STATUSMELDUNG MT 298.....	18
2.1.2	ABFRAGE DES SICHERHEITENKONTOS U2A .....	20
2.2	<b>ZUSÄTZLICHE SICHERHEITENKONTEN.....</b>	<b>21</b>
2.2.1	ZWEITES SICHERHEITENKONTO – BESICHERUNG BBK-EIGENGESCHÄFTE.....	24
2.2.2	DRITTES SICHERHEITENKONTO – ZUSATZ-SICHERHEITENKONTO .....	28
<b>3</b>	<b>INSTRUKTIONEN FÜR KREDITINANSPRUCHNAHMEN UND DIE EINRICHTUNG EINER FESTEN KREDITLINE .....</b>	<b>30</b>
3.1	<b>ANTRAGSÜBERNACHTKREDIT .....</b>	<b>30</b>
3.1.1	ANTRAGSÜBERNACHTKREDIT VIA SWIFT .....	33
3.1.1.1	ANTRAGSÜBERNACHTKREDIT - INSTRUKTION MT 298.....	33
3.1.1.2	ANTRAGSÜBERNACHTKREDIT - STATUSMELDUNG SWIFT MT 298.....	36
3.1.2	ANTRAGSÜBERNACHTKREDIT VIA XML A2A.....	38
3.1.2.1	ANTRAGSÜBERNACHTKREDIT – INSTRUKTION XML.....	38
3.1.2.2	ANTRAGSÜBERNACHTKREDIT - STATUSMELDUNG XML .....	40
3.1.3	ANTRAGSÜBERNACHTKREDIT VIA EXTRANET CAP .....	43
3.2	<b>KREDITLINIE UND FESTE KREDITLINIE .....</b>	<b>44</b>
3.2.1.1	FESTE KREDITLINIE – INSTRUKTION MT 298.....	49
3.2.1.2	FESTE KREDITLINIE – STATUSMELDUNG MT 298 .....	52
3.2.2	FESTE KREDITLINIE VIA EXTRANET XML .....	54
3.2.2.1	FESTE KREDITLINIE – INSTRUKTION XML .....	54
3.2.2.2	FESTE KREDITLINIE – STATUSMELDUNG XML.....	56
3.2.3	FESTE KREDITLINIE VIA EXTRANET CAP .....	59
<b>4</b>	<b>FORMEN DER AUFTRAGSERTEILUNG IM RAHMEN DER NUTZUNG VON SICHERHEITEN .....</b>	<b>61</b>
4.1	<b>KONTOGUTHABEN (CASH COLLATERAL) .....</b>	<b>61</b>
4.1.1	KONTOGUTHABEN VIA SWIFT .....	63
4.1.1.1	EIN- UND AUSLIEFERUNG VON KONTOGUTHABEN MT 598.....	63
4.1.1.2	EIN- UND AUSLIEFERUNG VON KONTOGUTHABEN - STATUSMELDUNG MT 598 .....	66
4.1.2	KONTOGUTHABEN VIA EXTRANET XML .....	68
4.1.2.1	EIN- UND AUSLIEFERUNG VON KONTOGUTHABEN XML .....	68
4.1.2.2	EIN- UND AUSLIEFERUNG VON KONTOGUTHABEN - STATUSMELDUNG XML .....	71

4.1.3	KONTOGUTHABEN VIA EXTRANET CAP.....	73
<b>4.2</b>	<b>MARKTFÄHIGE SICHERHEITEN.....</b>	<b>76</b>
4.2.1	HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN.....	76
4.2.1.1	HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA SWIFT.....	77
4.2.1.1.1	HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA SWIFT DOMESTIC .....	77
4.2.1.1.1.1	EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 540 DOMESTIC (CBF-KONTO 7069) .....	77
4.2.1.1.1.2	STORNO EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 540 DOMESTIC.....	80
4.2.1.1.1.3	BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 544 DOMESTIC (CBF-KONTO 7069) .....	81
4.2.1.1.1.4	AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 542 DOMESTIC .....	85
4.2.1.1.1.5	STORNO AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 542 DOMESTIC.....	88
4.2.1.1.1.6	BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 546 DOMESTIC.....	89
4.2.1.1.1.7	STORNO BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 546 DOMESTIC .....	92
4.2.1.1.2	HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA SWIFT NACHRICHT IM LINK-VERFAHREN .....	93
4.2.1.1.2.1	EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 540 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM FRANKFURT (CBF-KONTO 7069) .....	93
4.2.1.1.2.2	STORNO EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 540 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM FRANKFURT (CBF KONTO 7069) .....	97
4.2.1.1.2.3	BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 544 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM FRANKFURT (CBF KONTO 7069) .....	98
4.2.1.1.2.4	STORNO EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 544 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM FRANKFURT (CBF KONTO 7069) .....	102
4.2.1.1.2.5	AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 542 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM FRANKFURT (CBF KONTO 7069) .....	103
4.2.1.1.2.6	STORNO AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 542 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM FRANKFURT (CBF KONTO 7069) .....	106
4.2.1.1.2.7	BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 546 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM FRANKFURT (CBF KONTO 7069) .....	107
4.2.1.1.2.8	STORNO BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 546 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM FRANKFURT (CBF KONTO 7069) .....	111
4.2.1.2	HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA EXTRANET XML .....	112
4.2.1.2.1	HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA EXTRANET XML DOMESTIC .....	112
4.2.1.2.1.1	EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML DOMESTIC .....	112
4.2.1.2.1.2	STORNO EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML DOMESTIC .....	118
4.2.1.2.1.3	BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML DOMESTIC .....	120
4.2.1.2.1.4	STORNO BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML DOMESTIC .....	126
4.2.1.2.1.5	AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML DOMESTIC .....	129
4.2.1.2.1.6	STORNO AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML DOMESTIC .....	135
4.2.1.2.1.7	BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML DOMESTIC .....	137
4.2.1.2.1.8	STORNO BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML DOMESTIC .....	143
4.2.1.2.2	HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA EXTRANET XML IM LINKVERFAHREN .....	146
4.2.1.2.2.1	EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM LINKVERFAHREN.....	146
4.2.1.2.2.2	STORNO EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM LINKVERFAHREN .....	152
4.2.1.2.2.3	BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM LINKVERFAHREN .....	154
4.2.1.2.2.4	STORNO BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM LINKVERFAHREN .....	160
4.2.1.2.2.5	AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM LINKVERFAHREN .....	163
4.2.1.2.2.6	STORNO AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM LINKVERFAHREN .....	169
4.2.1.2.2.7	BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM LINKVERFAHREN .....	171
4.2.1.2.2.8	STORNO BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM LINKVERFAHREN .....	177
4.2.1.3	HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA EXTRANET CAP .....	180
4.2.2	GRENZÜBERSCHREITENDE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN.....	187
4.2.2.1	GRENZÜBERSCHREITENDE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA SWIFT.....	188
4.2.2.1.1	EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 540 IM CCBM-VERFAHREN .....	188
4.2.2.1.2	STORNO EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 540 IM CCBM-VERFAHREN.....	192
4.2.2.1.3	BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 544 IM CCBM-VERFAHREN .....	193
4.2.2.1.4	STORNO BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 544 IM CCBM-VERFAHREN.....	197
4.2.2.1.5	AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 542 IM CCBM-VERFAHREN .....	198
4.2.2.1.6	STORNO AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 542 IM CCBM-VERFAHREN.....	202
4.2.2.1.7	BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 546 IM CCBM-VERFAHREN.....	203
4.2.2.1.8	STORNO BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 546 IM CCBM-VERFAHREN.....	207
4.2.2.2	GRENZÜBERSCHREITENDE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA EXTRANET XML .....	208

4.2.2.2.1	EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM CCBM-VERFAHREN.....	208
4.2.2.2.2	STORNO EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM CCBM-VERFAHREN .....	214
4.2.2.2.3	BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM CCBM-VERFAHREN .....	216
4.2.2.2.4	STORNO BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM CCBM-VERFAHREN .....	222
4.2.2.2.5	AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM CCBM-VERFAHREN.....	225
4.2.2.2.6	STORNO AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM CCBM-VERFAHREN .....	231
4.2.2.2.7	BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM CCBM-VERFAHREN .....	233
4.2.2.2.8	STORNO BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN XML IM CCBM-VERFAHREN .....	239
4.2.2.3	GRENZÜBERSCHREITENDE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA EXTRANET CAP .....	242
4.2.3	NUTZUNG VON TRIPARTY COLLATERAL MANAGEMENT SYSTEMEN .....	249
4.2.3.1	MODELL 1: XEMAC.....	250
4.2.3.2	MODELL 2: CMAX.....	252
4.2.3.2.1	EIGENSCHAFTEN MODELL 2.....	252
4.2.3.2.2	ÄNDERUNG GLOBALBETRAG CMAX .....	253
4.2.3.3	MODELL 3: AUTOSELECT .....	255
4.2.3.3.1	EIGENSCHAFTEN MODELL 3.....	255
4.2.3.3.2	INITIIERUNG/ÄNDERUNG GLOBALBETRAG/STORNIERUNG AUTOSELECT .....	256
4.2.4	STATUSNACHRICHTEN .....	259
4.2.4.1	STATUSNACHRICHT MT 548 .....	259
4.2.4.2	STATUSNACHRICHT XML.....	261
4.2.5	BESTÄTIGUNG VON ZINS- UND FÄLLIGKEITSAUHLUNGEN .....	262
<b>5</b>	<b>MITTEILUNGEN.....</b>	<b>264</b>
<b>5.1</b>	<b>TENDERABRECHNUNG .....</b>	<b>265</b>
5.1.1	TENDERABRECHNUNG VIA EXTRANET-POSTFACH .....	266
5.1.2	TENDERABRECHNUNG FÜR TEILNEHMER.....	274
5.1.2.1	TENDERABRECHNUNG FÜR TEILNEHMER BEI GESCHÄFTEN MIT FESTZINS VIA SWIFT MT 320.....	274
5.1.2.2	TENDERABRECHNUNG FÜR TEILNEHMER BEI GESCHÄFTEN MIT ZINSANPASSUNG (KEIN GLRG-III)/SPREADBASIERTE TENDERN VIA SWIFT MT 398.....	278
5.1.3	MITTEILUNG ÜBER DIE FESTSETZUNG DES SPREADSATZES BEI GEZIELTEN LÄNGERFRISTIGEN REFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (GLRG–III).....	281
5.1.3.1	MITTEILUNG ÜBER DIE FESTSETZUNG DES SPREADSATZES FÜR TEILNEHMER VIA SWIFT MT 320 .....	281
5.1.4	GUTSCHRIFT/BELASTUNG OFFENMARKTGESCHÄFT PACS.009/PACS.010 .....	285
<b>5.2</b>	<b>SICHERHEITENKONTO-MITTEILUNG VIA EXTRANET-POSTFACH .....</b>	<b>286</b>
<b>5.3</b>	<b>BESTANDSMITTEILUNG SICHERHEITENKONTO .....</b>	<b>287</b>
<b>5.4</b>	<b>BESTANDSAUFSTELLUNG DISPOSITIONSDEPOT.....</b>	<b>289</b>
5.4.1	BESTANDSAUFSTELLUNG DISPOSITIONSDEPOT VIA SWIFT MT 535.....	290
5.4.2	BESTANDSAUFSTELLUNG DISPOSITIONSDEPOT VIA EXTRANET XML.....	294
5.4.3	BESTANDSAUFSTELLUNG DISPOSITIONSDEPOT VIA EXTRANET CAP .....	304
<b>6</b>	<b>ROLLENKONZEPT CAP.....</b>	<b>305</b>

## Annex

- I. BIC-Adressen der Korrespondenzzentralbanken für die MT 540/542 – Nachrichten im CCBM Verfahren
- II. Glossar

# **1 Allgemeines**

## **1.1 Einleitung**

Im Rahmen des Sicherheitenmanagements stellt die Deutsche Bundesbank den Geschäftspartnern nach Hereinnahme refinanzierungsfähiger Sicherheiten mit den Rechtsinstituten Pfand und stille Sicherungsabtretung, einen Sicherheitenpool zur Verfügung. Buchhalterisches Kernelement des Sicherheitenpools ist das Sicherheitenkonto, in dem der bewertete Sicherheitenbestand, die Inanspruchnahmen, der freie Beleihungswert und die abhängig von der Sicherheitenkontoart ggf. an das in TARGET-BBk geführte primäre MCA-Konto übermittelte variable/feste Kreditlinie ausgewiesen werden.

## **1.2 Zweck des Dokuments**

Dieses Dokument beschreibt die Schnittstelle, die von Geschäftspartnern im Rahmen des Sicherheitenmanagements gegenüber der Deutschen Bundesbank zu nutzen ist. Es umfasst die A2A-Nutzung („application-to-application“), die sowohl über SWIFT und die MTs als auch über ExtraNet anhand von XML-Nachrichten stattfinden kann. Auch die U2A-Nutzung („user-to-application“), die ebenfalls über das ExtraNet CAP (Collateral Management Access Portal) möglich ist, ist im vorliegenden Dokument beschrieben. Bitte beachten Sie, dass das Dokument einer ständigen Weiterentwicklung unterliegt. Die Formate sowie die bereitgestellten CAP-Ansichten werden regelmäßig aktualisiert.

Es stehen – teilweise auf Eurosystemstandards beruhende – erweiterte Funktionen im Sicherheitenmanagement zur Verfügung. Diese werden beschrieben und die entsprechenden Instruktionswege aufgezeigt. Die Verfahren für die Einreichung nicht-marktfähiger Sicherheiten (MACCs) sowie zur Abgabe von Geboten für Offenmarktgeschäfte (OMTOS) sind nicht Gegenstand dieses Dokuments.

### 1.3 Technische Spezifikation

Für die A2A-Anbindung an das Sicherheitenmanagement-System stehen zwei technische Kommunikationskanäle zur Verfügung: SWIFT-Netzwerk oder gesicherte Internetverbindung (ExtraNet). Über diese technischen Kanäle können Geschäftspartner u. a. Ein- und Auslieferungen von Sicherheiten instruieren sowie Bestätigungen und Mitteilungen von der Bundesbank empfangen. Darüber hinaus ist eine U2A-Nutzung über ExtraNet in Verbindung mit der Benutzeroberfläche „CAP“ möglich.

Grundsätzlich ist es nicht nötig, sich auf die ausschließliche Nutzung eines Kommunikationskanals festzulegen. Antworten aus dem Sicherheitenmanagement-System der Deutschen Bundesbank entsprechen hinsichtlich Kommunikationskanal und Format der von Ihnen versandten Eingangsnachricht (Bsp.: Eingang einer SWIFT-Nachricht im Sicherheitenmanagement-System der Bundesbank führt auch zu einer SWIFT-Ausgangsnachricht). Für Nachrichten, die nicht in Folge einer von Ihnen versandten Nachricht initiiert werden (hierbei handelt es sich im Wesentlichen um die unter Mitteilungen aufgeführten Nachrichtentypen), ist die Festlegung auf einen Kommunikationskanal nötig. Dies gilt nicht für solche Mitteilungen, für die der Kommunikationskanal bereits eindeutig vorgegeben ist (Bsp.: Sicherheitenkontomitteilungen).

Für den Fall, dass ein Kommunikationskanal für einen Geschäftspartner nicht verfügbar ist, kommt als Contingency-Verfahren das Faxverfahren zur Übermittlung von Aufträgen an die Bundesbank zur Anwendung. Dieses Verfahren setzt zwingend die vorherige Rücksprache mit der Bundesbank (Sicherheitenmanagement Z51, Tel.: +49 (0)69/2388- 2477) voraus.

Bei der Nicht-Verfügbarkeit eines Kommunikationskanals für alle Geschäftspartner (technisches Problem seitens der Bundesbank) informiert die Bundesbank (Sicherheitenmanagement Z51) die Geschäftspartner, dass das Faxverfahren als Contingency-Verfahren zur Anwendung kommt.

Auf der Homepage der Deutschen Bundesbank ([www.bundesbank.de](http://www.bundesbank.de)) stehen unter dem angegebenen Pfad die notwendigen Faxvordrucke für das Contingency-Verfahren zur Verfügung:

[Aufgaben → Geldpolitik → Notenbankfähige Sicherheiten → Downloads → Vordrucke](#)

Für die Nutzung der A2A-Anbindung, bei der Nachrichten im SWIFT-Format und im XML-Format über das ExtraNet (Internet-File-Transfer) versandt werden können, weisen wir darauf hin, dass der Geschäftspartner die Nachrichten mit einer einmaligen Referenz zu versehen hat, damit eine reibungslose Verarbeitung im System der Bundesbank ermöglicht werden kann.

Vor der erstmaligen Nutzung eines Kommunikationskanals ist ein Testverfahren zu durchlaufen, das mit einer Zertifizierung abschließt. Nähere Informationen dazu sind in dem jeweiligen Testleitfaden für die Teilnahme am Sicherheitenmanagement-System der Deutschen Bundesbank via U2A/CAP bzw. A2A (SWIFT und XML) auf der Homepage der Deutschen Bundesbank unter

[Aufgaben → Unbarer Zahlungsverkehr → Sicherheitenkonto → Neukundeninformationen → Formulare](#)

eingestellt.

## 1.4 Zugang zu den Postfächern für PDF-Dokumente und XML-Dateien

Der Zugriff auf das ExtraNet Postfach erfolgt über den Link:

<https://extranet.bundesbank.de/FT/>

Um sich im Postfach des ExtraNets einzuloggen, sind die User-ID und das Passwort für die ExtraNet Produktionsumgebung in den Textfeldern auf der Startmaske einzugeben.

Kundenanschriften bzw. mit dem Sicherheitenkonto im Zusammenhang stehende Mitteilungen können über den Button „Datei-Download“ heruntergeladen werden. Im nächsten Schritt ist dem Link „Abholung pdf-Kundenanschriften“ zu folgen.

Weitere Informationen zu Aufbewahrungsfristen und dem Empfang von Mitteilungen sind in Abschnitt 5 der Schnittstellenbeschreibung enthalten.

## 1.5 Zugang zur Benutzeroberfläche „Collateralmanagement Access Portal“ (CAP)

Der Zugriff über ExtraNet auf die Benutzeroberfläche „Collateral management Access Portal (CAP) erfolgt über den Link:

<https://extranet.bundesbank.de/cap/>

Um sich über das ExtraNet in CAP anzumelden, sind die User-ID und das Passwort für die ExtraNet Produktionsumgebung in den Textfeldern auf der Startmaske einzugeben. Nach erfolgter Anmeldung gelangt man in die Hauptmaske und von dort über Aufträge zu den entsprechenden Auftragsfunktionen.



## 2 Sicherheitenkonto

Im Sicherheitenkonto wird der bewertete Sicherheitenbestand der gesamten Inanspruchnahme gegenübergestellt. So wird sichergestellt, dass jede Kreditinanspruchnahme hinreichend durch refinanzierungsfähige Sicherheiten gedeckt ist. In diesem Zusammenhang ist zu beachten, dass bezüglich des geldpolitischen Sicherheitenkontos

- für alle ausstehenden und neu abzuschließenden Offenmarktkredite die aufgelaufenen, täglich abgegrenzten Zinsen mitzubesichern sind.
- für Termineinlagen, die als Sicherheiten genutzt werden, die aufgelaufenen Zinsen entsprechend auch als Sicherheit berücksichtigt werden.

Auf Antrag besteht die Möglichkeit weitere Sicherheitenkonten einzurichten, so z. B. jeweils eines für die Besicherung von Bundesbankeigengeschäften, wie den Zentralbankservice (Sicherheitenkonto BBk-Eigengeschäfte) oder für den TARGET Contingency-Fall (Zusatz-Sicherheitenkonto). Die Nummern der Sicherheitenkonten eines Geschäftspartners unterscheiden sich allein an der 6. Stelle (geldpolitisches Sicherheitenkonto: „1“, Sicherheitenkonto BBk-Eigengeschäfte: „2“ und Zusatz-Sicherheitenkonto: „3“).

<u>Nummer</u>	<u>Name</u>	<u>Funktion</u>
1	Geldpolitisches Sicherheitenkonto	Besicherung von geldpolitischen Operation (inkl. Kreditlinie für TARGET)
2	Sicherheitenkonto BBk-Eigengeschäfte	Besicherung von Bundesbankeigengeschäften, wie z.B. Zentralbankservice
3	Zusatz-Sicherheitenkonto	TARGET Contingency-Fall

Es gibt noch weitere Sicherheitenkonten, die aber im Rahmen der Schnittstellenbeschreibung keine Relevanz haben und im weiteren Verlauf nicht näher beschrieben werden.

## 2.1 Abfrage des Sicherheitenkontos

### 2.1.1 Abfrage des Sicherheitenkontos A2A

Geschäftspartner, die den Kommunikationskanal A2A SWIFT nutzen, können auf diesem Wege Informationen zum Sicherheitenkonto abrufen. Die Möglichkeit zur Abfrage besteht zwischen 6:40 und 17:45 Uhr, zusätzlich in der Regel zwischen 19:00 und 19:30 Uhr. Dies gilt auch am Mindestreserve-Ultimo. Tagesendbestände sind durch Angabe der entsprechenden Valuta auch ex post abrufbar. So kann ab 19:00 Uhr durch Angabe der entsprechenden Valuta der Tagesendbestand des vorangegangenen Geschäftstages abgerufen werden. Die Abfrage des Sicherheitenkontos wird durch ein SWIFT MT 298 seitens des Geschäftspartners initiiert, daraufhin wird ebenfalls ein SWIFT MT 298 an den Geschäftspartner gesendet, das die Summe der einzelnen Sicherheitenarten und Arten der Inanspruchnahme sowie Angaben zum freien Beleihungswert und zur Kreditlinie beinhaltet.

Informationen zu den in den Statusmeldungen für die Abfrage des Sicherheitenkontos verwendeten Reason-Codes können Sie nachstehender Tabelle entnehmen:

FALL\ TYP	Abfrage Sicherheitenkonto
<b>Fehlende/falsche Sicherheitenkontonummer</b>	:24B::REJT//SAFE
	:70D::REAS// Sicherheitenkontonummer falsch
<b>Valutadatum fällt auf Wochenende oder TARGET-Feiertag</b>	:24B::REJT//LATE
	:70D::REAS//kein Geschäftstag
<b>Anfrage außerhalb der Geschäftszeit</b>	:24B::REJT//LATE
	:70D::REAS//keine Geschäftszeit
<b>Valutadatum in der Zukunft</b>	:24B::REJT//DDAT
	:70D::REAS//Valuta nicht erlaubt
<b>Absender nicht erlaubt</b>	:24B::REJT//BPAR
	:70D::REAS//Sender nicht bevollmächtigt
<b>Kombination MEOR- SAFE nicht erlaubt</b>	:24D::REJT//SAFE Sicherheitenkontonummer, BIC oder MFI falsch
	:70D::REAS// Sicherheitenkontonummer, BIC oder MFI falsch

### 2.1.1.1 Abfrage per SWIFT MT 298

Der Geschäftspartner sendet die Abfrage Sicherheitenkonto an die SWIFT-Adresse der Deutschen Bundesbank: MARKDEFFOBS

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
M	20		Reference	Sender's Reference	16x Must be unique per sender BIC and per message Type and subtype
M	12		Subtype		3!n The fixed value (200)
M	77E		Proprietary		73x[n*78x] Contains a proprietary payload

Mandatory Sequence A – General Information

M	16R	GENL			
M	23G	NEWM	Function of the message		"NEWM" for a new message

Sequence A1 – Request of Safekeeping Account Information

M	16R	ACCI	Safekeeping Account Information		
M	95 P or R	MEOR	Originator of Message	Option P or R	Option P :4!c//4!a2!a2!c[3!c] Option R :4!c/8c/2!c32x ID of counterparty for which the instruction is executed. Technical sender (e.g. BIC) can differentiate from the counterparty, if the counterparty authorizes the

					<p>sender to send the messages on its behalf.</p> <p>In case of option R, the proprietary code has to be in the MFI format. Moreover the data source scheme code shall be always EMFI.</p> <p>The convention is as follows: the MFI ID code can be alphanumerical, with the first two digits being the two-digit ISO code for the country of residence of the MFI and the remaining number of digits (no limit has been specified) can be any combination of alphanumerical characters.</p>
M	97A	SAFE	Safekeeping Account		<p>:4!c//35x</p> <p>Contains the Sicherheitenkontonummer in local CMS</p>
M	98A	VALU	Value Date		<p>:4!c//8!n</p> <p>The value date of the safekeeping</p>

					account information instruction
	16S	ACCI	Safekeeping Account information		
	16S	GENL			

### 2.1.1.2 Antwort Sicherheitenkontoübersicht SWIFT MT 298

Die Deutsche Bundesbank versendet die Sicherheitenkontoübersicht (Sender BIC: MARKDEFFOBS) an den Geschäftspartner.

Bitte beachten Sie Folgendes: Inanspruchnahmen aufgrund von Offenmarktgeschäften, Antragsübernachtungskrediten und/oder Sperren werden als negativer Bestand dargestellt. Dies äußert sich in den entsprechenden Bereichen mit dem Buchstaben „N“ vor dem Währungscode.

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
M	20		Reference	Sender's Reference	16x Must be unique per sender BIC and per message Type and subtype
M	12		Subtype		3!n The fixed value (202)
M	77E		Proprietary		73x[n*78x] Contains a proprietary payload

#### Mandatory Sequence A – General Information

M	16R	GENL			
M	23G	NEWM	Function of the message		“NEWM” for a new message
M	98C	PREP	Preparation Date/Time		:4!c//8!n6!n
M	22F	SFRE			:4!c/[8c]/4!c :SFRE//ADHO für Ad hoc Anfrage
M	95P oder R	ACOW	Party	Option P or R	Option P :4!c//4!a2!a2!c[3!c] Option R :4!c/8c/34x Option P: :ACOW//BIC des Kunden, Option R: :ACOW/EMFI/MFI-code

M	97A	SAFE	Safekeeping Account		:4!c//35x Sicherheitenkontonr.
---	-----	------	---------------------	--	-----------------------------------

Sequence A1 – Linkages

	16R	LINK			
M	20C	RELA	Reference		:4!c//16x :RELA//16x Contains the message reference of the linked message which was previously sent by the counterparty
	16S	LINK			

Sequence A2 – Repetitive Subsequence - Summary

M	16R	SUMM			
M	19A	TOVA	Total Collateral Value		:4!c//3!a15d :TOVA//EUR0,
M	98A	VALU	Value date		:4!c//8!n :VALU//YYYYMMDD

Sequence A2a – Repetitive Subsequence – Securities sub Balance

	16R	SECBAL			
	16R	SUBBAL			
M	19A	COVA	Currency, Amount		:4!c//3!a15d :COVA//EUR0,
M	97A	SAFE	Account		:4!c//35x :SAFE//Dispositionsdepot
	16S	SUBBAL			
	16R	SUBBAL			
M	19A	COVA	Currency, Amount		:4!c//3!a15d :COVA//EUR0,
M	97A	SAFE	Account		:4!c//35x :SAFE//MACCs
	16S	SUBBAL			
	16R	SUBBAL			
M	19A	COVA	Currency, Amount		:4!c//3!a15d :COVA//EUR0,
M	97A	SAFE	Account		:4!c//35x :SAFE//Sonstige Sicherheiten
	16S	SUBBAL			
	16R	SUBBAL			
M	19A	COVA	Currency, Amount		:4!c//3!a15d :COVA//EUR0,

M	97A	SAFE	Account		:4!c//35x :SAFE//Termineinlagen
	16S	SUBBAL			
	16R	SUBBAL			
M	19A	COVA	Currency, Amount		:4!c//3!a15d :COVA//EUR0,
M	97A	SAFE	Account		:4!c//35x :SAFE//Triparty
	16S	SUBBAL			
	16R	SUBBAL			
M	19A	COVA	Currency, Amount		:4!c//3!a15d :COVA//EUR0,
M	97A	SAFE	Account		:4!c//35x :SAFE//Cash Collateral
	16S	SUBBAL			
	16S	SECBAL			
	16S	SUMM			

End of Sequence A2a – Repetitive Subsequence – Securities Sub Balance

	16R	SUMM			
M	93B	TOCP	Total out- standing credit posi- tion		:4!c//[N]3!a15d :TOCP//[N]EUR0,
M	98A	VALU	Value date		:4!c//8!n :VALU//YYYYMMDD

Sequence A2b – Repetitive Subsequence – Outstanding Credit Position Sub Balance

	16R	CREBAL			
	16R	SUBBAL			
M	19A	OMCO	Open Market Credit Opera- tion		:4!c//[N]3!a15d :OMCO//[N]EUR0,
	16S	SUBBAL			
	16R	SUBBAL			
M	19A	FRZG	Credit Freez- ing BBk		:4!c//[N]3!a15d :FRZG//[N]EUR0,
	16S	SUBBAL			
	16R	SUBBAL			
M	19A	FRZG	Credit Freez- ing Counter- party		:4!c//[N]3!a15d :FRZG//[N]EUR0,



	16S	SUBBAL			
	16R	SUBBAL			
M	19A	MLOR	Marginal Lending on Request		:4!c//[N]3!a15d :MLOR//[N]EUR0,
	16S	SUBBAL			
	16S	CREBAL			
	16S	SUMM			

Sequence A3 – Repetitive Subsequence A3 - Limits

	16R	LIMT			
M	19A	FRCV	Freier Beleihungswert		:4!c//[N]3!a15d :FRCV//EUR0,
	16S	LIMT			
	16R	LIMT			
O	19A	FCRL	Feste Kreditlinie		:4!c//3!a15d :FCRL//EUR0,
	16S	LIMT			
	16R	LIMT			
M	19A	AVCL	Verfügbare Kreditlinie		:4!c//3!a15d :AVCL//EUR0,
	16S	LIMT			
	16S	GENL			

### 2.1.1.3 Statusmeldung MT 298

Die Deutsche Bundesbank versendet die Statusmeldung für die Abfrage Sicherheitenkonto (Sender BIC: MARKDEFFOBS) an den Geschäftspartner.

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
M	20		Reference	Sender's Reference	16x Must be unique per sender BIC and per message Type and subtype
M	12		Subtype		3!n The fixed value (201) is used
M	77E		Proprietary		73x[n*78x] Contains a proprietary payload

#### Mandatory Sequence A – General Information

M	16R	GENL			
M	23G		Function of Message		INST Fixed value "INST" meaning is "Transaction status"

#### Sequence A1 – Linkages (Repetitive)

	16R	LINK			
M	20C	RELA	Reference		:4!c//16x :RELA//16x Contains the message reference of the linked message which was previously sent by the counterparty
	16S	LINK			

#### Sequence A2 – Status

M	16R	STAT			
M	25D	IPRC	Status		:IPRC//<status code> Qualifier = IPRC (Instruction process status) Status Code= REJT (Instruction has been rejected for further processing)

Sequence A2a – Reason (used if Status = IPRC//REJT)

M	16R	REAS			
M	24B	REJT	Reason		::REJT/[8c]/4!c Reason Codes Die verwendeten Reason Codes sind der Tabelle in Abschnitt 2.1 zu entnehmen
O	70D	REAS	Narrative		:4!c//6*35x Additional unstructured information (siehe Tabelle in Abschnitt 2.1)
	16S	REAS			
	16S	STAT			
	16S	GENL			

## 2.1.2 Abfrage des Sicherheitenkontos U2A

Beispiel: Abfrage des Sicherheitenkontos über ExtraNet CAP

The screenshot displays the 'Sicherheitenkonto' (Collateral Account) query results in the ExtraNet CAP interface. The interface includes a navigation menu on the left with options like 'AUSWERTUNGEN', 'SICHERHEITENPOOL 1-5', 'AUFTRÄGE', and 'SUPPORT'. The main content area shows the account details for 'Sicherheitenkonto, Sicherheitenkontonummer: 999999999'. The 'per Datum' is set to '2023-08-04'. The 'Auswertung per' is also '2023-08-04'. The table below shows the account balance and various items.

Sicherheiten	Betrag	Inanspruchnahmen	Betrag
Dispositionsdotpotbestände	2.898.714,38 EUR	Offenmarktkredite	0,00 EUR
Triparty	0,00 EUR	Antragsübermachtkredit	0,00 EUR
Kredittforderungen	0,00 EUR	Bundesbankspenen	0,00 EUR
Termineinlagen	0,00 EUR	Kundenspenen	0,00 EUR
Sonstige Sicherheiten	0,00 EUR		
Cash Collateral	0,00 EUR		
<b>Gesamt</b>	<b>2.898.714,38 EUR</b>	<b>Gesamt</b>	<b>0,00 EUR</b>
		Freier Beleihungswert	2.898.714,38 EUR
		Feste Kreditlinie	100.000.000,00 EUR
		Verfügbare Kreditlinie in T2	2.898.714,38 EUR

Über den Kalenderbutton erfolgt die Eingabe bzw. die Auswahl des Datums für die Abfrage der Daten des Sicherheitenkontos. Standardmäßig wird der aktuelle Tag vorbelegt. Das gerade angezeigte Auswertungsdatum wird als „Auswertung per“ angezeigt. Die Daten sind für die letzten 90 Kalendertage abrufbar.

## 2.2 Zusätzliche Sicherheitenkonten

Die Deutsche Bundesbank bietet die Führung weiterer Sicherheitenkonten<sup>1</sup> für Zwecke außerhalb der Geldpolitik an.

Das Sicherheitenkonto 2 „Besicherung BBk-Eigengeschäfte“ dient der Besicherung von bundesbankeigenen Geschäften, wie z. B. Tages- und Zeitgelder in Euro und Devisengeschäfte.

Das Sicherheitenkonto 3 „Zusatz-Sicherheitenkonto“ steht für den TARGET Contingency-Fall (ECONS-II) zur Verfügung.

Alle Sicherheitenkonten unterscheiden sich, wie in den folgenden Abschnitten dargestellt, hinsichtlich der Arten der zulässigen Sicherheiten und der Inanspruchnahmen. Ihnen ist gemein, dass keine Verbindung zum primären MCA-Konto in TARGET-BBk, auf dem die Kreditlinie geführt wird, besteht.

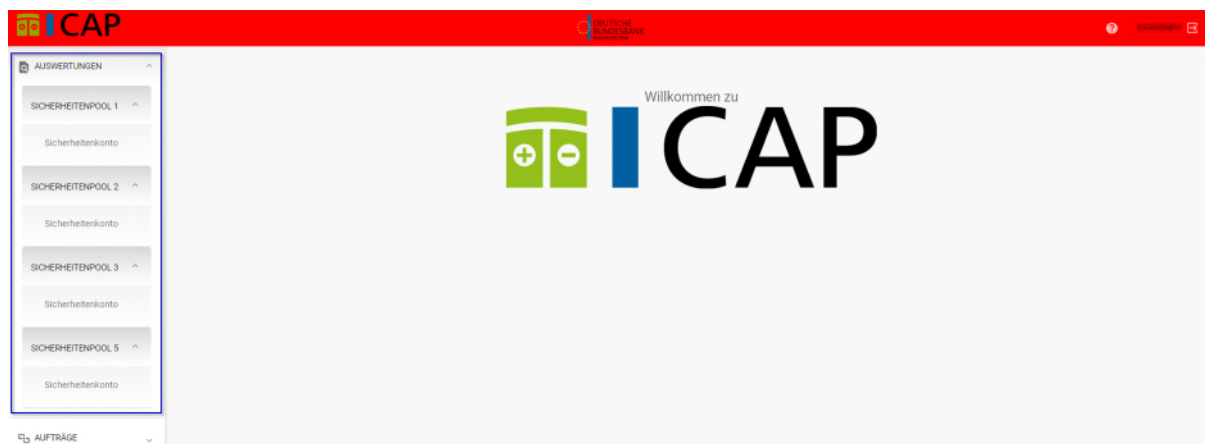
Abgesehen von der genannten Funktionsbeschränkung unterscheiden sich die beiden zusätzlichen Sicherheitenkonten bezüglich der Erteilung von Instruktionen nicht von dem geldpolitischen Sicherheitenkonto. Das Rollenkonzept wurde um Berechtigungsrollen für das zweite und dritte Sicherheitenkonto erweitert (siehe Abschnitt 6). Im Bedarfsfall sind bei eröffneten zusätzlichen Sicherheitenkonten die zusätzlichen Rollen für das entsprechende Sicherheitenkonto auf dem Wege der Folgeregistrierung zu beantragen. Es stehen die bereits etablierten Kommunikationskanäle zur Verfügung.

So kann die Sicherheitenkontoabfrage ebenso wie beim geldpolitischen Sicherheitenkonto U2A über CAP oder A2A per SWIFT erfolgen.

---

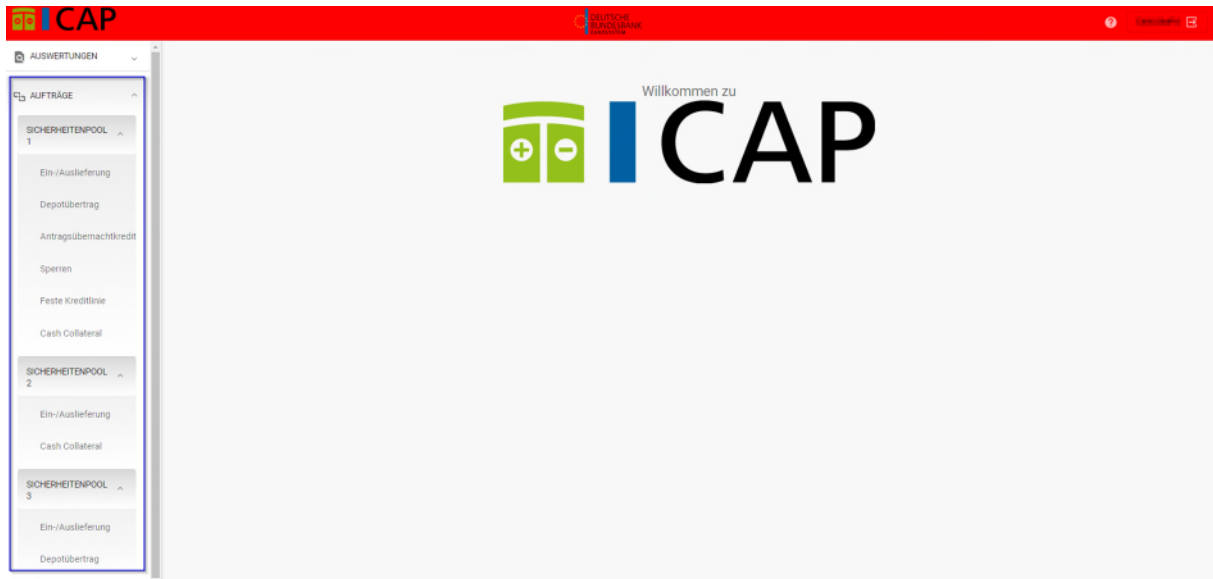
<sup>1</sup> In der Anwendung CAP werden diese mit dem Begriff „Sicherheitenpool“ bezeichnet.

Die Abfrage der Sicherheitenkonten über CAP erfolgt über den Menüpunkt „Auswertungen“:



Über CAP können direkte Umbuchungen zwischen zwei Wertpapierdepots eines Geschäftspartners vorgenommen werden. Mit der Führung mehrerer Sicherheitenkonten und der zugehörigen Wertpapierdepots besteht darüber hinaus eine Umbuchungsfunktion zwischen den Wertpapierdepots eines Geschäftspartners, die unterschiedlichen Sicherheitenkonten zugeordnet sind (z.B. dem geldpolitischen Sicherheitenkonto und dem Sicherheitenkonto für den TARGET Contingency-Fall bzw. dem Sicherheitenkonto für die Besicherung von BBk-Eigen­geschäften). Hier ist zu berücksichtigen, dass Umbuchungen von CCBM-Beständen aus dem Dispositionsdepot in das Wertpapierdepot des zweiten Sicherheitenkontos aufgrund des fehlenden Nutzungsbezugs zur Geldpolitik nicht möglich sind. Weitere Bedingung ist, dass sich die Lagerstelle des Wertpapiers nicht verändert. Alternativ besteht die Möglichkeit, Umbuchungen über gleichzeitige Aus- und Einlieferungen vorzunehmen.

Instruktionen über U2A CAP können über den Menüpunkt „Aufträge“ durchgeführt werden:



### **2.2.1 Zweites Sicherheitenkonto – Besicherung BBk-Eigengeschäfte**

Die Deutsche Bundesbank bietet im Rahmen des Eurosystem Reserve Management Services (ERMS) ausländischen Notenbanken und internationalen Organisationen an, in deren Auftrag hereingenommene Zeitgelder am Geldmarkt anzulegen. Aus Risikogesichtspunkten erfolgt die Wiederanlage bei ausgewählten Geschäftspartnern gegen Stellung von dafür zulässigen Sicherheiten (Teilmenge der EADB).

Die Nummer dieses zweiten Sicherheitenkontos folgt dem Aufbau „xxxxx23xxx“, das zugehörige Wertpapierdepot hat die Depotnummer -070.

Über die Bundesbanksperrung erfolgt im zweiten Sicherheitenkonto die Besicherung von ERMS-Zeitgeldern sowie die Absicherung des Devisenhandels und eventueller sonstiger Geschäfte.

Zu beachten ist, dass keine Anbindung mittels einer Kreditlinie an das primäre MCA-Konto in TARGET-BBk des Geschäftspartners besteht.



Zum Zwecke der Disposition erhalten die Geschäftspartner über die ExtraNet-Anwendung CAP Sicht auf das zweite Sicherheitenkonto, welches schematisch wie folgt aufgebaut ist:



### **Zulässige Sicherheiten:**

Zum Kreis der Sicherheiten für ERMS-Zeitgeldanlagen, Devisen- und sonstige Geschäfte gehören ausgewählte Kategorien an notenbankfähigen Wertpapieren der EADB, die zudem einer Mindestbonität genügen müssen, sowie im Falle einer Unterdeckung eines laufenden Geschäfts Cash Collateral. Darüber hinaus ist der heimische Triparty-Collateral Management Service Xemac zur Sicherheitenstellung zugelassen.

### **Zugelassene Wertpapiere im Wertpapierdepot (Depotart –070)**

Für die Besicherung zulässig sind bestimmte Wertpapiere der EADB. Die Deutsche Bundesbank stellt den betroffenen Geschäftspartnern diesbezüglich geschäftstätig eine elektronisch auswertbare Übersicht über die zulässigen Sicherheiten per Mail zur Verfügung.

Die zugelassenen Wertpapiere dürfen nur über Clearstream Banking Frankfurt und über vom Eurosystem genehmigte direkte und indirekte Links zwischen Clearstream Banking Frankfurt

und anderen (internationalen) Zentralverwahren eingeliefert werden ([assessed Eurosystem direct Links/relayed Links](#)). Die Nutzung von über das CCBM-Verfahren mobilisierten Wertpapieren ist nicht zulässig.

Wertpapiere, die die Zulassung für das BBk-Eigengeschäft verlieren, werden mit EUR 0, -- bewertet. Weitere Aktionen sind zwischen der Bank und dem Depotinhaber zu vereinbaren.

### Cash Collateral

Die Bundesbank nimmt zur Besicherung im Unterdeckungsfall zur Sicherheitenverstärkung auch Kontoguthaben (Cash Collateral) im Wege der Verpfändung als Sicherheit herein. Hinsichtlich der Nutzung für das zweite Sicherheitenkonto ist Cash Collateral auf eine Höhe von 250 Mio. € beschränkt.

Für die Nutzung von Cash Collateral ist ein MCA-Konto in TARGET-BBk erforderlich. Nach dem Eingang des Auftrags zieht die Bundesbank den entsprechenden Betrag von dem primären MCA-Konto in TARGET-BBk des Geschäftspartners ein. Die Freigabe des Cash Collateral erfolgt, indem der entsprechende Betrag auf dem primären MCA-Konto in TARGET-BBk des Geschäftspartners wieder gutgeschrieben wird.

Wegen der Beschränkung von Cash Collateral auf den o.a. Betrag erfolgt geschäftstäglich um 10:45 Uhr eine automatisierte, gleichtägige Freigabe des Cash Collaterals in dem Umfang, in dem dieses nicht mehr als Sicherheit erforderlich ist (automatische Auskehrung). Eine Freigabe von Cash Collateral z.B. bei Nachlieferung von Wertpapieren nach der automatischen Auskehrung um 11:00 Uhr auf Initiative des Geschäftspartners ist geschäftstäglich innerhalb 7:00-16:00 Uhr möglich.

Cash Collateral wird nicht verzinst. Beträgt der Zinssatz des Eurosystems für die geldpolitische Einlagefazilität aber weniger als 0% p.a., erhebt die Bank ein Entgelt in Höhe des jeweils aktuellen Satzes der geldpolitischen Einlagefazilität abzüglich 15 Basispunkten. Die daraus resultierenden Zinszahlungen werden um 7:00 Uhr des auf die Hereinnahme als Sicherheit folgenden Geschäftstages fällig. Die Zinsen werden dem Konto belastet, von dem das Kontoguthaben abgebucht wurde.

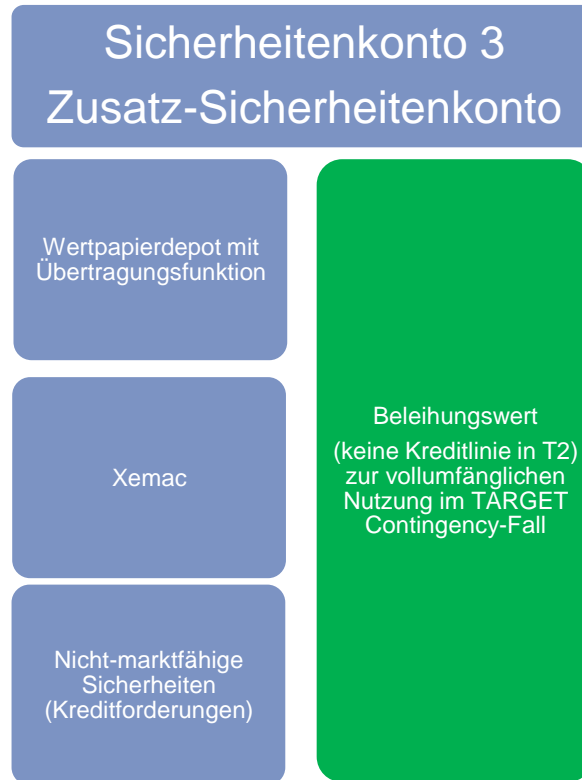
## Xemac

Zur Nutzung von Xemac ist ein separater eigens an das zweite Sicherheitenkonto angebundener Xemac-Vertrag erforderlich. Für die Bezeichnung ist in der Vertragsdefinition „Deutsche Bundesbank SIPO2“ anzugeben. Durch diese Vertragsdefinition wird sichergestellt, dass nur die für BBk-Eigengeschäfte zugelassenen Wertpapiere in Xemac allokiert werden. Die Einrichtung des separaten Xemac-Vertrags zum zweiten Sicherheitenkonto ist der Bundesbank formlos per Mail an [sicherheitenmanagement@bundesbank.de](mailto:sicherheitenmanagement@bundesbank.de) mitzuteilen.

### **2.2.2 Drittes Sicherheitenkonto – Zusatz-Sicherheitenkonto**

Das dritte Sicherheitenkonto dient der Vorsorge für den TARGET Contingency-Fall. Die Sicherheitenkontonummer hat den Aufbau „xxxxx33xxx“. Im dritten Sicherheitenkonto sind die Sicherheitenarten Wertpapierdepot (Depotnummer -040), der heimische Triparty-Collateral Management Service Xemac und nicht-marktfähige Sicherheiten (Kreditforderungen) zugelassen. Wertpapiere können durch eine Sicherheiteneinlieferung oder durch Umbuchung von einem bundesbankinternen Dispositions-/Wertpapierdepot eingeliefert werden. Die Nutzung von über das CCBM-Verfahren mobilisierten Wertpapieren sind zulässig. Die Sicherheiteneinlieferung über genehmigte direkte/indirekte Links ist zugelassen. Darüber hinaus gelten hinsichtlich der Zulässigkeit der Wertpapiere – sowohl für die Nutzung des Wertpapierdepots als auch für die Nutzung von Xemac – die gleichen Anforderungen wie für das geldpolitische Sicherheitenkonto. Zur Nutzung von Xemac ist ein separater eigens an das dritte Sicherheitenkonto angebundener Xemac-Vertrag erforderlich. Die Zuordnung des separaten Xemac-Vertrags zum dritten Sicherheitenkonto ist der Bundesbank formlos per Mail an sicherheitenmanagement@bundesbank.de mitzuteilen. Die Nutzung nicht-marktfähiger Sicherheiten (Kreditforderungen) für den TARGET Contingency-Fall wird über das Fachverfahren MACCs verwaltet. Der Beleihungswert des Zusatz-Sicherheitenkontos wird im TARGET Contingency-Fall in seiner Gesamtheit für den Einschuss in das Enhanced Contingency-Modul II (ECONS II) genutzt. Aufgrund der nicht vorhandenen Anbindung an ein primäres MCA-Konto in TARGET-BBk kann das Sicherheitenkonto auch bei eingetretenem TARGET Contingency-Fall verstärkt werden (Einlieferung von Wertpapieren und Erhöhung des Globalbetrages, beide jedoch nicht zu Lasten des geldpolitischen Sicherheitenkontos).

Das Zusatz-Sicherheitenkonto ist wie folgt aufgebaut:



### **3 Instruktionen für Kreditinanspruchnahmen und die Einrichtung einer festen Kreditline**

Für alle unten aufgeführten Auftragsarten gilt das Prinzip der Taggleichheit. Das Anfangsdatum muss dem aktuellen Datum entsprechen. Das Enddatum ist als „fällig am“ zu verstehen. Der Datumswechsel im Sicherheitenmanagement-System der Bundesbank wurde an den Datumswechsel von TARGET angepasst.

#### **3.1 Antragsübernacht kredit**

Die Bank gewährt Geschäftspartnern gegen Besicherung im Rahmen ihres Sicherheitenkontos zur Deckung eines vorübergehenden Liquiditätsbedarfs Übernachtskredit bis zum Beginn des nächsten Geschäftstages zu dem von der EZB für die Spitzenrefinanzierungsfazilität festgelegten Zinssatz (s. AGB/BBk V Nr. 22).

Die Inanspruchnahme des Übernachtskredites erfolgt auf Antrag eines Geschäftspartners (Antragsübernacht kredit) zur Generierung eines Guthabensaldos auf dem primären MCA-Konto. Vor der Buchung in TARGET erfolgt die Verbuchung im Sicherheitenkonto, mit der Konsequenz einer Reduzierung des freien Beleihungswertes.

Die Einreichung des Antrages muss geschäftstäglich bis 15 Minuten nach TARGET-Schluss (i. d. R. somit bis 18:15 Uhr), am letzten Geschäftstag einer Mindestreserve-Erfüllungsperiode bis 30 Minuten nach TARGET-Schluss (i.d.R. somit bis 18:30 Uhr) erfolgen. Bei TARGET-Betriebsverlängerungen verschiebt sich auch der Annahmeschluss für Übernachtskreditanträge um die entsprechende Zeitspanne. Eine Rücknahme bzw. Änderung des Antragsübernacht kredites ist nach Annahmeschluss nicht mehr möglich. Geschäftspartner können pro Valuta-Tag nur einen Antragsübernacht kredit beantragen.

Bei Eingang des Antrages im Laufe des Tages bis 18:00 Uhr wird dem Geschäftspartner, wenn dieser den Antragsübernacht kredit per SWIFT-Nachricht instruiert hat, anhand einer Statusmeldung per SWIFT MT 298/XML-Äquivalent mit Status-Code „PACK“ bestätigt,

dass der Auftrag zur Verarbeitung eingegangen ist. Ist für einen vom Geschäftspartner beantragten Übernachtkredit keine ausreichende Deckung auf dem Sicherheitenkonto vorhanden, wird er telefonisch über die Unterdeckung informiert. Der Geschäftspartner hat anschließend einen neuen Antrag (per SWIFT MT298/XML-Äquivalent oder ExtraNet CAP) maximal bis zur Höhe des freien Beleihungswertes zu übermitteln oder – sofern noch möglich - die erforderliche Besicherung durch Sicherheitenverstärkung herzustellen.

Der Antragsübernachtkredit ist einschließlich Zinsen an dem auf die Inanspruchnahme folgenden Geschäftstag zurückzuzahlen. Der Betrag wird dem Girokonto des kreditnehmenden Geschäftspartners zu Tagesbeginn automatisiert belastet und der aufgenommene Übernachtkredit aus dem Sicherheitenkonto ausgebucht. Im Sicherheitenkonto erhöht sich der freie Beleihungswert wieder entsprechend.

Wurde der Antrag um 18:15 Uhr erfolgreich verarbeitet, wird die erfolgreiche Inanspruchnahme des Übernachtkredits bei Auftragserteilung A2A per Statusmeldung MT 298/XML-Äquivalent mit Status-Code „CONF“ bestätigt. Sollte der Antrag aufgrund mangelnder Sicherheiten abgelehnt werden, erhält der Geschäftspartner über eine Statusmeldung MT298/XML-Äquivalent mit Status-Code „REJT“ Kenntnis darüber.

Informationen zu den in den Statusmeldungen für den Antragsübernachtkredit verwendeten Reason-Codes können Sie nachstehender Tabelle entnehmen:

<b>FALL\ TYP</b>	<b>Antragsübernachtkredit</b>
<b>Fehlende/falsche Sicherheitenkontonummer</b>	:24B::REJT//SAFE
	:70D::REAS// Sicherheitenkontonummer falsch
<b>Valutadatum in der Vergangenheit</b>	:24B::REJT//DDAT
	:70D::REAS//Valuta nicht erlaubt
<b>Valutadatum in der Zukunft</b>	:24B::REJT//DDAT
	:70D::REAS//Valuta nicht erlaubt
<b>Valutadatum fällt auf TARGET-Feiertag</b>	:24B::REJT//DDAT
	:70D::REAS//Valuta nicht erlaubt
<b>Maturity in der Vergangenheit</b>	:24B::REJT//DDAT
	:70D::REAS//Valuta nicht erlaubt
<b>Maturity fällt auf TARGET-Feiertag</b>	:24B::REJT//DDAT
	:70D::REAS//Valuta nicht erlaubt

<b>Kombination MEOR-SAFE nicht erlaubt</b>	:24B::REJT//SAFE
	:70D::REAS// Sicherheitenkontonummer, BIC oder MFI falsch
<b>Absender nicht erlaubt</b>	:24B::REJT//SAFE
	:70D::REAS//Sender nicht bevollmächtigt
<b>falsches TARGET Account</b>	n/a
<b>Vorzeichen falsch</b>	:24B::REJT//DMON
	:70D::REAS//negatives Vorzeichen nicht erlaubt
<b>gelöscht vor Freigabe durch BBK</b>	:24B::REJT//NARR
	:70D::REAS//durch BBK gelöscht
<b>von TARGET abgelehnt</b>	n/a
<b>ungedechte Inanspruchnahme besteht</b>	:24B::REJT//ICOL
	:70D::REAS//Unterdeckung im Sicherheitenkonto
<b>ungedechte Inanspruchnahme würde durch Transaktion erzeugt</b>	:24B::REJT//ICOL
	:70D::REAS//nicht ausreichende Sicherheiten (Wird erst um 18.15 gesendet!)
<b>vorhergehender Auftrag noch in Bearbeitung</b>	:24B::REJT//NARR
	:70D::REAS//vorheriger Auftrag noch in Bearbeitung
<b>Tagesendeverarbeitung läuft</b>	:24B::REJT//LATE
	:70D::REAS//Auftrag zu spät
<b>Diverse technische Fehler</b>	:24B::REJT//SYNT
	in :70D::REAS erfolgt keine weitere Beschreibung



### 3.1.1 Antragsübernachtskredit via SWIFT

#### 3.1.1.1 Antragsübernachtskredit - Instruktion MT 298

Der Geschäftspartner sendet den Auftrag für den Antragsübernachtskredit an die SWIFT-Adresse der Deutschen Bundesbank: MARKDEFFOBS.

Sta tus	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
M	20		Reference	Sender's Reference	16x Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	12		Sub-type		3!n Fixed value „100“ has to be used
M	77E		Proprietary		73x[n*78x] Contains a proprietary payload

#### Mandatory Sequence A – General Information

M	16R				GENL
M	23G	NEWM	Function of the message		“NEWM” for a new message
M	16S				GENL

#### Mandatory Sequence B – Marginal lending

M	16R	CASH		Marginal lending details	
M	95A	MEOR	Originator of message	Option P or R	Option P :4!c//4!a2!a2!c[3!c] “MEOR”//BIC code of the message originator Option R :4!c/8c/2!c32x “MEOR”//proprietary code/MFI number of the originator.

					<p>ID of counterparty for which the instruction is executed. Technical sender (e.g. BIC) can differentiate from the counterparty, if the counterparty authorizes the sender to send the messages on its behalf.</p> <p>In case of option R, the propriety code has to be in the MFI format. Moreover the data source scheme code shall be always EMFI (Eurosystem's MFI).</p> <p>The convention is as follows: the MFI ID code can be alphanumeric, with the first two digits being the two-digit ISO code for the country of residence of the MFI and the remaining number of digits (no limit has been specified) can be any combination of alphanumeric characters (e.g. MEOR//EMFI/SI123456789).</p>
M	97A	SAFE	Account	Option A	<p>:4!c//35x</p> <p>Contains the counterparties safekeeping account number at Deutsche Bundesbank (Sicherheitenkonto)</p>
M	98A	VALU	Value Date	Option A	<p>:4!c//8!n</p> <p>:VALU//YYYYMMDD</p> <p>Value Date of the marginal lending (Antragübernachtskredit)</p>
M	19A	FULL	Currency Code, Amount		<p>:4!c//[N]3!a15d</p> <p>:FULL// The amount of the marginal lending (Antragübernachtskredit)(full amount</p>

					<p>only positive amount is possible)</p> <p>Other syntax rules:</p> <p>The integer part of Amount must contain at least one digit.</p> <p>A decimal comma is mandatory and is included in the maximum length.</p> <p>The number of digits following the comma must not exceed 2</p>
M	16S	CASH			

### 3.1.1.2 Antragsübernachtskredit - Statusmeldung SWIFT MT 298

Die Deutsche Bundesbank versendet die Status Meldung für den Antragsübernachtskredit (Sender BIC: MARKDEFFOBS) an den Geschäftspartner.

Sta tus	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
M	20		Reference	Sender's Reference	16x Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	12		Sub-type		3!n Fixed value „101“ is used
M	77E		Proprietary		73x[n*78x] Contains a proprietary payload

#### Mandatory Sequence A – General Information

M	16R				GENL
M	23G	INST	Function of the message		:4!c[/4!c] “INST” for transaction instruction

#### Mandatory Sequence A1 – Linkages (repetitive)

M	16R				LINK
M	20C	RELA	Reference		:4!c//16x „RELA“//Reference of the linked message which was previously sent. Reference of the MT298 NEWM – Antragsübernachtskredit-Instruktion.
M	16S				LINK

#### Mandatory Sequence A2 - Status

M	16R				STAT
M	25D	IPRC	Instruction Process Sta- tus	Option D	:4!c/[8c]/4!c „IPRC“// Status code Status codes= PACK (Instruction has been acknowledged/accepted for further processing) or CONF (Instruction has been successfully processed) REJT (Instruction has been rejected for further pro- cessing)

Optional Sequence A2a – Reason (used if Status = REJT)

M	16R				REAS
M	24B	REJT	Reason		: 4!c / [8c] / 4!c :REJT//Reason code Die verwendeten Reason Codes sind der Tabelle in Ab- schnitt 3.1 zu entnehmen
O	70D	REAS	Narrative		:4!c//6*35x „REAS“// Additional unstruc- tured information to rejection reason. (siehe Tabelle in Abschnitt 3.1)
M	16S				REAS
M	16S				STAT
M	16S				GENL

### 3.1.2 Antragsübernachtkredit via XML A2A

#### 3.1.2.1 Antragsübernachtkredit – Instruktion XML

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *ML\_NEW\_lfdNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).

<u>Element / Attribute</u>	<u>Format</u>	<u>Description</u>
<b>MLNEW</b>	type MLNEW	
xs:sequence		
<b>SEME</b>	type C16	Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
	<i>Length 1-16</i>	
<b>MEOR</b>	element MFI	Originator of message (MFI code) or
	<i>minLength value="7"</i>	MFI code: first two digits being the two-digit ISO code for the country of residence
	<i>maxLength value="34"</i>	and five number of digits.
	<i>pattern value="[A-Z][A-Z][0-9]+"</i>	
	element BIC	Originator of message (BIC code)
	<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
<b>SAFE</b>	type C35	counterparties safekeeping account number at Deutsche Bundesbank (Sicherheitenkonto)

	<i>minLength value="1"</i>	
<b>VALU</b>	type N8	value date Format YYYYMMDD
	<i>totalDigits value="8"</i>	
<b>CCY</b>	type C3	currency code
	<i>Length 3</i>	
	<i>Anwendbare Codes: EUR</i>	
<b>AMOUNT</b>	type AMOUNT	amount of marginal lending (full amount, only positive amount is possible)
	<i>totalDigits value="14"</i>	
	<i>fractionDigits value="2"</i>	
	<i>minInclusive value="0"</i>	

### 3.1.2.2 Antragsübernachtkredit - Statusmeldung XML

Die Reasoncodes ICAS und BPAR finden keine Anwendung.

<u>Element / Attribute</u>	<u>Format</u>	<u>Description</u>
<b>MLSTAT</b>	type MLSTAT	
xs:sequence		
<b>SEME</b>	type C16	Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
	<i>Length 1-16</i>	
<b>RELA</b>	type C16	Contains the message reference of the previously sent message
	<i>Length 1-16</i>	
<b>IPRC</b>	type IPRC	Instruction process status
	<i>Anwendbare Codes:</i>	
	<i>CONF</i>	Instruction has been successfully processed
	<i>PACK</i>	Instruction has been acknowledged/accepted for further processing
	<i>REJT</i>	Instruction has been rejected for further processing



<b>REASON</b>	element REASONCODE	only if REJT - reason code and description
	type REASONCODE	
	<i>Anwendbare Codes:</i>	
	<i>SAFE</i>	recognised or invalid message sender's safekeeping account
	<i>LATE</i>	Instruction was received after market deadline
	<i>ICOL</i>	insufficient collateral
	<i>SYNT</i>	Syntax error
	<i>DDAT</i>	unrecognised or invalid settlement date
	<i>NARR</i>	deleted by Bundesbank
	<i>DMON</i>	negative sign not allowed
	element REASONDESC1	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	
	element REASONDESC2	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	
	element REASONDESC3	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	
	element REASONDESC4	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	

	element REASONDESC5	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	
	element REASONDESC6	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	

### 3.1.3 Antragsübernachtkredit via ExtraNet CAP

Beispiel: Auftragsübersicht Antragsübernachtkredit

Referenz	Status	Erlasser Erlassungsdatum	Empfänger Freigebedatum	BIC DRK Account	BIC PAS/NAM	Betrag	Valuta
17114011	verarbeitet	EXNCSMPO 04.08.2023	EXNSWXB 04.08.2023	ZYBDEFFXXX	ZYBDEFFXXX	2.500.000,00 EUR	04.08.2023
17048395	abgelehnt / Storno BSK	EXNSWXB 18.07.2023	EXNCSMPO 18.07.2023	ZYBDEFFXXX	ZYBDEFFXXX	150.000,00 EUR	18.07.2023

Anzeige der Auftragsübersicht: Eingabe des Start- und Enddatums (manuell oder als Auswahl per Kalenderbutton - standardmäßig wird der Zeitraum der vergangenen 90 Kalendertage bis zum aktuellen Kalendertag) eingeblendet. Das Aufrufen der Auftragserfassung des Antragsübernachtkredites erfolgt über den Button „Neuer Auftrag“.

## Erfassungsmaske Antragsübernacht Kredit in ExtraNet CAP:

The screenshot shows the 'Antragsübernacht Kredit' entry form in the CAP system. The form is titled 'Antragsübernacht Kredit' and includes the following fields:

- Freier Beleihungswert: 2.696.714,38 EUR
- Verrechnungs BIC: ZYBMDEFFXXX
- Valuta: 04.08.2023
- Betrag: (empty field)

Buttons for 'Abbrechen' and 'Erstellen' are located at the bottom of the form.

Das Feld „Valuta“ ist standardmäßig mit dem aktuellen Tag vorbelegt.

Nach Freigabe durch die Bundesbank wird die Transaktion in der Auftragsübersicht mit dem Status „In Bearbeitung BBk“ aufgeführt:

The screenshot shows the 'Auftragsübersicht' (Order Overview) table in the CAP system. The table lists orders with the following columns:

Referenz	Status	Erfauser Erfauserdatum	Freigegeben Freigegebendatum	BIC DNK Account	BIC P&N AM	Betrag	Valuta
17301165	In Bearbeitung BBk	ENKNDMPD 28.09.2023	ENKSWWB 28.09.2023	ZYBMDEFFXXX	ZYBMDEFFXXX	123.456,00 EUR	28.09.2023

The 'Status' column for the first row is highlighted with a blue box. The table also includes a 'Neuer Auftrag' button at the bottom right.

### 3.2 Kreditlinie und feste Kreditlinie

Das Sicherheitenmanagement-System der Bundesbank ermittelt bei jeder Veränderung im Sicherheitenkonto den neuen freien Beleihungswert als Saldo aus Sicherheiten und Inanspruchnahmen. Ist seitens des Geschäftspartners keine feste Kreditlinie (s. u.) instruiert worden, überträgt das Sicherheitenmanagement-System der Bundesbank diesen freien Beleihungswert als Kreditlinie an das primäre MCA-Konto in TARGET-BBk des Geschäftspartners.

Zur Sicherstellung eines hohen Servicelevels und zur Vermeidung von Überhol- und Blockadeeffekten erfolgt die Steuerung der Kreditlinien in TARGET als Deltabeträge in Form von Connected Payments (CP). Für Erhöhungen der Kreditlinien wird seitens der Bundesbank ein pacs.010 verwendet, die TARGET-seitig hierfür anfallenden Kosten werden den Geschäftspartnern jährlich erstattet (jeweils im Januar des Folgejahres für das abgelaufene Kalenderjahr). Für Kreditlinienreduzierungen wird seitens der Bundesbank ein pacs.009 verwendet. Diese CPs werden TARGET-seitig nicht an den Geschäftspartner ausgeliefert. Der Geschäftspartner hat jedoch die Möglichkeit, sich eine camt.054 (Debit Credit Notifikation) von TARGET ausliefern zu lassen. Diese Nachricht beinhaltet alle für den Geschäftspartner relevanten Informationen aus einer pacs.009/pacs.010 Nachricht.

Als Beispiel für die Wirkungsweise ist im Folgenden die Abwicklung von Offenmarktgeschäften eines Geschäftspartners ohne instruierte feste Kreditlinie dargestellt:

Am Abwicklungstag wird gegen 9:05 Uhr BBk-seitig die Buchung der auslaufenden Geschäfte (zuerst Offenmarktkredite, dann ggf. Termineinlagen - Kreditbetrag und Zinsen jeweils in einer Summe) auf dem primären MCA-Konto des Geschäftspartners veranlasst. Für die Buchung der auslaufenden Offenmarktkredite hat der Geschäftspartner ausreichend Liquidität zu diesem Zeitpunkt bereitzustellen. Die Ausbuchung des auslaufenden Offenmarktkredites führt zu einer Erhöhung des freien Beleihungswertes im Sicherheitenkonto, das hierdurch generierte CP pacs.010 belastet bei Geschäftspartnern mit primären MCA-Konto in TARGET-BBk simultan den Geldbetrag und erhöht die Kreditlinie im primären MCA-Konto in TARGET-BBk des Geschäftspartners. Die Ausbuchung der fälligen Termineinlagen wirkt in umgekehrter Art und Weise.

Die Buchung neu zugeteilter Offenmarktgeschäfte (Offenmarktkredite und Termineinlagen) veranlasst die Bundesbank bei Standardtendern am Abwicklungstag gegen 9:20 Uhr. Die Einbuchung eines Offenmarktkredites führt zu einer Verringerung des freien Beleihungswertes im Sicherheitenkonto, das hierdurch generierte CP pacs.009 schreibt simultan den Geldbetrag gut und reduziert die Kreditlinie im primären MCA-Konto in TARGET-BBk des Geschäftspartners. Die Zuteilung neuer Termineinlagen wirkt in umgekehrter Art und Weise. Fehlende Sicherheiten bzw. Kontoguthaben hierfür sind unverzüglich, jedoch spätestens bis 16:00 Uhr, einzuliefern.

Der Geschäftspartner kann alternativ eine feste Kreditlinie zur Steuerung der Liquiditätshaltung einrichten und verändern. Zur Abwicklung des Zahlungsverkehrs ist dies die Obergrenze für die Nutzung des Innertageskredits in TARGET. Sofern eine feste Kreditlinie existiert, wird bei Buchungen und/oder Neubewertungen zunächst festgestellt, über welchen Betrag die feste Kreditlinie aktuell lautet. Ist die feste Kreditlinie kleiner als der freie Beleihungswert, schlagen sich Sicherheiteneinlieferungen und Neubewertungen zwar im Sicherheitenkonto nieder, führen aber nicht zu einer Erhöhung der Kreditlinie in TARGET. Auch in diesem Fall werden Offenmarktgeschäfte von Geschäftspartnern mit hinreichend freiem Beleihungswert bzw. Liquidität vorausgesetzt - mittels CP pacs.009 bzw. pacs.010 abgewickelt (Betrag Kreditlinienänderung = 0).

Ist die gewünschte feste Kreditlinie jedoch größer als der freie Beleihungswert, wird in TARGET die Linie dem freien Beleihungswert angepasst. Erst wenn der freie Beleihungswert wieder zur Deckung der vereinbarten festen Kreditlinie ausreicht, wird diese feste Kreditlinie wieder an TARGET gemeldet.

Um die Flexibilität in der Liquiditätssteuerung zu erhöhen, ist es möglich, die feste Kreditlinie auch außerhalb der festgelegten regulären Betriebszeit (Entgegennahme und Verarbeitung von Geschäftsinstruktionen) von 7:00 - 17:45 Uhr (bzw. 18:15 Uhr für den Antragsübernachtungskredit) zu verändern. Bereits ab 6:40 Uhr und von ca. 19:00 bis 19:20 Uhr werden entsprechende Aufträge über alle Zugangskanäle (SWIFT, ExtraNet A2A und U2A) entgegengenommen und verarbeitet. Geschäftspartner-Instruktionen für die feste Kreditlinie werden unmittelbar verarbeitet. Die Übermittlung des Betrages der festen Kreditlinie erfolgt an die Bundesbank per MT 298/XML-Äquivalent oder ExtraNet CAP.

Der Geschäftspartner kann eine bereits eingerichtete feste Kreditlinie ändern. Hierfür ist eine neue Instruktion (MT 298/XML-Äquivalent) mit dem neuen Betrag der festen Kreditlinie an die Bundesbank zu senden. Sollte der Geschäftspartner wieder eine flexible Kreditlinie wünschen, ist im MT 298/XML-Äquivalent der Betrag 0 anzugeben, in ExtraNet CAP ist das Häkchen zu entfernen. Über den Eingang der Kreditlinien-Instruktion informiert die Bundesbank anhand der Statusmeldung MT 298/XML-Äquivalent. Eine Zurückweisung einer Einrichtung oder Änderung der festen Kreditlinie erfolgt ebenfalls über die Statusmeldung MT 298/XML-Äquivalent. Bitte beachten Sie, dass die Instruktion einer festen Kreditlinie, die niedriger als der bereits in TARGET beanspruchte Innertageskredit ist, zu einer

Ablehnung der Instruktion durch TARGET führt. Auch wenn der Innertageskredit anschließend in ausreichendem Maß zurückgeführt würde, wird systemseitig kein automatischer erneuter Versuch zur Anpassung der festen Kreditlinie unternommen.

Sofern die Nachricht mit dem Status-Code „PACK“ an den Kunden übermittelt wird, ist die Instruktion der festen Kreditlinie zur weiteren Verarbeitung akzeptiert worden. Die erfolgreiche Verarbeitung einer Instruktion wird durch den Status-Code „CONF“ bestätigt. Wird der Status-Code „REJT“ angezeigt, so ist die Instruktion abgelehnt worden. Dies erfolgt beispielweise für neue Instruktionen bei noch nicht final bearbeiteten vorherigen Instruktionen.

Informationen zu den in den Statusmeldungen für die feste Kreditlinie verwendeten Reason-Codes können Sie nachstehender Tabelle entnehmen:

<b>FALL\ TYP</b>	<b>Feste Kreditlinie</b>
<b>Fehlende/falsche Sicherheitenkontonummer</b>	:24B::REJT//SAFE
	:70D::REAS// Sicherheitenkontonummer falsch
<b>Valutadatum in der Vergangenheit</b>	n/a
<b>Valutadatum in der Zukunft</b>	n/a
<b>Valutadatum fällt auf TARGET-Feiertag</b>	n/a
<b>Maturity in der Vergangenheit</b>	n/a
<b>Maturity fällt auf TARGET-Feiertag</b>	n/a
<b>Kombination MEOR- SAFE nicht erlaubt</b>	:24B::REJT//SAFE
	:70D::REAS// Sicherheitenkontonummer, BIC oder MFI falsch
<b>Absender nicht erlaubt</b>	:24B::REJT//SAFE
	:70D::REAS//Sender nicht bevollmächtigt

<b>falsches TARGET Account</b>	:24B::REJT//BPAR
	:70D::REAS//TARGET Acct. Unzulässig
<b>Vorzeichen falsch</b>	:24B::REJT//DMON
	:70D::REAS//negatives Vorzeichen nicht erlaubt
<b>gelöscht vor Freigabe durch BBK</b>	:24B::REJT//NARR
	:70D::REAS//durch BBK gelöscht
<b>von TARGET abgelehnt</b>	:24B::REJT//ICAS
	:70D::REAS//nicht ausreichende TARGET Liquidität
<b>ungedekte Inanspruchnahme besteht</b>	:24B::REJT//ICOL
	:70D::REAS//Unterdeckung im Sicherheitenkonto
<b>ungedekte Inanspruchnahme würde durch Transaktion erzeugt</b>	:24B::REJT//ICOL
	:70D::REAS//Unterdeckung im Sicherheitenkonto
<b>vorhergehender Auftrag noch in Bearbeitung</b>	:24B::REJT//NARR
	:70D::REAS//vorheriger Auftrag noch in Bearbeitung
<b>Tagesendeverarbeitung läuft</b>	Auftrag wird in die Queue gestellt.
<b>Diverse technische Fehler</b>	:24B::REJT//SYNT
	in :70D::REAS erfolgt keine weitere Beschreibung

### **Auswirkungen der festen Kreditlinie auf die Abrechnung von Offenmarktgeschäften**

Nach den Allgemeinen Geschäftsbedingungen der Deutschen Bundesbank sind geldpolitische Geschäftspartner verpflichtet, zum Zeitpunkt der Buchung fälliger Offenmarktgeschäfte ausreichend Liquidität zur Verfügung zu stellen. Dies gilt auch bei Nutzung der Funktionalität der festen Kreditlinie. Die Bank zieht auslaufende Geschäfte an dem in der Ausschreibung genannten Abwicklungstag gegen 9:05 Uhr in TARGET-BBk ein. Dementsprechend haben geldpolitische Geschäftspartner, die eine feste Kreditlinie nutzen, dafür Sorge zu tragen, dass diese die Buchung der fälligen Offenmarktgeschäfte zum Buchungszeitpunkt zulässt. Die auf dem zu belastenden primären MCA-Konto in TARGET-BBk verfügbare Liquidität muss ausreichend sein, um den fälligen Kreditbetrag und die aufgelaufenen Zinsen zu belasten.



Zahlungen aus Offenmarktgeschäften werden für Geschäftspartner, die sich für eine feste Kreditlinie entschieden haben, als Connected Payment (CP) an TARGET gegeben. Dabei bleibt die Kreditlinie unverändert (Betrag Kreditlinienänderung=0).

Zur Erleichterung der Liquiditätsdisposition werden Connected Payments zur Abwicklung von Offenmarktgeschäften die höchste Priorität (highly urgent) haben.

### **Maßnahmen im Falle nicht ausführbarer Rückbuchung eines Offenmarktgeschäftes infolge zu niedrig instruierter fester Kreditlinie**

Für den Fall, dass die fälligen Tendergeschäfte zuvor nicht vollumfänglich abgewickelt werden konnten, ist die Bank berechtigt, den Zeitpunkt der Gutschrift auf einen späteren Zeitpunkt des Abwicklungstages zu verschieben. Hierbei kann die Bank ein vom Geschäftspartner in Auftrag gegebene feste Kreditlinie aufheben; sie erhebt hierfür ein besonderes Bearbeitungsentgelt. Feste Kreditlinie via SWIFT

#### **3.2.1.1 Feste Kreditlinie – Instruktion MT 298**

**Der Geschäftspartner übermittelt die SWIFT Instruktion für die feste Kreditlinie an die SWIFT-Adresse der Deutschen Bundesbank: MARKDEFFOBS.**

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
M	20		Reference	Sender's Reference	16x Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	12		Sub-type		3!n Fixed value „150“ has to be used
M	77E		Proprietary		73x[n*78x] Contains a proprietary payload

Mandatory Sequence A – General Information

M	16R				GENL
---	-----	--	--	--	------

M	23G	NEWM	Function of the message		"NEWM" for a new message

Mandatory Sequence A1 – Fixed Credit Line

M	16R			Fixed credit line details	FCRL
M	95A	MEOR	Originator of message	Option P or R	<p>Option P :4!c//4!a2!a2!c[3!c] MEOR//BIC code of the message originator</p> <p>Option R :4!c/8c/2!c32x MEOR//proprietary code/MFI number of the originator. ID of counterparty for which the instruction is executed. Technical sender (e.g. BIC) can differentiate from the counterparty, if the counterparty authorizes the sender to send the messages on its behalf.</p> <p>In case of option R, the proprietary code has to be in the MFI format. Moreover the data source scheme code shall be always EMFI (Eurosystem's MFI).</p> <p>The convention is as follows: the MFI ID code can be alphanumeric, with the first two digits being the two-digit ISO code for the country of residence of the MFI and the remaining number of digits (no limit has been specified) can be any combination of alphanumeric characters (e.g. MEOR//EMFI/SI123456789).</p>
M	97A	SAFE	Account	Option A	:4!c//35x

					Contains the counterparties safekeeping account number at Deutsche Bundesbank (Sicherheitenkonto)
O	95P	ACOW	TARGET PM Account owner	Option P	:4!c//4!a2!a2!c[3!c] :ACOW// BIC code of the TARGET 2 PM account
M	19A	FULL	Currency Code, Amount		:4!c//[N]3!a15d :FULL// The amount of the fixed credit line (full amount and only positive amount is possible) The amount shall be greater than 0 Other syntax rules: When the amount is zero, than the fixed credit line is revoked and the complete credit line is in TARGET available again
M	16S				FCRL
M	16S				GENL

### 3.2.1.2 Feste Kreditlinie – Statusmeldung MT 298

Die Deutsche Bundesbank versendet die Statusmeldung der festen Kreditlinie (Sender BIC: MARKDEFFOBS) an den Geschäftspartner.

Sta tus	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
M	20		Reference	Sender´s Ref-erence	16x Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	12		Sub-type		3!n Fixed value „151“is used
M	77E		Proprietary		73x[n*78x] Contains a proprietary payload

#### Mandatory Sequence A – General Information

M	16R				GENL
M	23G	INST	Function of the message		:4!c[/4!c] “INST” for transaction status

#### Mandatory Sequence A1 – Linkages (repetitive)

M	16R				LINK
M	20C	RELA	Reference		:4!c//16x RELA//Reference of the linked message which was previously sent. Reference of the MT298 NEWM – Feste Kreditlinie-Instruktion
M	16S				LINK

#### Mandatory Sequence A2 - Status

M	16R				STAT
---	-----	--	--	--	------

M	25D	IPRC	Instruction Process Sta- tus	Option D	:4!c/[8c]/4!c IPRC// Status code Status code= PACK (Instruction has been acknowledged/accepted for further processing) or CONF (Instruction has been successfully processed) REJT (Instruction has been rejected for further pro- cessing)
---	-----	------	------------------------------------	----------	--

Optional Sequence A2a – Reason (used if Status = REJT)

M	16R				REAS
M	24B	REJT	Reason		: 4!c / [8c] / 4!c :REJT//Reason code Die verwendeten Reason codes sind Abschnitt 3.3 zu entnehmen
O	70D	REAS	Narrative		:4!c//6*35x REAS// Additional unstruc- tured information (siehe Abschnitt 3.3)
M	16S				REAS
M	16S				STAT
M	16S				GENL

### 3.2.2 Feste Kreditlinie via Extranet XML

#### 3.2.2.1 Feste Kreditlinie – Instruktion XML

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *FCL\_NEW\_IldNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).

<u>Element / Attribute</u>	<u>Format</u>	<u>Description</u>
<b>FCLNEW</b>	type FCLNEW	
xs:sequence		
<b>SEME</b>	type C16	Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent
	<i>Length 1-16</i>	
<b>MEOR</b>	element MFI	Originator of message (MFI code) or
	<i>minLength value="7"</i>	MFI code: first two digits being the two-digit ISO code for the country of residence and five number of digits.
	<i>maxLength value="34"</i>	
	<i>pattern value="[A-Z][A-Z][0-9]+"</i>	
	element BIC	Originator of message (BIC code)
	<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	

<b>SAFE</b>	type C35	Safekeeping account - contains (sub)account number in local CMS
	<i>minLength value="1"</i>	counterparties safekeeping account number at Deutsche Bundesbank (Sicherheitenkonto)
<b>ACOW</b>	type BIC	BIC of T2-Account
	<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<i>minOccurs="0"</i>	
<b>CCY</b>	type C3	currency code
	<i>Length 3</i>	
	<i>Anwendbare Codes: EUR</i>	
<b>AMOUNT</b>	type AMOUNT	amount of marginal lending (full amount, only positive amount is possible)
	<i>totalDigits value="14"</i>	
	<i>fractionDigits value="2"</i>	
	<i>minInclusive value="0"</i>	

### 3.2.2.2 Feste Kreditlinie – Statusmeldung XML

Die Resoncodes LATE und DDAT finden keine Anwendung.

<u>Element / Attribute</u>	<u>Format</u>	<u>Description</u>
FCLSTAT	type FCLSTAT	
xs:sequence		
SEME	type C16	Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
	<i>Length 1-16</i>	
RELA	type C16	
	<i>Length 1-16</i>	Contains the message reference of the previously sent message
IPRC	type IPRC	Instruction process status
	<i>Anwendbare Codes:</i>	
	<i>CONF</i>	Instruction has been successfully processed
	<i>PACK</i>	Instruction has been acknowledged/accepted for further processing
	<i>REJT</i>	Instruction has been rejected for further processing



REASON	element REASONCODE	only if REJT - reason code and description
	type REASONCODE	
	<i>Anwendbare Codes:</i>	
	<i>SAFE</i>	Recognised or invalid message sender's safekeeping account
	<i>ICOL</i>	Insufficient collateral
	<i>ICAS</i>	Insufficient cash
	<i>BPAR</i>	Unrecognised or invalid Business Partner
	<i>SYNT</i>	Syntax error
	<i>NARR</i>	Deleted by Bundesbank
	<i>DMON</i>	negative sign not allowed
	element REASONDESC1	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	
	element REASONDESC2	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	
	element REASONDESC3	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	
	element REASONDESC4	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	

	element REASONDESC5	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	
	element REASONDESC6	Reasondescription
	type C35	
	<i>Length 1-35</i>	

### 3.2.3 Feste Kreditlinie via ExtraNet CAP

Beispiel: Auftragsübersicht feste Kreditlinie

Referenz	Status	Ersteller	Erfassungsdatum	Freigeber	Freigabedatum	Betrag
17082262	erfasst GP	EXNSWWKB	27.07.2023			10.000,00 EUR
17022672	erfasst GP	EXNSWWKB	07.07.2023			1.000,00 EUR
17021110	erfasst GP	EXNSWWKB	07.07.2023			12.900,00 EUR

Anzeige der Auftragsübersicht: Eingabe des Start- und Endedatums (manuell oder als Auswahl per Kalenderbutton). Standardmäßig wird der Zeitraum der vergangenen 90 Kalendertage bis zum aktuellen Kalendertageingeblendet. Das Aufrufen der Auftragserfassung der festen Kreditlinie erfolgt über den „Neuer Auftrag“ Button.

Beispiel: Erfassungsmaske für die Eingabe/Änderung/Löschung der festen Kreditlinie:

The screenshot shows the 'Auftragsfassung Feste Kreditlinie' (Order Entry Fixed Credit Line) form in the CAP system. The interface includes a header with the CAP logo and 'DEUTSCHE ZUSAMMENARBEIT' logo, and a navigation menu on the left with options like 'AUSWERTUNGEN', 'AUFTRÄGE', and 'SICHERHEITENPOOL 1'. The main form area contains the following fields and controls:

Auftragsfassung Feste Kreditlinie	
Freier Belehnungswert: 2.029.580,38 EUR	Aktuelle Feste Kreditlinie: 100.000.000,00 EUR
<input checked="" type="checkbox"/> Feste Kreditlinie	Betrag* 22.222,22
<input type="button" value="Abbrechen"/> <input type="button" value="Erstellen"/>	

Möchte der Geschäftspartner eine feste Kreditlinie über ExtraNet CAP einrichten, ist im Feld „Feste Kreditlinie“ ein Häkchen zu setzen und der Betrag einzutragen. Dabei ist zu berücksichtigen, dass mit der Eingabe einer neuen festen Kreditlinie stets ein neuer Absolutbetrag (und nicht etwa ein Delta zu einer bestehenden festen Kreditlinie) gesetzt wird. Bei Änderung der festen Kreditlinie ist nur der Betrag zu verändern. Soll die feste Kreditlinie gelöscht bzw. in eine variable Kreditlinie geändert werden, ist nur das Häkchen herauszunehmen.

## **4 Formen der Auftragserteilung im Rahmen der Nutzung von Sicherheiten**

### **4.1 Kontoguthaben (Cash Collateral)**

Geschäftspartner haben die Möglichkeit, Kontoguthaben (Cash Collateral) als kurzfristige Sicherheit zur Besicherung geldpolitischer Geschäfte zum Ausgleich einer Unterdeckung bzw. bis maximal zum Betrag der Unterdeckung zu verwenden. Bei der Besicherung von Eigengeschäften der Bank ist Cash Collateral i.H.v. 250 Mio. EUR zulässig. Die Mobilisierung von Kontoguthaben erfolgt mittels SWIFT-Nachricht MT 598 bzw. XML-Äquivalent sowie über ExtraNet CAP durch den Geschäftspartner bis zu dem für die Einlieferung fehlender Sicherheiten festgesetzten Zeitpunkt gemäß AGB V. 15. (5). Die Beantragung der Rückführung von Kontoguthaben erfolgt über die gleichen Einreichungskanäle.

Die aktuelle Unterdeckung wird täglich durch das Sicherheitenmanagement-System der Deutschen Bundesbank geprüft und ggf. die Höhe des genutzten Kontoguthabens automatisiert auf die aktuelle Unterdeckung reduziert oder gleichmäßig komplett ausgebucht und dem primären MCA-Konto in TARGET-BBk des Geschäftspartners wieder gutgeschrieben. Sofern sich die Unterdeckung jedoch erhöht, hat der Geschäftspartner einen neuen Auftrag zur Erhöhung des Kontoguthabens zu erteilen oder die Unterdeckung durch Einlieferung anderer Sicherheiten zu beseitigen.

Bei Einreichung via SWIFT oder XML informiert die Bundesbank über den Eingang der Kontoguthaben-Instruktion anhand der Statusmeldung MT 598/XML-Äquivalent (Status-Code „PACK“). Die Zurückweisung einer Einrichtung von Kontoguthaben (z.B. falls der instruierte Betrag die Unterdeckung überschreitet) erfolgt ebenfalls über die Statusmeldung MT 598/XML-Äquivalent (Status-Code „REJT“). Wurde die Instruktion erfolgreich verarbeitet, wird in der Statusmeldung MT 598/XML-Äquivalent der Status-Code „CONF“ angezeigt.

Kontoguthaben als Sicherheit werden mit dem Zinssatz der Einlagefazilität verzinst, sofern sie dem geldpolitischen Sicherheitenkonto angehören. Im Rahmen des Zweiten Sicherheitenkontos (BBk-Eigengeschäfte) kommt der Zinssatz der Einlagefazilität abzgl. 15 Basispunkte zur Anwendung. Die Zinsen bzw. Entgelte (im Falle eines negativen Einlagezinses)

werden um 7:00 Uhr des auf die Hereinnahme als Sicherheit folgenden Geschäftstages fällig und werden auf dem Konto gebucht, von dem das Kontoguthaben abgebucht worden ist.

#### 4.1.1 Kontoguthaben via SWIFT

##### 4.1.1.1 Ein- und Auslieferung von Kontoguthaben MT 598

Der Geschäftspartner übermittelt die SWIFT Instruktion für Ein- und Auslieferung von Kontoguthaben an die SWIFT-Adresse der Deutschen Bundesbank: MARKDEFFOBS.

Sta tus	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
M	20		Reference	Sender's Reference	16x Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	12		Sub-type		3!n Fixed value „130“ has to be used
M	77E		Proprietary		73x[n*78x] Contains a proprietary payload

##### Mandatory Sequence A – General Information

M	16R				GENL
M	23G	NEWM	Function of the message		“NEWM” for a new message
M	16S				GENL

##### Mandatory Sequence B – Cash Collateral

M	16R	CASH		Cash collateral details	
M	95A	MEOR	Originator of message	Option P or R	Option P :4!c//4!a2!a2!c[3!c] MEOR//BIC code of the message originator Option R :4!c/8c/2!c32x “MEOR”//proprietary code/MFI number of the originator ID of counterparty for which the instruction is executed.

					<p>Technical sender (e.g. BIC) can differentiate from the counterparty, if the counterparty authorizes the sender to send the messages on its behalf.</p> <p>In case of option R, the propriety code has to be in the MFI format. Moreover the data source scheme code shall be always EMFI (Eurosystem's MFI).</p> <p>The convention is as follows: the MFI ID code can be alphanumeric, with the first two digits being the two-digit ISO code for the country of residence of the MFI and the remaining number of digits (no limit has been specified) can be any combination of alphanumeric characters (e.g. MEOR//EMFI/SI123456789).</p>
M	97A	SAFE	Account	Option A	<p>:4!c//35x</p> <p>Contains the counterparties safekeeping account number at Deutsche Bundesbank (Sicherheitenkonto)</p>
M	98A	VALU	Value Date	Option A	<p>:4!c//8!n</p> <p>:VALU//YYYYMMDD</p> <p>This field specifies the value date of the mobilization/demobilization of cash as collateral</p>
M	19A	DELT	Sign, Currency Code, Amount		<p>:4!c//[N]3!a15d</p> <p>:DELT//The amount of cash as collateral (delta amount)</p> <p>DELT: identification of a delta amount (positive or negative amounts are possible, e.g.</p>



					<p>DELT//N-EUR123123, or DELT//EUR123123,) Positive amount: mobilization Negative amount (flag N): de- mobilization Other syntax rules: When a sign is present, the amount must not be zero. The integer part of amount must contain at least one digit. A decimal comma is manda- tory and is included in the maximum length. The number of digits follow- ing the comma must not ex- ceed 2.</p>
M	16S	CASH			

#### 4.1.1.2 Ein- und Auslieferung von Kontoguthaben - Statusmeldung MT 598

Die Deutsche Bundesbank versendet die Statusmeldung Kontoguthaben (Sender BIC: MARKDEFFOBS) an den Geschäftspartner.

Sta tus	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
M	20		Reference	Sender's Reference	16x Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	12		Sub-type		3!n Fixed value „131“ is used
M	77E		Proprietary		73x[n*78x] Contains a proprietary payload

##### Mandatory Sequence A – General Information

M	16R				GENL
M	23G	INST	Function of the message		:4!c[/4!c] “INST” for transaction status

##### Mandatory Sequence A1 – Linkages (repetitive)

M	16R				LINK
M	20C	RELA	Reference		:4!c//16x „RELA“//Reference of the linked message which was previously sent. Reference of the MT598 NEWM – Cash as Collateral -Instruktion
M	16S				LINK

##### Mandatory Sequence A2 - Status

M	16R				STAT
---	-----	--	--	--	------

M	25D	IPRC	Instruction Process Sta- tus	Option D	:4!c/[8c]/4!c „IPRC“// Status code Status code= PACK (Instruction has been acknowledged/accepted for further processing) or CONF (Instruction has been successfully processed) REJT (Instruction has been rejected for further pro- cessing)
---	-----	------	------------------------------------	----------	--

Optional Sequence A2a – Reason (used if Status = REJT)

M	16R				REAS
M	24B	REJT	Reason		: 4!c /[8c]/4!c :REJT//Reason code Reason code= SAFE (recognised or invalid message sender's safekeep- ing account) DDAT (Unrecognised or inva- lid settlement date) LATE (Instruction was re- ceived after market deadline)  SYNT (Syntax error) NARR (see narrative field of reason)
O	70D	REAS	Narrative		:4!c//6*35x „REAS“// Additional unstruc- tured information
M	16S				REAS
M	16S				STAT
M	16S				GENL

## 4.1.2 Kontoguthaben via Extranet XML

### 4.1.2.1 Ein- und Auslieferung von Kontoguthaben XML

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *CC\_NEW\_lfdNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).

Element/Attribut	Format	Beschreibung
<b>CCNEW</b>	type CCNEW	
xs:sequence		
<b>SEME</b>	type C16	
	<i>Length 1-16</i>	"Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent"
<b>MEOR</b>	element MFI	Originator of message (MFI code) or
	<i>minLength value="7"</i>	MFI code: first two digits being the two-digit ISO code for the country of residence
	<i>maxLength value="34"</i>	and five number of digits.
	<i>pattern value="[A-Z][A-Z][0-9]+"</i>	

	element BIC	Originator of message (BIC code)
	<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
<b>SAFE</b>	type C35	
	<i>minLength value="1"</i>	"counterparties safekeeping account number at Deutsche Bundesbank (Sicherheitenkonto)"
<b>VALU</b>	type N8	value date Format YYYYMMDD
	<i>totalDigits value="8"</i>	
<b>CCY</b>	type C3	currency code
	<i>Length 3</i>	
	<i>Anwendbare Codes: EUR</i>	
<b>AMOUNTTYPE</b>	type C4	Increase or decrease
	<i>Length 4</i>	
	<i>Anwendbare Codes: INCR, DECR</i>	
<b>AMOUNT</b>	type AMOUNT	
	<i>totalDigits value="14"</i>	

	<i>fractionDigits value="2"</i>	only positive amounts are possible
	<i>minInclusive value="0"</i>	Positive amount: mobilisation, Negative amount demobilisation.

#### 4.1.2.2 Ein- und Auslieferung von Kontoguthaben - Statusmeldung XML

<u>Element / Attribute</u>	<u>Format</u>	<u>Beschreibung</u>
<b>CCSTAT</b>	type CCSTAT	
xs:sequence		
<b>SEME</b>	type C16	Senders Reference must be unique per sender BIC and per message type and subtype
	<i>Length 1-16</i>	Transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent
<b>RELA</b>	type C16	
	<i>Length 1-16</i>	Contains the message reference of the previously sent message
<b>IPRC</b>	type IPRC	Instruction process status
	<i>Anwendbare Codes:</i>	
	<i>CONF</i>	Instruction has been successfully processed
	<i>PACK</i>	Instruction has been acknowledged/accepted for further processing
	<i>REJT</i>	Instruction has been rejected for further processing
<b>REASON</b>	element REASONCODE	only if REJT - reason code and description
	type REASONCODE	
	<i>Anwendbare Codes:</i>	
	<i>SAFE</i>	Recognised or invalid message sender's safekeeping account
	<i>LATE</i>	Instruction was received after market deadline
	<i>ICOL</i>	Insufficient collateral
	<i>ICAS</i>	Insufficient cash
	<i>BPAR</i>	Unrecognised or invalid Business Partner

	<i>SYNT</i>	Syntax error
	<i>DDAT</i>	Unrecognised or invalid settlement date
	<i>NARR</i>	Deleted by Bundesbank
	<i>DMON</i>	negative sign not allowed



### 4.1.3 Kontoguthaben via ExtraNet CAP

Beispiel: Auftragsübersicht Kontoguthaben

Referenz	Status	Ersteller	Erfassungsdatum	Freigeber	Freigebedatum	Betrag
17114023	verarbeitet	EKNOSMPO	04.08.2023	EKNOWWB	04.08.2023	900.000,00 EUR
17082263	gelöscht GP	EKNOSMPO	27.07.2023	EKNOSMPO	04.08.2023	900.000,00 EUR

Anzeige der Auftragsübersicht: Eingabe des Start- und Enddatums (manuell oder als Auswahl per Kalenderbutton). Standardmäßig wird der Zeitraum der vergangenen 90 Kalendertage bis zum aktuellen Kalendertag eingeblendet. Es kann auch eine Auswahl getroffen werden, ob offene und/oder abgeschlossene Aufträge eingesehen werden möchten.

Das Aufrufen der Auftragserfassung des Kontoguthabens erfolgt über den „Neuer Auftrag“ Button.

## Beispiel: Auftragserfassung Einlieferung (Mobilisierung) von Kontoguthaben

The screenshot shows the CAP (Cash Collateral) interface. The main content area is titled 'Auftragserfassung Cash Collateral'. It displays the following information:

- Freier Beleihungswert:** -900.000,00 EUR
- Aktuelle Cash Collateral:** 900.000,00
- Verrechnungs BIC:** ZYBNOE33XXX
- Die Mobilisierung von Cash Collateral ist nur bei einem negativen Freien Beleihungswert möglich. Der Maximalbetrag bestimmt sich durch die Höhe der aktuell bestehenden Unterdeckung.**
- Geschäftsart:** Mobilisierung

The interface also includes a sidebar with navigation options: 'Ein-/Auslieferung', 'Depotübertrag', 'Antragsübermacht/kredit', 'Sperren', 'Feste Kreditlinie', 'Cash Collateral', and 'SICHERHEITENPOOL 2'. The top bar shows 'CAP' and 'DEUTSCHE BUNDESBANK'. The current date and time are 04.08.2023, 13:36:26.

Abhängig davon, ob der Freie Beleihungswert negativ oder positiv ist, wird das Feld „Geschäftsart“ mit Mobilisierung oder Demobilisierung vorbelegt. Eine Mobilisierung ist programmtechnisch nur möglich, wenn der Freie Beleihungswert negativ ist. Eine Demobilisierung nur, wenn der Freie Beleihungswert positiv und aktuell Cash Collateral vorhanden ist. Ist dies nicht gegeben, erscheint eine Fehlermeldung nach der Erfassung.

Beispiel: Auftragserfassung Auslieferung (Demobilisierung) von Kontoguthaben.

The screenshot shows the ICAP (Interbank Clearing and Payment) interface. The top navigation bar includes the ICAP logo, the Deutsche Bundesbank logo, and the current date and time: 04.08.2023, 13:42:27. The main content area is titled 'Cash Collateral' and displays the following information:

- Sicherheitenkontonummer:** [Redacted]
- Sicherheitenpool 2 - Besicherung BHK-Eigengeschäfte**
- Auftragserfassung Cash Collateral**
- Freier Beleihungswert:** 900.000,00 EUR
- Aktuelle Cash Collateral:** 900.000,00 EUR
- Verrechnung BIC:** ZYMBDE33XXX
- Geschäftstyp:** Demobilisierung (selected from a dropdown menu)
- Währung:** EUR
- Buttons:** 'Abbrechen' and 'Erstellen'

Anhand der Drop Down Menüs wird die entsprechende Geschäftsart: „Demobilisierung“ ausgewählt.

## **4.2 Marktfähige Sicherheiten**

Die Einreichung marktfähiger Wertpapiere bei der Deutschen Bundesbank ist über verschiedene Wege möglich. Grundsätzlich unterscheidet man zwischen Lieferung von im Inland lagernden Wertpapieren (domestic) sowie der Lieferung von im Ausland verwahrten Wertpapieren über das CCBM-Verfahren (Correspondent Central Banking Model). Unabhängig davon, ob es sich um ein heimisches Wertpapier oder um eine grenzüberschreitende Einlieferung handelt, kann die Auftragserteilung einer Sicherheiteneinlieferung mittels ExtraNet CAP oder SWIFT MT 540/XML-Äquivalent erfolgen. Die Sicherheitenauslieferung einer marktfähigen Sicherheit kann ebenfalls über ExtraNet CAP oder SWIFT MT 542/XML-Äquivalent instruiert werden. Die erfolgreiche Ein-/Ausbuchung wird per SWIFT MT 544/XML-Äquivalent bzw. SWIFT MT 546/XML-Äquivalent bestätigt.

Eine weitere Möglichkeit zur grenzüberschreitenden Nutzung von marktfähigen Sicherheiten besteht über die Nutzung zugelassener Verbindungen zwischen Wertpapierabwicklungssystemen, sog. „eligible Links“. Hierfür ist die Verwahrstelle zu beauftragen, die Sicherheiten auf das Depot der Deutschen Bundesbank bei (Clearstream Banking Frankfurt) CBF oder bei Clearstream Banking Luxemburg (CBL) zu übertragen. In dieser Schnittstellenbeschreibung wird das Link-Verfahren dem Abschnitt „heimischen Nutzung marktfähiger Sicherheiten“ zugeordnet.

Unabhängig von Lagerstelle und dem verwendeten Kommunikationskanal wird bei Auftragserteilung durch das Sicherheitenmanagement-System der Deutschen Bundesbank eine Prüfung auf das Vorliegen enger Verbindungen (Close Links) durchgeführt. Sollte die Prüfung ergeben, dass eine gemäß Abschnitt V AGB der Deutschen Bundesbank unzulässige enge Verbindung vorliegt bzw. vorliegen könnte, wird der Geschäftspartner umgehend informiert und die Einlieferung ggf. abgelehnt. Im Falle einer Auftragserteilung über ExtraNet CAP wird eine entsprechende Fehlermeldung angezeigt bzw. der Hinweis sich mit der zuständigen Stelle im Hause der Deutschen Bundesbank (Sicherheitenmanagement Z 51, Tel.: +49 (0)69 2388 2477) in Verbindung zu setzen.

### **4.2.1 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten**

Bei Clearstream Banking Frankfurt (CBF) hinterlegte notenbankfähige Wertpapiere können zugunsten des dort geführten Depots der Deutschen Bundesbank übertragen werden.

#### 4.2.1.1 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via SWIFT

##### 4.2.1.1.1 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via SWIFT domestic

##### 4.2.1.1.1.1 Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 540 domestic (CBF-Konto 7069)

Der Geschäftspartner sendet die SWIFT- Instruktionen zur Einlieferung von Sicherheiten an die Deutsche Bundesbank (Receiver BIC: MARKDEFFCCB).

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

##### Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"// transaction reference number of the operation This field must be unique for each instruction sent
M	23G	NEWM/ CANC		Function of the Message	4!c[/4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent instruction

##### Optional Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
M	20C	RELA/ PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; for a new message RELA/NEW PREV// transaction reference number of the message to be cancelled
M	16S			End of Block	LINK

##### End of Mandatory Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

##### Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADEDET
M	98a	SETT	Date/Time	Option A	:4!c//8!n;

					"SETT"//YYYYMMDD for the delivery date
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"//YYYYMMDD for the trade date This field must be prior to or equal to the settlement date.
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
O	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO"//ISO currency code of the asset
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADEDET
---	-----	--	--	--------------	----------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
M	36B	SETT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument to be settled	:4!c//4!c/15d; "SETT"//type/ Quantity of financial instrument to be settled The type is expressed in "FAMT" if quantity is expressed as a face amount The type is expressed in "UNIT" if quantity is expressed as a number
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//account of client with BBk (Dispositionsdepotnummer)
M	94a	SAFE	Place of safekeeping	Option B	:4!c//[8c]/4!c/[30x]; "SAFE"//SHHE"/DAKVDEFF XXX (BIC code of Clearstream Banking Frankfurt)

M	16S			End of Block	FIAC
---	-----	--	--	--------------	------

#### Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator	Option A	:4!c//4!c; "SETR"//"REPU" or "COLI" or "TRAD"

#### Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	SELL	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "SELL"//BIC code of the in- structing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	DEAG	Party	Option R or P	For CBF Participants: Option R: 4!c/8c/34x; "DEAG"//DAKV/XXXX For Euroclear, Clearstream Banking Luxemburg and other T2S In-CSD partici- pants:Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "DEAG"//MGTCBEBEECL (respectively CEDELULLXXX or e. g. MOTIITMMXXX)
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"// DAKVDEFFXXX BIC code "Place of Settle- ment" Clearstream Banking Frankfurt
M	16S			End of Block	SETPRTY

#### End of Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory                      O=Optional

#### **4.2.1.1.1.2 Storno Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 540 domestic**

Die Storno-Nachricht für die heimische Einlieferung einer marktfähigen Sicherheit entspricht der in Kapitel 4.2.1.1.1.1 dargestellten Nachricht zur Einlieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.



**4.2.1.1.1.3 Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 544 domestic (CBF-Konto 7069)**

Die Deutsche Bundesbank (Sender BIC: MARKDEFFCCB) versendet die Bestätigungsnachricht an den Geschäftspartner.

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"// transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	23G	NEWM/ CANC		Function of the Message	4!c[/4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent confirmation MT 544

Mandatory Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
M	20C	RELA/ PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; "RELA"// transaction reference number of the MT 540 message or "PREV"// transaction reference number of the previously sent confirmation MT 544 in case of a cancellation
M	16S			End of Block	LINK

End of Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADDET
M	98a	ESET	Date/Time	Option A	:4!c//8!n;

					"ESET">//YYYYMMDD for the date on which the transaction effectively settled
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD">//YYYYMMDD for the trade date
O	90a	DEAL	Price	Option A	:4!c//4!c/15d "PRCT"/haircut
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
M	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO">//ISO currency code of the asset
O	98a	COUP	Coupon date	Option A	:4!c//8!n "COUP">//YYYYMMDD Date of next interest payment
O	98a	MATU	Maturity date	Option A	:4!c//8!n "MATU">//YYYYMMDD Date of maturity
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADDET
---	-----	--	--	--------------	---------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
M	36B	ESTT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument Settled	:4!c//4!c/15d; "ESTT"/type/ quantity of financial instrument effectively settled The type is expressed in "UNIT" if quantity is expressed as a number, "FAMT" if quantity is expressed as a face amount
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"/account with BBk

					Account (Dispositionsdepotnummer)
M	16S			End of Block	FIAC

Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator	Option A	:4!c//4!c; "SETR"//"REPU" for all trades

Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	SELL	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "SELL"//BIC code of the instructing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	DEAG	Party	Option P or R	For CBF participants: Option R: 4!c/8c/34x; DEAG//DAKV/XXXX For Euroclear and Clearstream Banking Luxemburg participants: Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; DEAG//MGTCBEBEECL respectively CEDELULLXXX
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"// DAKVDEFFXXX BIC code of the place of settlement Clearstream Banking Frankfurt
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory            O=OptionalStorno Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten  
MT 544 domestic

Die Storno-Nachricht für die Bestätigung der Einlieferung einer heimischen marktfähigen Sicherheit entspricht der in Kapitel 4.2.1.1.1.3 dargestellten Nachricht zur Bestätigung der Einlieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

#### 4.2.1.1.1.4 Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 542 domestic

Der Geschäftspartner sendet die SWIFT-Instruktionen zur Auslieferung von Sicherheiten an die Deutsche Bundesbank (Receiver BIC: MARKDEFFCCB).

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

##### Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"//transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	23G	NEWM/ CANC		Function of the Message	4!c[/4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent instruction

##### Optional Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
O	20C	RELA/ PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; "NEW" for a new message "PREV"// transaction reference number of the message to be cancelled
M	16S			End of Block	LINK

##### End of Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

##### Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADDET
M	98a	SETT	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "SETT"//YYYYMMDD for the delivery date
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"//YYYYMMDD for the trade date This field must be prior to or equal to

					the settlement date.
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN Code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
O	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO"//ISO currency code of the asset
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADEDET
---	-----	--	--	--------------	----------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
M	36B	SETT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument to be settled	:4!c//4!c/15d; "SETT"//type/quantity of security to be settled The type is expressed in "UNIT" if quantity is expressed as a number, "FAMT" if quantity is expressed as a face amount
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//client's account with BBk (Dispositionsdepotnummer)
M	94a	SAFE	Place of safekeeping	Option B	:4!c//[8c]/4!c[/30x]; "SAFE"//SHHE/DAKVDEFFX XX BIC code Clearstream Banking Frankfurt.
M	16S			End of Block	FIAC

Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator	Option A	4!c//4!c; "SETR"//REPU" or "COLO" or "TRAD"

Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	BUYR	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c];

					"BUYR"//BIC code of the instructing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	REAG	Party	Option R or P	For CBF Participants: Option R: 4!c/8c/34x; "REAG"//DAKV/XXXX For Euroclear, Clearstream Banking Luxemburg and other T2S In-CSD participants: Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "REAG"//MGTCBEBEECL (respectively CEDELULLXXX or e. g. MOTIITMMXXX)
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"//DAKVDEFFXXX BIC code of the place of settlement Clearstream Banking Frankfurt.
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory      O=Optional

#### **4.2.1.1.1.5 Storno Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 542 domestic**

Die Storno-Nachricht für die Auslieferung einer heimischen marktfähigen Sicherheit entspricht der in Kapitel 4.2.1.1.1.5 dargestellten Nachricht zur Auslieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.



**4.2.1.1.1.6 Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 domestic (CBF Konto 7069)**

Die Deutsche Bundesbank (Sender BIC: MARKDEFFCCB) versendet die Bestätigungsnachricht an den Geschäftspartner.

Stat	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"//transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	23G	NEWM/ CANC		Function of the Message	4!c[/4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent confirmation MT 546

Mandatory Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
M	20C	RELA/ PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; "RELA"// transaction reference number of the MT 542 message or "PREV"// transaction reference number of the previously sent confirmation MT 546 in case of a cancellation
M	16S			End of Block	LINK

End of Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADDET
M	98a	ESET	Date/Time	Option A	:4!c//8!n;

					"ESET"//YYYYMMDD for the date on which the transaction effectively settled
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"//YYYYMMDD for the trade date
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN Code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
M	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO"//ISO currency code of the asset
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADEDET
---	-----	--	--	--------------	----------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
M	36B	ESTT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument Settled	:4!c//4!c/15d; "ESTT"//type/ Quantity of financial instrument effectively settled The type is expressed in "UNIT" if quantity is expressed as a number, "FAMT" if quantity is expressed as a face amount
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//client's account with BBk (Dispositionsdepotnummer)
M	16S			End of Block	FIAC

Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
---	-----	--	--	----------------	--------

M	22F	SETR	Indicator	Option A	4!c//4!c; "SETR"//"REPU" for all trades
---	-----	------	-----------	----------	--

Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	BUYR	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "BUYR"//BIC code of the instructing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	REAG	Party	Option R or P	For CBF Participants: Option R: 4!c/8c/34x; REAG//DAKV/XXXX For Euroclear and Clearstream Banking Luxemburg participants: Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; REAG//MGTCBEBEECL respectively CEDELULLXXX
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"//DAKVDEFFXXX BIC code of the place of settlement.
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory      O=Optional

#### **4.2.1.1.1.7 Storno Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 domestic**

Die Storno-Nachricht für die Bestätigung der Auslieferung einer heimischen marktfähigen Sicherheit entspricht der in Kapitel 4.2.1.1.1.7 dargestellten Nachricht zur Bestätigung der Auslieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

#### 4.2.1.1.2 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via SWIFT Nachricht im Link-Verfahren

Für die genaue inhaltliche Ausgestaltung der SWIFT-Nachrichten im Link-Verfahren verweisen wir auf den CASCADE Link Guide der Clearstream.

##### 4.2.1.1.2.1 Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 540 im Link-Verfahren über Clearstream Frankfurt (CBF-Konto 7069)

Der Geschäftspartner sendet die SWIFT- Instruktionen zur Einlieferung von Sicherheiten an die Deutsche Bundesbank (Receiver BIC:MARKDEFFCCB).

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

#### Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"// transaction reference number of the operation This field must be unique for each instruction sent
M	23G	NEWM/ CANC		Function of the Message	4!c[/4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent instruction

#### Optional Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
M	20C	RELA/ PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; for a new message RELA/NEW PREV// transaction reference number of the message to be cancelled
M	16S			End of Block	LINK

End of Mandatory Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADDET
M	98a	SETT	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "SETT"//YYYYMMDD for the delivery date
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"//YYYYMMDD for the trade date This field must be prior to or equal to the settlement date.
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
O	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO"//ISO currency code of the asset
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADDET
---	-----	--	--	--------------	---------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
M	36B	SETT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument to be settled	:4!c//4!c/15d; "SETT"//type/ Quantity of financial instrument to be settled The type is expressed in "FAMT" if quantity is expressed as a face amount The type is expressed in

					"UNIT" if quantity is expressed as a number
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//account of client with BBk (Dispositionsdepotnummer)
M	94a	SAFE	Place of safekeeping	Option B	:4!c/[8c]/4!c/[30x]; "SAFE"//SHHE"/DAKVDEFF XXX BIC code Clearstream Banking Frankfurt.
M	16S			End of Block	FIAC

#### Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator		:4!c//4!c; "SETR"// "REPU" or "COLI" or "TRAD"

#### Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	SELL	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "SELL"//BIC code of the instructing party
O	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//35x; "SAFE"//Safekeeping account
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	DEAG	Party	Option R	Option R: 4!c/8c/34x; "DEAG"//Issuer code /Proprietary code. Issuer code= DAKV
	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"// DAKVDEFFXXX
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory

O=Optional



#### ***4.2.1.1.2.2 Storno Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 540 im Link-Verfahren über Clearstream Frankfurt (CBF Konto 7069)***

Die Storno-Nachricht für die Einlieferung einer marktfähigen Sicherheit im Link-Verfahren entspricht der in Kapitel 4.2.1.1.2.1 dargestellten Nachricht zur Einlieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

**4.2.1.1.2.3 Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 544 im Link-Verfahren über Clearstream Frankfurt (CBF Konto 7069)**

Die Deutsche Bundesbank (Sender BIC: MARKDEFFCCB) versendet die Bestätigungsnachricht an den Geschäftspartner.

Stat	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"// transaction reference number of the operation This field must be unique for each instruction sent
M	23G	NEWM/ CANC		Function of the Message	4!c[/4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent instruction

Optional Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
M	20C	RELA/ PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; RELA//transaction reference number of the previously sent message PREV// transaction reference number of the message to be cancelled
M	16S			End of Block	LINK

End of Mandatory Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADEDET
M	98a	ESET	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "ESET"//YYYYMMDD for the date on which the transaction effectively settled
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"//YYYYMMDD for the trade date
O	90a	DEAL	Price	Option A	:4!c//4!c/15d "PRCT"/haircut
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
M	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO"//ISO currency code of the asset
O	98a	COUP	Coupon date	Option A	:4!c//8!n "COUP"//YYYYMMDD Date of next interest payment
O	98a	MATU	Maturity Date	Option A	:4!c//8!n "MATU"//YYYYMMDD Date of maturity
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADEDET
---	-----	--	--	--------------	----------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
M	36B	ESTT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument to be settled	:4!c//4!c/15d; "ESTT"//type/ Quantity of financial instrument to be settled

					The type is expressed in "FAMT" if quantity is expressed as a face amount The type is expressed in "UNIT" if quantity is expressed as a number
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//account of client with BBk (Dispositionsdepotnummer)
M	16S			End of Block	FIAC

#### Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator		:4!c//4!c; "SETR"//"REPU" for all trades

#### Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	SELL	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "SELL"//BIC code of the instructing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	DEAG	Party	Option R or Option P	For CBF Participants: Option R: 4!c//8c/34x; "DEAG"//DAKV/Proprietary code. For Euroclear and Clearstream Banking Luxemburg participants: Option P: Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "DEAG"//MGTCBEBEECL respectively CEDELULLXXX
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"//DAKVDEFFXXX
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory

O=Optional

#### ***4.2.1.1.2.4 Storno Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 544 im Link-Verfahren über Clearstream Frankfurt (CBF Konto 7069)***

Die Storno-Nachricht für die Einlieferung einer marktfähigen Sicherheit im Link-Verfahren entspricht der in Kapitel 4.2.1.1.2.5 dargestellten Nachricht zur Einlieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

**4.2.1.1.2.5 Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 542 im Link-Verfahren über Clearstream Frankfurt (CBF Konto 7069)**

Der Geschäftspartner sendet die SWIFT-Instruktionen zur Auslieferung von Sicherheiten im Link-Verfahren an die Deutsche Bundesbank (Receiver BIC: MARKDEFFCCB).

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"// transaction reference number of the operation This field must be unique for each instruction sent
M	23G	NEWM/ CANC		Function of the Message	4!c/[4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent instruction

Optional Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
M	20C	RELA/ PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; for a new message RELA//NEW PREV// transaction reference number of the message to be cancelled
M	16S			End of Block	LINK

End of Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADDET
---	-----	--	--	----------------	---------

M	98a	SETT	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "SETT"//YYYYMMDD for the delivery date
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"//YYYYMMDD for the trade date
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
O	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO"//ISO currency code of the asset
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADEDET
---	-----	--	--	--------------	----------

Repetitive Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
M	36B	SETT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument to be settled	:4!c//4!c//15d; "SETT"//type/ Quantity of financial instrument to be settled The type is expressed in "FAMT" if quantity is expressed as a face amount The type is expressed in "UNIT" if quantity is expressed as a number
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//account of client with BBk (Dispositionsdepotnummer)



M	94a	SAFE	Place of safekeeping	Option B	:4!c/[8c]/4!c[/30x]; "SAFE"/SHHE/ DAKVDEFFXXX
M	16S			End of Block	FIAC

Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator		:4!c//4!c; "SETR"//"REPU" or "COLO" or "TRAD"

Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	BUYR	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "BUYR"//BIC code of the instructing party
O	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//35x; "SAFE"//Safekeeping account
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	REAG	Party	Option R	Option R: 4!c/8c/34x; "REAG"//DAKV /Proprietary code.
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"// DAKVDEFFXXX
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory      O=Optional

#### ***4.2.1.1.2.6 Storno Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 542 im Link-Verfahren über Clearstream Frankfurt (CBF Konto 7069)***

Die Storno-Nachricht für die Auslieferung einer marktfähigen Sicherheit im Link-Verfahren entspricht der in Kapitel 4.2.1.1.2.9 dargestellten Nachricht zur Auslieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

**4.2.1.1.2.7 Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 im Link-Verfahren über Clearstream Frankfurt (CBF Konto 7069)**

**Die Deutsche Bundesbank (Sender BIC: MARKDEFFCCB) versendet die Bestätigungsnachricht an den Geschäftspartner.**

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

**Mandatory Sequence A - General Information**

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"// transaction reference number of the operation This field must be unique for each instruction sent
M	23G	NEWM/ CANC		Function of the Message	4!c[/4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent instruction

**Mandatory Repetitive Subsequence A1 - Linkages**

M	16R			Start of Block	LINK
M	20C	RELA/ PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; RELA//transaction reference number of the previously sent message PREV// transaction reference number of the message to be cancelled
M	16S			End of Block	LINK

**End of Sequence A - General Information**

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

**Mandatory Sequence B - Trade Details**

M	16R			Start of Block	TRADDET
---	-----	--	--	----------------	---------

M	98a	ESET	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "ESET"//YYYYMMDD for the date at which the transaction effectively settled
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"//YYYYMMDD for the trade date
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
O	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO"//ISO currency code of the asset
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADET
---	-----	--	--	--------------	--------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
M	36B	ESTT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument to be settled	:4!c//4!c/15d; "ESTT"//type/ Quantity of financial instrument to be settled The type is expressed in "FAMT" if quantity is expressed as a face amount The type is expressed in "UNIT" if quantity is expressed as a number
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//account of client with BBk (Dispositionsdepotnummer)

M	16S			End of Block	FIAC
---	-----	--	--	--------------	------

#### Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator		:4!c//4!c; "SETR"//REPU" for all trades

#### Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	BUYR	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "BUYR"//BIC code of the in- structing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	REAG	Party	Option R or Option P	For CBF Participants: Option R: 4!c/8c/34x; "REAG"//DAKV /Proprietary code. For Euroclear and Clear- stream Banking Luxemburg participants: Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "REAG"//MGTCBEBEECL re- spectively CEDELULLXXX
O	97A	SAFE	Account	Option A	:4!c//35x; "SAFE"//Safekeeping account Mandatory when 95P is used
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"//DAKVDEFFXXX
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory

O=Optional

#### **4.2.1.1.2.8 Storno Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 im Link-Verfahren über Clearstream Frankfurt (CBF Konto 7069)**

Die Storno-Nachricht für die Auslieferung einer marktfähigen Sicherheit im Link-Verfahren entspricht der in Kapitel 4.2.1.1.2.13 dargestellten Nachricht zur Auslieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

#### 4.2.1.2 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via Extranet XML

##### 4.2.1.2.1 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via ExtraNet XML domestic

###### 4.2.1.2.1.1 Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML domestic

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *SESE\_NEW\_IldNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).

<b>Element/Attribut</b>					
<b>SctiesStlmTxInstr</b>					
type SecuritiesSettlement-TransactionInstructionV02Subset					
xs:sequence	<b>TxId</b>				
	type Restricted-FINXMax16Text				
	Length 1-16				
	Pattern value="([0-9a-zA-Z-!?:\(\)\ , ' + ]([0-9a-zA-Z-!?:\(\)\ , ' + ]*( [0-9a-zA-Z-!?:\(\)\ , ' + ] )?)*)"				
	<b>StlmTpAndAddtl-Params</b>				
	type SettlementTypeAndAdditionalParameters4				
	xs:sequence	<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			



		Anwendbare Codes:			
		RECE			
		Pmt			
		type DeliveryReceiptType2Code			
		Anwendbare Codes			
		Free			
	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDe- tails15				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				Format yyyy-mm-dd	
		<b>SttlmDt</b>			
		type SettlementDate4Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				Format yyyy-mm-dd	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentifica- tion15				

	xs:sequence	<b>ISIN</b>			
		type ISINIdentifier			
		pattern value="[A-Z0-9]{12,12}"			
		<b>QtyAndAcctDtIs</b>			
		type QtyAndAcctDtIs			
	xs:sequence	<b>StlmQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrumentQuantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFIN- ImpliedCurrencyAndA- mount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDeci- malNumber	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type RestrictedFINXMax35Text		
				<i>pattern value="[0-9a-zA-Z/\-!?:\(\)\.,'+ ]{1,35}"</i>	

			Length 1 .. 35		
		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlaceFormat4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
			type SafekeepingPlaceTypeAndAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1Code	
				Anwendbare Codes	
				CUST ICSD NCSD SHHE	
				<b>ID</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				Pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"	
	<b>SttlmParams</b>				
	type SettlementDetails35				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransactionType4Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
			type SecuritiesTransactionType1Code		
			Anwendbare Codes		
			COLI REPU TRAD		

	<b>DlvrgSttlmPties</b>				
	type SettlementParties18				
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>			
		type PartyIdentification52			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification58Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification62Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
			<b>SfkpgAcct</b>		
			type SecuritiesAccount17		
			xs:sequence	<b>Id</b>	

				type Restricted-FINXMax35Text	
				<b>Tp</b>	
				type GenericIdentification25	
				xs:sequence	<b>Id</b>
				xs:choice	typeExact4AlphaNumericText
					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNumericText
		<b>Pty2</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			

#### 4.2.1.2.1.2 Storno Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML domestic

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *SESE\_NEW\_CANCEL\_lfdNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).

<b>Element/Attribut</b>			
<b>SctiesMsgCxlAdv</b>			
type= "SecuritiesMessageCancellationAdviceV02Subset"			
xs:sequence	<b>Ref</b>		
	type= "References20Choice"		
	xs:sequence	<b>SctiesSttlmTxInstr</b>	
		type SecuritiesSettlementTransactionInstructionV02Subset	
		xs:sequence	<b>TxId</b>
			type Restricted-FINXMax16Text
			Length 1-16
			pattern value="([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]*([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ])?\(\)\.,\'+ ])?)*"
			<b>SctiesMvmntTp</b>

			type ReceiveDelivery1Code
			Anwendbare Codes:
			RECE
			<b>Pmt</b>
			type DeliveryReceiptType2Code
			Anwendbare Codes
			Free
	<b>AcctOwnr</b>		
	type= "PartyIdentification51Choice		
	xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
		type AnyBICIdentifier	
		pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"	
	<b>SfkpgAcct</b>		
	type SecuritiesAccount17		
	xs:sequence	<b>Id</b>	
		type RestrictedFINXMax35Text	
		pattern value="[0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+]{1,35}"	
		Length 1 .. 35	

#### 4.2.1.2.1.3 Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML domestic

<b>Element / Attribute</b>					
<b>SctiesStlmTxConf</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-ConfirmationV02Subset					
xs:sequence	<b>TxldDtIs</b>				
	type SettlementTypeAndIdentification11				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxId</b>			
		type Restricted-FINXMax16Text			
		length 1 .. 16			
		pattern "[([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ]([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ]*([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ])?)*"			
		<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			
		AnwendbareCodes:			
		RECE			
		<b>Pmt</b>			
		type DeliveryReceiptType2Code			
		Anwendbare Codes:			
		FREE			



	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDe- tails16				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
		<b>FctvSttlmDt</b>			
		type Settlement- Date5Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentifica- tion15				
	xs:sequence	<b>ISIN</b>			
		type ISINIdentifier			
		<i>pattern "[A-Z0-9]{12,12}"</i>			

	<b>QtyAndAcctDtls</b>				
	type QuantityAndAccount20				
	xs:sequence	<b>SttldQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrumentQuantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimalNumber	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type RestrictedFINXMax35Text		
			<i>pattern value="[0-9a-zA-Z\-\ ?:\ )\ , + ]{1,35}"</i>		
			<i>Length 1 .. 35</i>		

		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlace- Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
		xs:choice	type SafekeepingPlaceTypeAn- dAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>Id</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2- 9][A-NP-Z0-9]([A-Z0- 9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<b>SttlmParams</b>				
	type SettlementDetails33				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransac- tionType6Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
		xs:choice	type SecuritiesTransaction- Type1Code		
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>COLI REPU TRAD</i>	
	<b>DlvrgSttlmPties</b>				

	type SettlementParties18				
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>			
		type PartyIdentification52			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification58Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification62Choice		
			xs:sequence	<b>Prtryld</b>	
			xs:choice	type GenericIdentification24	<b>Id</b>
				xs:sequence	type RestrictedFINXMax34Text
					<i>pattern value="([0-9a-zA-Z1-?:\ ,1+][0-9a-zA-Z1-?:\ ,1+]*[0-9a-zA-Z1-?:\ ,1+])?)"</i>
					<i>Length 1 .. 34</i>

					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNumericText
		<b>Pty2</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			

#### 4.2.1.2.1.4 Storno Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML domestic

<b>Element/Attribut</b>					
<b>SctiesTxCxlReqStsAdv</b>					
type=SecuritiesTransactionCancellationRequestStatusAdviceV03					
xs:sequence	<b>CxlReqRef</b>				
	type=Identification1				
	xs:sequence	<b>Id</b>			
		type=Max35Text			
	<b>TxId</b>				
	type=TransactionIdentifications17				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxId</b>			
		type=References22Choice			
		xs:choice	<b>SctiesSttlmTxId</b>		
			type=SettlementTypeAndIdentification13		
			xs:sequence	<b>TxId</b>	
				type=Max35Text	
				Length 1-35	
				<b>SctiesMvmntTp</b>	
	-			type ReceiveDelivery1Code	
				Anwendbare Codes:	
				RECE	
				<b>Pmt</b>	
				type DeliveryReceiptType2Code	

	-			Anwendbare Codes	
				FREE APMT	
	<b>PrcgSts</b>				
	type=ProcessingSta- tus20Choice				
	xs:choice	<b>Canc</b>			
		type=CancellationSta- tus9Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=CancellationReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=Cancellation- Reason3Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>
					type=CancelledSta- tusReason5Code
					Anwendbare Codes:
					CANI OTHR
		<b>Dnd</b>			
		type=DeniedSta- tus6Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=DeniedReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=DeniedReason2Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>
					type=Denied- Reason4Code

					Anwendbare Codes:
					ADEA DCAN DPRG DREP
					DSET LATE OTHR CDRG
					CDCY CDRE



#### 4.2.1.2.1.5 Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML domestic

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *SESE\_NEW\_IldNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).col

<b>Element/Attribut</b>					
<b>SctiesSttlmTxInstr</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-InstructionV02Subset					
xs:sequence	<b>TxId</b>				
	type RestrictedFINXMax16Text				
	Length 1-16				
	Pattern value="([0-9a-zA-Z- ?:\(\)\ , ' + ]([0-9a-zA-Z- ?:\(\)\ , ' + ]*([0-9a-zA-Z- ?:\(\)\ , ' + ])?)*")"				
	<b>SttlmTpAndAddtlParams</b>				
	type SettlementTypeAndAdditionalParameters4				
	xs:sequence	<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			
		Anwendbare Codes:			
		DELI			
		<b>Pmt</b>			

		type DeliveryReceipt- Type2Code			
		Anwendbare Codes			
		Free			
	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDetails15				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDa- teTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				Format yyyy-mm-dd	
		<b>SttlmDt</b>			
		type Settlement- Date4Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDa- teTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				Format yyyy-mm-dd	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentification15				
	xs:sequence	<b>ISIN</b>			

		type ISINIdentifier			
		pattern value="[A-Z0-9]{12,12}"			
	<b>QtyAndAcctDtIs</b>				
	type QtyAndAcctDtIs				
	xs:sequence	<b>SttlmQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrument-Quantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimal-Number	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type Restricted-FINXMax35Text		

			<i>pattern value="[0-9a-zA-Z/\- ?:\( \),\!+ ]{1,35}"</i>		
			<i>Length 1 .. 35</i>		
		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlace- Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
			type SafekeepingPlace- TypeAndAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>ID</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>Pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<b>SttlmParams</b>				
	type SettlementDetails35				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransactionType4Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
			type SecuritiesTransactionType1Code		
			<i>Anwendbare Codes</i>		

			COLO REPU TRAD	
	<b>RcvgSttlmPties</b>			
	type SettlementParties18			
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>		
		type PartyIdentification52		
		xs:sequence	<b>ID</b>	
		type PartyIdentification58Choice		
		xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
		xs:choice	type AnyBICIdentifier	
			<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>		
		type PartyIdentificationAndAccount63		
		xs:sequence	<b>ID</b>	
		type PartyIdentification62Choice		
		xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
		xs:choice	type AnyBICIdentifier	
			<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
			<b>SfkpgAcct</b>	
		type SecuritiesAccount17		
		xs:sequence	<b>Id</b>	

				type RestrictedFINXMax35Text	
				<b>Tp</b>	
				type GenericIdentification25	
				xs:sequence	<b>Id</b>
				xs:choice	typeExact4AlphaNu- mericText
					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNu- mericText
			<b>Pty2</b>		
			type PartyIdentificatio- nAndAccount63		
			<i>interacts with party</i> <i>1(same structure)</i>		

#### 4.2.1.2.1.6 Storno Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML domestic

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *SESE\_NEW\_CANCEL\_lfdNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).

<b>Element/Attribut</b>			
<b>SctiesMsgCxlAdv</b>			
type= "SecuritiesMessageCancellationAdviceV02Subset"			
xs:sequence	<b>Ref</b>		
	type= "References20Choice"		
	xs:sequence	<b>SctiesSttlmTxInstr</b>	
		type SecuritiesSettlementTransactionInstructionV02Subset	
		xs:sequence	<b>TxId</b>
			type Restricted-FINXMax16Text
			Length 1-16
			pattern value="([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]*([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ])?\(\)\.,\'+ ])?)*"
			<b>SctiesMvmntTp</b>

			type ReceiveDelivery1Code
			Anwendbare Codes:
			DELI
			<b>Pmt</b>
			type DeliveryReceiptType2Code
			Anwendbare Codes
			Free
	<b>AcctOwnr</b>		
	type= "PartyIdentification51Choice		
	xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
		type AnyBICIdentifier	
		pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"	
	<b>SfkpgAcct</b>		
	type SecuritiesAccount17		
	xs:sequence	<b>Id</b>	
		type RestrictedFINXMax35Text	
		pattern value="[0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,'\+]{1,35}"	
		Length 1 .. 35	



#### 4.2.1.2.1.7 Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML domestic

<b>Element / Attribute</b>					
<b>SctiesStlmTxConf</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-ConfirmationV02Subset					
xs:sequence	<b>TxldDtIs</b>				
	type SettlementTypeAndIdentification11				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxld</b>			
		type Restricted-FINXMax16Text			
		length 1 .. 16			
		pattern "[([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ]([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ]*([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ])?)*"			
		<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			
		AnwendbareCodes:			
		DELI			
		<b>Pmt</b>			
		type DeliveryReceiptType2Code			
		Anwendbare Codes:			
		FREE			

	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDe- tails16				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
		<b>FctvSttlmDt</b>			
		type Settlement- Date5Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentifica- tion15				
	xs:sequence	<b>ISIN</b>			
		type ISINIdentifier			
		<i>pattern "[A-Z0-9]{12,12}"</i>			

	<b>QtyAndAcctDtls</b>				
	type QuantityAndAccount20				
	xs:sequence	<b>SttldQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrumentQuantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimalNumber	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type RestrictedFINXMax35Text		
			<i>pattern value="[0-9a-zA-Z\-\ ?:\ )!,\ + ]{1,35}"</i>		
			<i>Length 1 .. 35</i>		

		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlace- Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
		xs:choice	type SafekeepingPlaceTypeAn- dAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>Id</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2- 9][A-NP-Z0-9]([A-Z0- 9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<b>SttlmParams</b>				
	type SettlementDetails33				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransac- tionType6Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
		xs:choice	type SecuritiesTransaction- Type1Code		
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>COLO REPU TRAD</i>	
	<b>RcvgSttlmPties</b>				

	type SettlementParties18				
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>			
		type PartyIdentification52			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification58Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification62Choice		
			xs:sequence	<b>Prtryld</b>	
			xs:choice	type GenericIdentification24	<b>Id</b>
				xs:sequence	type RestrictedFINXMax34Text
					<i>pattern value="([0-9a-zA-Z1-?:\ ,1+][0-9a-zA-Z1-?:\ ,1+]*[0-9a-zA-Z1-?:\ ,1+])?)"</i>
					<i>Length 1 .. 34</i>

					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNumericText
		<b>Pty2</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			

#### 4.2.1.2.1.8 Storno Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML domestic

<b>Element/Attribut</b>					
<b>SctiesTxCxlReqStsAdv</b>					
type=SecuritiesTransactionCancellationRequestStatusAdviceV03					
xs:sequence	<b>CxlReqRef</b>				
	type=Identification1				
	xs:sequence	<b>Id</b>			
		type=Max35Text			
	<b>TxId</b>				
	type=TransactionIdentifications17				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxId</b>			
		type=References22Choice			
		xs:choice	<b>SctiesStlmTxId</b>		
			type=SettlementTypeAndIdentification13		
			xs:sequence	<b>TxId</b>	
				type=Max35Text	
				<i>Length 1-35</i>	
				<b>SctiesMvmntTp</b>	
	-			type ReceiveDelivery1Code	
				<i>Anwendbare Codes:</i>	
				<i>DELI</i>	
				<b>Pmt</b>	

				type DeliveryReceiptType2Code	
	-			Anwendbare Codes	
				FREE APMT	
	<b>PrcgSts</b>				
	type=ProcessingStatus20Choice				
	xs:choice	<b>Canc</b>			
		type=CancellationStatus9Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=CancellationReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=CancellationReason3Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>
					type=CancelledStatusReason5Code
					Anwendbare Codes:
					CANI OTHR
		<b>Dnd</b>			
		type=DeniedStatus6Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=DeniedReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=DeniedReason2Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>



					type=Denied-Reason4Code
					Anwendbare Codes:
					ADEA DCAN DPRG DREP
					DSET LATE OTHR CDRG
					CDCY CDRE

#### 4.2.1.2.2 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via ExtraNet XML im Linkverfahren

##### 4.2.1.2.2.1 Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML im Linkverfahren

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *SESE\_NEW\_lfdNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).

<b>Element/Attribut</b>					
<b>SctiesSttlmTxInstr</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-InstructionV02Subset					
xs:sequence	<b>Txid</b>				
	type RestrictedFINXMax16Text				
	Length 1-16				
	Pattern value="([0-9a-zA-Zl?:(\) , ' + ]([0-9a-zA-Zl?:(\) , ' + ]*([0-9a-zA-Zl?:(\) , ' + ])?)*)"				
	<b>SttlmTpAndAddtlParameters</b>				
	type SettlementTypeAndAdditionalParameters4				
	xs:sequence	<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			

		Anwendbare Codes:			
		RECE			
		<b>Pmt</b>			
		type DeliveryReceipt- Type2Code			
		Anwendbare Codes			
		Free			
	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDetails15				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDa- teTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				Format yyyy-mm-dd	
		<b>SttlmDt</b>			
		type Settlement- Date4Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDa- teTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				Format yyyy-mm-dd	

	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentification15				
	xs:sequence	<b>ISIN</b>			
		type ISINIdentifier			
		pattern value="[A-Z0-9]{12,12}"			
	<b>QtyAndAcctDtIs</b>				
	type QtyAndAcctDtIs				
	xs:sequence	<b>StlmQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrument-Quantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimal-Number	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		

			type Restricted-FINXMax35Text		
			<i>pattern value="[/0-9a-zA-Z/\ ?:\ \\ , + ]{1,35}"</i>		
			<i>Length 1 .. 35</i>		
		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlace-Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
			type SafekeepingPlace-TypeAndAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>ID</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>Pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<b>StlmParams</b>				
	type SettlementDetails35				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransactionType4Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
			type SecuritiesTransactionType1Code		

			Anwendbare Codes	
			COLI REPU TRAD	
	<b>DlvrgSttlmPties</b>			
	type SettlementParties18			
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>		
		type PartyIdentification52		
		xs:sequence	<b>ID</b>	
			type PartyIdentification58Choice	
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>
			xs:choice	type AnyBICIdentifier
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>
		<b>Pty1</b>		
		type PartyIdentificationAndAccount63		
		xs:sequence	<b>ID</b>	
			type PartyIdentification62Choice	
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>
			xs:choice	type AnyBICIdentifier
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>
			<b>SfkpgAcct</b>	
			type SecuritiesAccount17	

			xs:sequence	<b>Id</b>	
				Type Restricted-FINXMax35Text	
				<b>Tp</b>	
				type GenericIdentification25	
				xs:sequence	<b>Id</b>
				xs:choice	typeExact4AlphaNumericText
					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNumericText
		<b>Pty2</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			
		<b>Pty3</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			

#### 4.2.1.2.2.2 Storno Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML im Linkverfahren

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *SESE\_NEW\_CANCEL\_lfdNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).

<b>Element/Attribut</b>			
<b>SctiesMsgCxlAdv</b>			
type= "SecuritiesMessageCancellationAdviceV02Subset"			
xs:sequence	<b>Ref</b>		
	type= "References20Choice"		
	xs:sequence	<b>SctiesSttlmTxInstr</b>	
		type SecuritiesSettlementTransactionInstructionV02Subset	
		xs:sequence	<b>Txid</b>
			type Restricted-FINXMax16Text
			Length 1-16
			pattern value="([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]*([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ])?\(\)\.,\'+ ])?)*"
			<b>SctiesMvmntTp</b>



			type ReceiveDelivery1Code
			Anwendbare Codes:
			RECE
			<b>Pmt</b>
			type DeliveryReceiptType2Code
			Anwendbare Codes
			Free
	<b>AcctOwnr</b>		
	type= "PartyIdentification51Choice		
	xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
		type AnyBICIdentifier	
		pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"	
	<b>SfkpgAcct</b>		
	type SecuritiesAccount17		
	xs:sequence	<b>Id</b>	
		type RestrictedFINXMax35Text	
		pattern value="[0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,'\+]{1,35}"	
		Length 1 .. 35	

#### 4.2.1.2.2.3 Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML im Linkverfahren

<b>Element / Attribute</b>					
<b>SctiesSttlmTxConf</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-ConfirmationV02Subset					
xs:sequence	<b>TxldDtIs</b>				
	type SettlementTypeAndIdentification11				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxld</b>			
		type Restricted-FINXMax16Text			
		length 1 .. 16			
		pattern "[([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ]([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ]*([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ])?)*"			
		<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			
		AnwendbareCodes:			
		RECE			
		<b>Pmt</b>			
		type DeliveryReceiptType2Code			
		Anwendbare Codes:			
		FREE			

	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDe- tails16				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
		<b>FctvSttlmDt</b>			
		type Settlement- Date5Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentifica- tion15				
	xs:sequence	<b>ISIN</b>			
		type ISINIdentifier			
		<i>pattern "[A-Z0-9]{12,12}"</i>			

	<b>QtyAndAcctDtls</b>				
	type QuantityAndAccount20				
	xs:sequence	<b>SttldQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrumentQuantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimalNumber	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type RestrictedFINXMax35Text		
			<i>pattern value="[0-9a-zA-Z\-\ ?:\ )!,\ + ]{1,35}"</i>		
			<i>Length 1 .. 35</i>		

		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlace-Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
		xs:choice	type SafekeepingPlaceTypeAndAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>Id</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<b>SttlmParams</b>				
	type SettlementDetails33				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransactionType6Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
		xs:choice	type SecuritiesTransactionType1Code		
			<i>Anwendbare Codes</i>		
			<i>COLI REPU TRAD</i>		
	<b>DlvgSttlmPties</b>				

	type SettlementParties18				
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>			
		type PartyIdentification52			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification58Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification62Choice		
			xs:sequence	<b>Prtryld</b>	
			xs:choice	type GenericIdentification24	<b>Id</b>
				xs:sequence	type RestrictedFINXMax34Text
					<i>pattern value= "([0-9a-zA-Z1-1?:\ )\ ,1+][([0-9a-zA-Z1-1?:\ )\ ,1+]*([0-9a-zA-Z1-1?:\ )\ ,1+])?)*"</i>
					<i>Length 1 .. 34</i>

					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNumericText
		<b>Pty2</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			
		<b>Pty3</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			

#### 4.2.1.2.2.4 Storno Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML im Linkverfahren

<u>Element/Attribut</u>					
<b>SctiesTxCxlReqStsAdv</b>					
type=SecuritiesTransactionCancellationRequestStatusAdviceV03					
xs:sequence	<b>CxlReqRef</b>				
	type=Identification1				
	xs:sequence	<b>Id</b>			
		type=Max35Text			
	<b>TxId</b>				
	type=TransactionIdentifications17				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxId</b>			
		type=References22Choice			
		xs:choice	<b>SctiesSttlmTxId</b>		
			type=SettlementTypeAndIdentification13		
			xs:sequence	<b>TxId</b>	
				type=Max35Text	
				<i>Length 1-35</i>	
				<b>SctiesMvmntTp</b>	
				type ReceiveDelivery1Code	
				<i>Anwendbare Codes:</i>	
				<i>RECE</i>	
				<b>Pmt</b>	
				type DeliveryReceiptType2Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	



				FREE APMT	
	<b>PrcgSts</b>				
	type=ProcessingStatus20Choice				
	xs:choice	<b>Canc</b>			
		type=CancellationStatus9Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=CancellationReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=CancellationReason3Choice	
					<b>Cd</b>
					type=CancelledStatusReason5Code
					Anwendbare Codes:
					CANI OTHR
		<b>Dnd</b>			
		type=DeniedStatus6Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=DeniedReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=DeniedReason2Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>
					type=DeniedReason4Code

					Anwendbare Codes:
					ADEA DCAN DPRG DREP
					DSET LATE OTHR CDRG
					CDCY CDRE

#### 4.2.1.2.2.5 Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML im Linkverfahren

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *SESE\_NEW\_lfdNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).

<b>Element/Attribut</b>					
<b>SctiesSttlmTxInstr</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-InstructionV02Subset					
xs:sequence	<b>TxId</b>				
	type RestrictedFINXMax16Text				
	Length 1-16				
	Pattern value="([0-9a-zA-Z- ?:\ \\ , +  ]*([0-9a-zA-Z- ?:\ \\ , +  ]*))"				
	<b>SttlmTpAndAddtlParams</b>				
	type SettlementTypeAndAdditionalParameters4				
	xs:sequence	<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			
		Anwendbare Codes:			
		DELI			
		<b>Pmt</b>			

		type DeliveryReceipt- Type2Code			
		Anwendbare Codes			
		Free			
	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDetails15				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDa- teTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				Format yyyy-mm-dd	
		<b>SttlmDt</b>			
		type Settlement- Date4Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDa- teTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				Format yyyy-mm-dd	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentification15				
	xs:sequence	<b>ISIN</b>			

		type ISINIdentifier			
		pattern value="[A-Z0-9]{12,12}"			
	<b>QtyAndAcctDtIs</b>				
	type QtyAndAcctDtIs				
	xs:sequence	<b>SttlmQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrument-Quantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimal-Number	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type Restricted-FINXMax35Text		

			<i>pattern value="[0-9a-zA-Z/\- ?:\(\) , + ]{1,35}"</i>		
			<i>Length 1 .. 35</i>		
		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlace- Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
			type SafekeepingPlace- TypeAndAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>ID</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>Pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>SttlmParams</b>			
		type SettlementDetails35			
		xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>		
		type SecuritiesTransactionType4Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
			type SecuritiesTransaction- Type1Code		
			<i>Anwendbare Codes</i>		

			COLO REPU TRAD		
	<b>RcvgSttlmPties</b>				
	type SettlementParties18				
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>			
		type PartyIdentification52			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification58Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification62Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
			<b>SfkpgAcct</b>		
			type SecuritiesAccount17		
			xs:sequence	<b>Id</b>	

				type RestrictedFINXMax35Text	
				<b>Tp</b>	
				type GenericIdentification25	
				xs:sequence	<b>Id</b>
				xs:choice	typeExact4AlphaNu- mericText
					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNu- mericText
			<b>Pty2</b>		
			type PartyIdentificatio- nAndAccount63		
			<i>interacts with party 1(same structure)</i>		
			<b>Pty3</b>		
			type PartyIdentificatio- nAndAccount63		
			<i>interacts with party 1(same structure)</i>		



#### 4.2.1.2.2.6 Storno Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML im Linkverfahren

Bitte beachten Sie bei der Auftragserteilung die Namenskonvention *SESE\_NEW\_CANCEL\_lfdNr*, deren Einhaltung für eine fehlerfreie Verarbeitung notwendig ist. Die laufende Nummer kann frei vergeben werden (z.B. Timestamp).

<b>Element/Attribut</b>			
<b>SctiesMsgCxlAdv</b>			
type= "SecuritiesMessageCancellationAdviceV02Subset"			
xs:sequence	<b>Ref</b>		
	type= "References20Choice"		
	xs:sequence	<b>SctiesSttlmTxInstr</b>	
		type SecuritiesSettlementTransactionInstructionV02Subset	
		xs:sequence	<b>Txid</b>
			type Restricted-FINXMax16Text
			Length 1-16
			pattern value="([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]*([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ])?\(\)\.,\'+ ])?)*"
			<b>SctiesMvmntTp</b>

			type ReceiveDelivery1Code
			Anwendbare Codes:
			DELI
			<b>Pmt</b>
			type DeliveryReceiptType2Code
			Anwendbare Codes
			Free
	<b>AcctOwnr</b>		
	type= "PartyIdentification51Choice		
	xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
		type AnyBICIdentifier	
		pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"	
	<b>SfkpgAcct</b>		
	type SecuritiesAccount17		
	xs:sequence	<b>Id</b>	
		type RestrictedFINXMax35Text	
		pattern value="[0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+]{1,35}"	
		Length 1 .. 35	

#### 4.2.1.2.2.7 Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML im Linkverfahren

<b>Element / Attribute</b>					
<b>SctiesSttlmTxConf</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-ConfirmationV02Subset					
xs:sequence	<b>TxldDtls</b>				
	type SettlementTypeAndIdentification11				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxld</b>			
		type Restricted-FINXMax16Text			
		length 1 .. 16			
		pattern "[([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ]([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ]*([0-9a-zA-Z- ?:\ ),'+ ])?)*"			
		<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			
		AnwendbareCodes:			
		DELI			
		<b>Pmt</b>			
		type DeliveryReceiptType2Code			
		Anwendbare Codes:			
		FREE			

	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDe- tails16				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
		<b>FctvSttlmDt</b>			
		type Settlement- Date5Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentifica- tion15				
	xs:sequence	<b>ISIN</b>			
		type ISINIdentifier			
		<i>pattern "[A-Z0-9]{12,12}"</i>			

	<b>QtyAndAcctDtls</b>				
	type QuantityAndAccount20				
	xs:sequence	<b>SttldQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrumentQuantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimalNumber	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type RestrictedFINXMax35Text		
			<i>pattern value="[0-9a-zA-Z\-\ ?:\ )!,\ + ]{1,35}"</i>		
			<i>Length 1 .. 35</i>		

		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlace- Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
		xs:choice	type SafekeepingPlaceTypeAn- dAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>Id</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2- 9][A-NP-Z0-9]([A-Z0- 9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<b>SttlmParams</b>				
	type SettlementDetails33				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransac- tionType6Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
		xs:choice	type SecuritiesTransaction- Type1Code		
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>COLO REPU TRAD</i>	
	<b>RcvgSttlmPties</b>				

	type SettlementParties18				
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>			
		type PartyIdentification52			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification58Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification62Choice		
			xs:sequence	<b>Prtryld</b>	
			xs:choice	type GenericIdentification24	<b>Id</b>
				xs:sequence	type RestrictedFINXMax34Text
					<i>pattern value="([0-9a-zA-Z1-?:(\)\ ,1+][([0-9a-zA-Z1-?:(\)\ ,1+]*([0-9a-zA-Z1-?:(\)\ ,1+]))?)*)"</i>
					<i>Length 1 .. 34</i>

					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNumericText
		<b>Pty2</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			
		<b>Pty3</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			



#### 4.2.1.2.2.8 Storno Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML im Linkverfahren

<u>Element/Attribut</u>					
<b>SctiesTxCxlReqStsAdv</b>					
type=SecuritiesTransactionCancellationRequestStatusAdviceV03					
xs:sequence	<b>CxlReqRef</b>				
	type=Identification1				
	xs:sequence	<b>Id</b>			
		type=Max35Text			
	<b>TxId</b>				
	type=TransactionIdentifications17				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxId</b>			
		type=References22Choice			
		xs:choice	<b>SctiesSttlmTxId</b>		
			type=SettlementTypeAndIdentification13		
			xs:sequence	<b>TxId</b>	
				type=Max35Text	
				<i>Length 1-35</i>	
				<b>SctiesMvmntTp</b>	
	-			type ReceiveDelivery1Code	
				<i>Anwendbare Codes:</i>	
				<i>DELI</i>	
				<b>Pmt</b>	
				type DeliveryReceiptType2Code	

	-			Anwendbare Codes	
				FREE APMT	
	<b>PrcgSts</b>				
	type=ProcessingSta- tus20Choice				
	xs:choice	<b>Canc</b>			
		type=CancellationSta- tus9Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=CancellationReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=Cancellation- Reason3Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>
					type=CancelledSta- tusReason5Code
					Anwendbare Codes:
					CANI OTHR
		<b>Dnd</b>			
		type=DeniedSta- tus6Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=DeniedReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=DeniedReason2Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>
					type=Denied- Reason4Code

					Anwendbare Codes:
					ADEA DCAN DPRG DREP
					DSET LATE OTHR CDRG
					CDCY CDRE

### 4.2.1.3 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via ExtraNet CAP

Beispiel: Auswahlmaske Aufträge Ein-/Auslieferungen

Referenz	Status	Dispositionstyp	Auftragsart	Währung	Maturitydate	IDN	SB-Nom.
17118824	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic	07.08.2023	07.08.2023	DE001053528 BAYERN LSA 20/30 S133	2.000.000
17114031	freigegeben GP	2100041001	Auslieferung CCBM	04.08.2023	04.08.2023	NLS010721999 NETERLD 14-47	1.000.000
17094508	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	31.07.2023	31.07.2023	DE001030740 BUNDES0BLV.22/27	100.000
17048340	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	18.07.2023	18.07.2023	DE001053577 BAYERN LSA 20/25 S138	1.000.000
17025122	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	10.07.2023	DE001030740 BUNDES0BLV.22/27	6
17025121	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	11.07.2023	DE001030740 BUNDES0BLV.22/27	64.346
17025120	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	11.07.2023	DE001030740 BUNDES0BLV.22/27	785
17025118	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	10.07.2023	DE001030740 BUNDES0BLV.22/27	1.232
17025117	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	10.07.2023	DE001030740 BUNDES0BLV.22/27	1
17021091	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic	07.07.2023	07.07.2023	DE001030575 BUNDANL.V.15/46 INFLUID	1

Auswahlmöglichkeit der Ein- und Auslieferungsaufträge:

Einlieferung Domestic

Auslieferung Domestic

## Beispiel: Auftragserfassung Einlieferung Domestic

The screenshot shows the CAP system interface for 'Auftragserfassung Einlieferung Domestic'. The interface is divided into a sidebar and a main content area. The sidebar contains navigation options: 'AUSWERTUNGEN', 'AUFTRÄGE', and 'SICHERHEITENPOOL 1-5'. The main content area displays the order details, including 'Ein-/Auslieferung', 'Sicherheitskontonummer', and 'Sicherheitspool 1 - Geldpolitische Operationen'. The 'Auftragserfassung Einlieferung Domestic' section includes fields for 'Dispositionsart' (2100041001), 'Valuta' (2023-08-04), and 'Handelsdatum' (2023-08-04). A dropdown menu for 'Die Lieferung erfolgt über die Lagerstelle der Deutschen Bundesbank' is set to 'CBF (7069)'. Below this is a 'Lieferleitweg' table with columns for 'Clearingssystem (PSET)', 'Clearinglagerstelle (DEAG)', 'Kontobehälterlagerstelle (DECU)', and 'Kontobehälter (DELL)'. The selected row shows 'DAK/DEFFXXX(T2S)', 'DAK/7010', and 'Freibank | Landesbank | Capital'. A 'Sicherheiten' table below it has columns for 'ISIN', 'Bezeichnung', and 'SB\_Nom'. The interface also includes 'Abbrechen' and 'Erfassen' buttons.

Der Geschäftspartner hat die Möglichkeit über diese Maske die Lagerstelle für die Sicherheitseinlieferung CBF (7069) zu wählen.

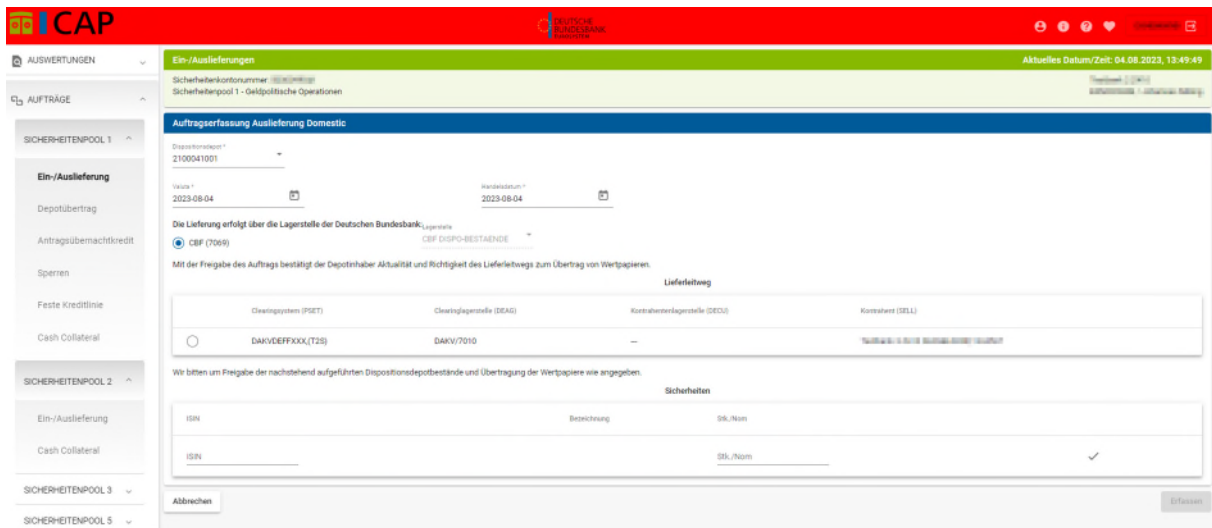
Die Eingabe des Valuta- und Handelsdatums ist manuell oder durch Auswahl per Kalenderbutton möglich (Standardmäßig wird der aktuelle Tag eingeblendet). Für die Erfassung von Einlieferungen ist ein Valuta-Datum bis zu t+40 möglich. Im Gegensatz zu den Auslieferungen handelt es sich hierbei um Kalendertage und nicht um Geschäftstage.

Der Geschäftspartner kann den kundenspezifischen Lieferleitweg auswählen, indem er den Button zu Beginn der gewünschten Zeile in der Tabelle „Lieferleitweg“ aktiviert.

Diese Tabelle wird erst mit Auswahl der Lagerstelle eingeblendet.

Sofern für die ausgewählte Lagerstelle kein Lieferleitweg hinterlegt sein sollte, ist die Erfassung des Auftrags nicht möglich. In diesem Fall ist Kontakt mit der zuständigen Stelle im Hause der Deutschen Bundesbank (Sicherheitenmanagement Z 51, Tel.: +49 (0)69 2388 2477) aufzunehmen.

Beispiel: Auftragserfassung Auslieferung Domestic



Die Erfassung von Auslieferungen ist mit Valuta-Datum bis zu t+3 möglich.

Der Geschäftspartner muss den kundenspezifischen Lieferleitweg auswählen, indem er den Radio Button zu Beginn der gewünschten Zeile in der Tabelle „Lieferleitweg“ aktiviert.

Für die Aktualität dieser Lieferleitwege ist der Geschäftspartner verantwortlich. Änderungen können dem Sicherheitenmanagement während der Geschäftszeiten per Mail an [Sicherheitenmanagement@bundesbank.de](mailto:Sicherheitenmanagement@bundesbank.de) mitgeteilt werden.

Diese Tabelle wird erst mit Auswahl der Lagerstelle eingeblendet.

Sofern für die ausgewählte Lagerstelle kein Lieferleitweg hinterlegt sein sollte, ist die Erfassung des Auftrags nicht möglich. In diesem Fall ist Kontakt mit der zuständigen Stelle im Hause der Deutschen Bundesbank (Sicherheitenmanagement Z 51, Tel.: +49 (0)69 2388 2477) aufzunehmen.

Beispiel: Erfassung Storno-Auftrag

Erfassung des Auftrags nach dem Vier-Augen-Prinzip

**CAP** DEUTSCHE BUNDESANLEIHEN

**Ein-/Auslieferungen** Aktuelles Datum/Zeit: 28.09.2023, 11:40:23

Sicherheitenkontonummer: 0000000000  
Sicherheitenpool 1 - Geldpolitische Operationen

**Auftragsübersicht**

Dispositionsdepot: 2100041001 Erstellung auf Erstellungsdatum: 2023-06-30 - 2023-09-28  Offene Aufträge  Abgeschlossene Aufträge Anzeigen

Referenz	Status	Dispositionsdepot	Auftragsart	Valuta	Handelsdatum	ISIN Bezeichnung	Sk./Nenn
17118824	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic 07.08.2023	07.08.2023	07.08.2023	DE0001053528 BAYERN LSA 20/30 S133	2.000.000
17114031	freigegeben GP	2100041001	Auslieferung CCBM 04.08.2023	04.08.2023	04.08.2023	NL0010721999 NEBERID 14-47	1.000.000
17094508	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 31.07.2023	31.07.2023	31.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	100.000
17048340	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 18.07.2023	18.07.2023	18.07.2023	DE0001053577 BAYERN LSA 20/25 S138	1.000.000
17025122	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	6
17025121	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	11.07.2023	11.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	64.346
17025120	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	11.07.2023	11.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	785
17025118	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	1.232
17025117	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	1
17021091	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic 07.07.2023	07.07.2023	07.07.2023	DE0001030575 BUNDANL.V.15/46 INFLUID	1

**Aktualisieren** Excel CSV Einträge pro Seite: 10 1 - 10 von 10 [< >]

**Einlieferung Domestic** **Auslieferung Domestic** **Einlieferung CCBM** **Auslieferung CCBM**

Um die über CAP freigegebenen Aufträge von Ein-/Auslieferungen marktfähiger Sicherheiten zu stornieren, muss der Geschäftspartner den entsprechenden Auftrag aus der Auftragsübersicht per Klick auf die Referenznummer auswählen.

**CAP** DEUTSCHE BUNDESANLEIHEN

**Ein-/Auslieferungen** Aktuelles Datum/Zeit: 04.08.2023, 13:52:39

Sicherheitenkontonummer: 0000000000  
Sicherheitenpool 1 - Geldpolitische Operationen

**Auftragsfreigabe Ein-/Auslieferung**

Referenz: 17021091

Erfasst von / am: EXNCOMP0 / 07.07.2023 Freigegeben von / am: EXNSWXB / 07.07.2023

Auftragsdatum: 07.07.2023 Auftragszeit: 13:34

Dispositionsdepot: 2100041001

Valuta: 07.07.2023 Handelsdatum: 07.07.2023

Die Lieferung erfolgt über die Lagerstelle der Deutschen Bundesbank:  
CBF (7069)

**Lieferleitweg**

Cleangsystem (P2ET)	Cleanglagerstelle (DEAG)	Kontrahentlagerstelle (DECC)	Kontrahent (ZELL)
DAWVDEFFXXX(T2S)	BAKW/7010	---	Bankhaus f. Euro-Geldmarkt AG (Bank)

Referenz	ISIN	Bezeichnung	Nennwert	Status
17021091	DE0001030575	BUNDANL.V.15/46 INFLUID	1	freigegeben GP

**Abbrechen** Stornierung erfassen

Nach der Auswahl der Referenznummer verzweigt CAP daraufhin in die Detailansicht des Auftrags, in der sich nun der Button zur Storno-Erfassung befindet.

**Ein/Auslieferungen** Aktuelles Datum/Zeit: 04.08.2023, 13:54:19

Sicherheitenkontonummer: 9100000000  
Sicherheitenpool 1 - Geldpolitische Operationen

**Ihr Stornierungsauftrag wurde erfolgreich am 04.08.2023 13:54:16 erfasst.**

**Storno erfassen**

Storno erfasst von / am  
EXNSWVXB / 04.08.2023

Referenz  
17021091

Erfasst von / am  
EXNSWVXB / 07.07.2023

**Auftragsdatum** **Auftragszeit**  
07.07.2023 13:34

Disposition depot  
2100041001

**Valuta** **Handelsdatum**  
07.07.2023 07.07.2023

Die Lieferung erfolgt über die Lagerstelle der Deutschen Bundesbank:  
CBF (7069)

**Lieferweg**

Clearingsystem (PSET)	Clearinglagerstelle (DEAG)	Kontostellenlagerstelle (DECU)	Kontostellort (DELL)
DAKXDEFFXXX(T2S)	DAKX/7010	---	Deutsche Bundesbank, 7069

Referenz	ISIN	Bezeichnung	Nennwert	Status
17021091	DE0001030575	BUNDANL.V.15/46 INFL.LKD	1	freigegeben GP

[zur Auftragsübersicht](#)

Nach der erfolgreichen Erfassung des Stornos, kann der Geschäftspartner diesen Auftrag durch einen zweiten User freigeben oder, falls der Storno Auftrag nicht mehr gewünscht wird auch wieder löschen.

Sollten bei einer Stornierung in CAP Probleme auftreten, ist das Sicherheitenmanagement zu kontaktieren (Tel.: +49 (0)69 2388 2477, E-Mail: Sicherheitenmanagement@bundesbank.de).



## Erfassung des Auftrages nach dem Zwei-Augen-Prinzip:

The screenshot shows the CAP interface with a list of orders. The table below represents the data visible in the 'Auftragsübersicht' section.

Referenz	Status	Dispositionsdepot	Auftragsart	Valuta	Handelsdatum	ISIN	Bezeichnung	Nom./Mkt.
17118824	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic	07.08.2023	07.08.2023	DE0001095528	BAVERNL54 20/30 S133	2.000.000
17114031	freigegeben GP	2100041001	Auslieferung CCBM	04.08.2023	04.08.2023	NL0010721999	NEERLD 14-47	1.000.000
17094508	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	31.07.2023	31.07.2023	DE0001090740	BUNDES0BLV.22/27	100.000
17048340	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	18.07.2023	18.07.2023	DE0001095577	BAVERNL54 20/25 S138	1.000.000
17025122	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	10.07.2023	DE0001090740	BUNDES0BLV.22/27	6
17025121	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	11.07.2023	DE0001090740	BUNDES0BLV.22/27	64.346
17025120	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	11.07.2023	DE0001090740	BUNDES0BLV.22/27	785
17025118	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	10.07.2023	DE0001090740	BUNDES0BLV.22/27	1.232
17025117	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	10.07.2023	DE0001090740	BUNDES0BLV.22/27	1
17021091	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic	07.07.2023	07.07.2023	DE0001090575	BUNDANLV.15/46 INFLIKD	1

Um die über CAP freigegebenen Aufträge von Ein-/Auslieferungen marktfähiger Sicherheiten zu stornieren, muss der Geschäftspartner den entsprechenden Auftrag aus der Auftragsübersicht per Klick auf die Referenznummer auswählen.

The screenshot shows the detailed view of the order with reference number 17021091. The table below represents the data visible in the 'Auftragsfreigabe Ein-/Auslieferung' section.

Referenz	ISIN	Bezeichnung	Nominalwert	Status
17021091	DE0001090575	BUNDANLV.15/46 INFLIKD	1	freigegeben GP

At the bottom right of the screen, there is a button labeled 'Stornierung erfassen und freigeben'.

Nach der Auswahl der Referenznummer verzweigt CAP in die Detailansicht des Auftrags in der sich der Button zur Storno-Erfassung und die Freigabe befindet.

Diese Stornierung löst allerdings keine Aktion im Sicherheitenmanagement-System aus, sondern es wird lediglich eine E-Mail mit der Bitte um Löschung an die Bundesbank gesandt.

Abhängig vom aktuellen Bearbeitungsstand des Auftrages im Sicherheitenmanagent-System kann nun von einem berechtigten Bundesbank-Mitarbeiter der Auftrag storniert werden.

Hinsichtlich der Berechtigungen erfolgen Erfassung und Freigabe des Storno-Auftrags analog der zugrunde liegenden Ursprungsgeschäftsart in CAP. Sie sind also grundsätzlich sowohl im Zwei- als auch im Vier-Augen-Prinzip möglich. Die Storno-Berechtigung ist in den Rollen zur Ein-/Auslieferung von Wertpapieren enthalten.

#### **4.2.2 Grenzüberschreitende Nutzung marktfähiger Sicherheiten**

In anderen Mitgliedsstaaten des Eurosystems verwahrte notenbankfähige Wertpapiere können im Rahmen des CCBM-Verfahrens grenzüberschreitend genutzt werden.

In der Regel können die Geschäftspartner ihre Instruktionen zwischen 9.00 Uhr und 16.00 Uhr MEZ einreichen. Nutzer des CCBM-Verfahrens, die nach 16.00 Uhr MEZ Sicherheiten grenzüberschreitend verwenden möchten, sollten diese daher vor diesem Zeitpunkt bei der Korrespondenzzentralbank hinterlegen. In Ausnahmefällen – z. B. aus geldpolitischen Gründen oder um den reibungslosen Abschluss von TARGET zu gewährleisten – kann der Annahmeschluss für das CCBM-Verfahren verlängert werden. Generell bitten wir die Abwicklungszeiten für Instruktionen in den lokalen Wertpapierabwicklungssystemen (CSD) des Eurosystems zu beachten.

Weitere Informationen zum CCBM sind dem Kapitel 6.6 der „Allgemeinen Regelungen für die geldpolitischen Instrumente und Verfahren des Eurosystems“ sowie der EZB-Sonderveröffentlichung „Das Korrespondenz-Zentralbankmodell: Verfahren für Geschäftspartner des Eurosystems“ zu entnehmen; beide Veröffentlichungen stehen auf der Website der EZB bzw. der Deutschen Bundesbank zum Download zur Verfügung.

#### 4.2.2.1 Grenzüberschreitende Nutzung marktfähiger Sicherheiten via SWIFT

Die nachfolgend beschriebenen SWIFT-Spezifikationen stellen lediglich Rahmenbedingungen dar. Da die Anforderungen an die Nachrichten je nach Korrespondenzzentralbank differieren und derzeit einem ständigen Wandel unterliegen, ist eine detaillierte Darstellung in diesem Dokument nicht angebracht. Wir stellen Ihnen aber bei Bedarf gerne ad hoc die entsprechenden Informationen zur Verfügung. Wenden Sie sich bitte bei Bedarf an unser Sicherheitenmanagement (Tel. 069-2388 2477 oder E-mail: Sicherheitenmanagement@Bundesbank.de).

##### 4.2.2.1.1 Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 540 im CCBM-Verfahren

Der Geschäftspartner sendet die SWIFT-Instruktionen zur Einlieferung von Sicherheiten im CCBM-Verfahren an die Deutsche Bundesbank (Receiver BIC: MARKDEFFCCB).

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

##### Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"// transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	23G	NEWM/CANC		Function of the Message	4!c[/4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent instruction

##### Optional Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
M	20C	RELA/PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; for a new message RELA/NEW

					PREV// transaction reference number of the message to be cancelled
M	16S			End of Block	LINK

End of Mandatory Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADEDET
M	98a	SETT	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "SETT"//YYYYMMDD for the delivery date
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"//YYYYMMDD for the trade date. This field must be prior to or equal to the settlement date.
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
M	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO"//ISO currency code of the asset
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADEDET
---	-----	--	--	--------------	----------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
---	-----	--	--	----------------	------

M	36B	SETT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument to be settled	:4!c//4!c/15d; "SETT"//type/ Quantity of financial instrument to be settled  The type is expressed in "UNIT" if quantity is expressed as a number, "FAMT" if quantity is expressed as a face amount
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//account with BBk Account number of the "Dispositionsdepot"
M	94a	SAFE	Place of safekeeping	Option B	:4!c/[8c]/4!c[/30x]; "SAFE"//SHHE"/BIC code of the Correspondent Central Bank. For further information please refer to the list of BIC Codes "Correspondent Central Banks".  This field specifies the Correspondent Central Bank which will receive the securities in favour of Deutsche Bundesbank.
M	16S			End of Block	FIAC

#### Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator	Option A	:4!c//4!c; "SETR"//REPU" or "COLI" or "TRAD"

#### Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	SELL	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c];

					"SELL"//BIC code of the instructing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	DEAG	Party	Option P or R	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "DEAG"//BIC code of the delivery agent Option R: 4!c/8c/34x; "DEAG"// Issuer code/Proprietary code.
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
O	95a	DECU	Party	Option P or R	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "DECU"//BIC code of the deliverer's custodian Option R: 4!c/8c/34x; "DECU"// Issuer code/Proprietary code
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"//BIC code of the place of settlement For further information please refer to the list of BIC codes "Place of Settlement".
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory      O=Optional

#### **4.2.2.1.2 Storno Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 540 im CCBM-Verfahren**

Die Storno-Nachricht zu Einlieferung einer marktfähigen Sicherheit im CCBM-Verfahren entspricht der in Kapitel 4.2.2.1.1 dargestellten Nachricht zur Einlieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.



#### 4.2.2.1.3 Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 544 im CCBM-Verfahren

Die Deutsche Bundesbank (Sender BIC: MARKDEFFCCB) versendet die Bestätigungsnachricht an den Geschäftspartner.

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

##### Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"// transaction reference number of the operation. This field must be unique for each instruction sent.
M	23G	NEWM/ CANC		Function of the Message	4!c[/4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent confirmation MT544

##### Mandatory Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
M	20C	RELA/ PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; "RELA"// transaction reference number of the MT540 message or "PREV"// transaction reference number of the previously sent confirmation MT544
M	16S			End of Block	LINK

##### End of Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADDET
M	98a	ESET	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "ESET"/YYYYMMDD for the date at which the transaction effectively settled
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"/YYYYMMDD for the trade date
O	90a	DEAL	Price	Option A	:4!c//4!c/15d "PRCT"/haircut
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
M	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO"/ISO currency code of the asset
O	98a	COUP	Coupon date	Option A	:4!c//8!n "COUP"/YYYYMMDD Date of next interest payment
O	98a	MATU	Maturity Date	Option A	:4!c//8!n "MATU"/YYYYMMDD Date of maturity
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADDET
---	-----	--	--	--------------	---------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
---	-----	--	--	----------------	------

M	36B	ESTT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument Settled	:4!c//4!c/15d; "ESTT"//type/ Quantity of financial instrument effectively settled The type is expressed in "UNIT" if quantity is expressed as a number, "FAMT" if quantity is expressed as a face amount
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//account with BBk Account number of the "Dispositionsdepot"
M	16S			End of Block	FIAC

#### Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator	Option A	:4!c//4!c; "SETR"// "REPU" for all trades

#### Repetitive Mandatory Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	SELL	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "SELL"//BIC code of the instructing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	DEAG	Party	Option P or R	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "DEAG"//BIC code of the delivery agent

					Option R: 4!c/8c/34x; "DEAG"// Issuer code/Proprietary code.
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
O	95a	DECU	Party	Option P or R	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "DECU"//BIC code of the deliv- erer's custodian Option R: 4!c/8c/34x; "DECU"// Issuer code/Proprie- tary code
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"//BIC code of the place of settlement For further information please refer to the list of BIC codes "Place of Settlement".
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory                      O=Optional

#### **4.2.2.1.4 Storno Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 544 im CCBM-Verfahren**

Die Storno-Nachricht zur Bestätigung einer Einlieferung marktfähiger Sicherheiten im CCBM-Verfahren entspricht der in Kapitel 4.2.2.1.3 dargestellten Nachricht zur Bestätigung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

#### 4.2.2.1.5 Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 542 im CCBM-Verfahren

Der Geschäftspartner sendet die SWIFT-Instruktionen zur Auslieferung von Sicherheiten im CCBM-Verfahren an die Deutsche Bundesbank (Receiver BIC: MARKDEFFCCB).

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

##### Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"//transaction reference number of the operation
M	23G	NEWM/CANC		Function of the Message	4!c/[4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent instruction

##### Optional Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
O	20C	RELA/PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; "NEW" for a new message "PREV"// transaction reference number of the message to be cancelled
M	16S			End of Block	LINK

##### End of Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

##### Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADDET
M	98a	SETT	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "SETT"//YYYYMMDD for the delivery date
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"//YYYYMMDD for the trade date

M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code
---	-----	--	--	--	--

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
M	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4!c//3!a; "DENO"//ISO currency code of the asset
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADDET
---	-----	--	--	--------------	---------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
M	36B	SETT	Quantity of Financial Instrument	Quantity of Financial Instrument to be settled	:4!c//4!c/15d; "SETT"//type/ Quantity of financial instrument to be settled The type is expressed in "UNIT" if quantity is expressed as a number, "FAMT" if quantity is expressed as a face amount
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//account with BBk (Dispositionsdepotnummer)
M	94a	SAFE	Place of safekeeping	Option B	:4!c/[8c]/4!c/30x]; "SAFE"//SHHE"/BIC code of the Correspondent Central Bank. For further information please refer to the list of BIC codes "Correspondent Central Banks". This field specifies the Correspondent Central Bank which

					will receive the securities in favour of Deutsche Bundesbank.
M	16S			End of Block	FIAC

#### Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator	Option A	4!c//4!c; "SETR"//"REPU" or "COLO" or "TRAD"

#### Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	BUYR	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "BUYR"//BIC code of the instructing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	REAG	Party	Option P or R	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "REAG"//BIC code of the receiving agent Option R: 4!c/8c/34x; "REAG"// Issuer code/Proprietary code.
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
O	95a	RECU	Party	Option P or R	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "RECU"//BIC code of the receiver's custodian Option R: 4!c/8c/34x; "RECU"// Issuer code/Proprietary code
M	16S			End of Block	SETPRTY



M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"//BIC code of the place of settlement. For further information please refer to the list of BIC codes "Place of Settlement".
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory

O=Optional

#### **4.2.2.1.6 Storno Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 542 im CCBM-Verfahren**

Die Storno-Nachricht für die Auslieferung marktfähiger Sicherheiten im CCBM-Verfahren entspricht der in Kapitel 4.2.2.1.5 dargestellten Nachricht zur Auslieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

#### 4.2.2.1.7 Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 im CCBM-Verfahren

Die Deutsche Bundesbank (Sender BIC: MARKDEFFCCB) versendet die Bestätigungsnachricht an den Geschäftspartner.

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

##### Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x; "SEME"//transaction reference number of the operation
M	23G	NEWM/ CANC		Function of the Message	4!c[4!c]; "NEWM" for a new message or "CANC" to request the cancellation of a previously sent confirmation MT546

##### Mandatory Repetitive Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of Block	LINK
M	20C	RELA/ PREV	Reference	Related Reference	:4!c//16x; "RELA"//Transaction reference number of the MT542 message or "PREV"// transaction reference number of the previously sent confirmation MT546
M	16S			End of Block	LINK

##### End of Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

Mandatory Sequence B - Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADEDET
M	98a	ESET	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "ESET"//YYYYMMDD for the date at which the trans- action effectively settled
M	98a	TRAD	Date/Time	Option A	:4!c//8!n; "TRAD"//YYYYMMDD for the trade date
M	35B			Identification of the Financial In- strument	[!SIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code

Optional Subsequence B1 - Financial Instruments Attributes

M	16R			Start of Block	FIA
M	11A	DENO	Currency	Currency of de- nomination	:4!c//3!a; "DENO"//ISO currency code of the asset
M	16S			End of Block	FIA

End of Sequence B - Trade Details

M	16S			End of Block	TRADEDET
---	-----	--	--	--------------	----------

Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

M	16R			Start of Block	FIAC
M	36B	ESTT	Quantity of Financial In- strument	Quantity of Fi- nancial Instru- ment Settled	:4!c//4!c/15d; "ESTT"//type/ Quantity of fi- nancial instrument effec- tively settled The type is expressed in "UNIT" if quantity is ex- pressed as a number, "FAMT" if quantity is ex- pressed as a face amount
M	97a	SAFE	Account	Option A	:4!c//10!n; "SAFE"//account with BBk

					Account number "Dispositiondepot"
M	16S			End of Block	FIAC

Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET
M	22F	SETR	Indicator	Option A	4!c//4!c; "SETR"//"REPU" for all trades

Mandatory Repetitive Subsequence E1 – Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	BUYR	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "BUYR"//BIC code of the instructing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	REAG	Party	Option P or R	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "REAG"//BIC code of the receiving agent Option R: 4!c/8c/34x; "REAG"// Issuer code/Proprietary code.
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
O	95a	RECU	Party	Option P or R	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "RECU"//BIC code of the receiver's custodian Option R: 4!c/8c/34x; "RECU"// Issuer code/Proprietary code
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
---	-----	--	--	----------------	---------

M	95a	PSET	Party	Option P	Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; "PSET"//BIC code of the place of settlement. For fur- ther information please refer to the list of BIC codes "Place of Settlement".
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET
---	-----	--	--	--------------	--------

M=Mandatory

O=Optional

#### **4.2.2.1.8 Storno Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 im CCBM-Verfahren**

Die Storno-Nachricht für die Bestätigung der Auslieferung marktfähiger Sicherheiten im CCBM-Verfahren entspricht der in Kapitel 4.2.2.1.7 dargestellten Nachricht zur Bestätigung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

#### 4.2.2.2 Grenzüberschreitende Nutzung marktfähiger Sicherheiten via Extranet XML

##### 4.2.2.2.1 Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML im CCBM-Verfahren

<b>Element/Attribut</b>					
<b>SctiesSttlmTxInstr</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-InstructionV02Subset					
xs:sequence	<b>Txid</b>				
	type RestrictedFINXMax16Text				
	Length 1-16				
	Pattern value="([0-9a-zA-Z- ?:\(\)\ , ' + ]([0-9a-zA-Z- ?:\(\)\ , ' + ]*([0-9a-zA-Z- ?:\(\)\ , ' + ])?)*)"				
	<b>SttlmTpAndAddtlParams</b>				
	type SettlementTypeAndAdditionalParameters4				
	xs:sequence	<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			
		Anwendbare Codes:			
		RECE			



		<b>Pmt</b>			
		type DeliveryReceipt- Type2Code			
		<i>Anwendbare Codes</i>			
		<i>Free</i>			
	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDetails15				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDa- teTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
		<b>SttlmDt</b>			
		type Settlement- Date4Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDa- teTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentification15				

	xs:sequence	<b>ISIN</b>			
		type ISINIdentifier			
		pattern value="[A-Z0-9]{12,12}"			
	<b>QtyAndAcctDtIs</b>				
	type QtyAndAcctDtIs				
	xs:sequence	<b>SttlmQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrument-Quantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimal-Number	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type Restricted-FINXMax35Text		

			<i>pattern value="[0-9a-zA-Z/\- ?:\( ),,1+ ]{1,35}"</i>		
			<i>Length 1 .. 35</i>		
		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlace- Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
			type SafekeepingPlace- TypeAndAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>ID</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>Pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<b>SttlmParams</b>				
	type SettlementDetails35				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransactionType4Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
			type SecuritiesTransaction- Type1Code		
			<i>Anwendbare Codes</i>		

			COLI REPU TRAD		
	<b>DlvrgSttlmPties</b>				
	type SettlementParties18				
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>			
		type PartyIdentification52			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification58Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification62Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
			<b>SfkpgAcct</b>		
			type SecuritiesAccount17		
			xs:sequence	<b>Id</b>	

				type RestrictedFINXMax35Text	
				<b>Tp</b>	
				type GenericIdentification25	
				xs:sequence	<b>Id</b>
				xs:choice	typeExact4AlphaNu- mericText
					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNu- mericText
			<b>Pty2</b>		
			type PartyIdentificatio- nAndAccount63		
			<i>interacts with party 1(same structure)</i>		
			<b>Pty3</b>		
			type PartyIdentificatio- nAndAccount63		
			<i>interacts with party 1(same structure)</i>		

#### 4.2.2.2.2 Storno Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML im CCBM-Verfahren

<b>Element/Attribut</b>			
<b>SctiesMsgCxlAdv</b>			
type= "SecuritiesMessageCancellationAdviceV02Subset"			
xs:sequence	<b>Ref</b>		
	type= "References20Choice"		
	xs:sequence	<b>SctiesSttlmTxInstr</b>	
		type SecuritiesSettlementTransactionInstructionV02Subset	
		xs:sequence	<b>TxId</b>
			type Restricted-FINXMax16Text
			Length 1-16
			pattern value="([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ])*(/[0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ])?\(\)\.,\'+ ])?)*"
			<b>SctiesMvmntTp</b>
			type ReceiveDelivery1Code
			Anwendbare Codes:
			RECE

			<b>Pmt</b>
			type DeliveryReceipt- Type2Code
			Anwendbare Codes
			Free
	<b>AcctOwnr</b>		
	type= "PartyIdentifica- tion51Choice		
	xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
		type AnyBICIdentifier	
		pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0- 9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"	
	<b>SfkpgAcct</b>		
	type SecuritiesAc- count17		
	xs:sequence	<b>Id</b>	
		type RestrictedFINXMax35Text	
		pattern value="[0-9a-zA-Z/\- \?:(\)\.,\'+ {1,35}"	
		Length 1 .. 35	

#### 4.2.2.2.3 Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML im CCBM-Verfahren

<u>Element / Attribute</u>					
<b>SctiesSttlmTxConf</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-ConfirmationV02Subset					
xs:sequence	<b>TxldDtIs</b>				
	type SettlementTypeAndIdentification11				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxld</b>			
		type Restricted-FINXMax16Text			
		length 1 .. 16			
		pattern "[([0-9a-zA-Z- ?:\ )\.,'+ ]([0-9a-zA-Z- ?:\ )\.,'+ ]*([0-9a-zA-Z- ?:\ )\.,'+ ])?)*"			
		<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			
		AnwendbareCodes:			
		RECE			
		<b>Pmt</b>			
		type DeliveryReceiptType2Code			
		Anwendbare Codes:			



		<i>FREE</i>			
	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDe- tails16				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
		<b>FctvSttlmDt</b>			
		type Settlement- Date5Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentifica- tion15				
	xs:sequence	<b>ISIN</b>			
		type ISINIdentifier			

		<i>pattern "[A-Z0-9]{12,12}"</i>			
	<b>QtyAndAcctDtls</b>				
	type QuantityAndAccount20				
	xs:sequence	<b>SttldQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrumentQuantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimalNumber	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type RestrictedFINXMax35Text		
			<i>pattern value="[0-9a-zA-Z/\?:\ )\ , '+ ]{1,35}"</i>		

			<i>Length 1 .. 35</i>		
		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlace- Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
		xs:choice	type SafekeepingPlaceTypeAn- dAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1 Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>Id</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<b>SttlmParams</b>				
	type SettlementDetails33				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransactionType6Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
		xs:choice	type SecuritiesTransaction- Type1Code		
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>COLI REPU TRAD</i>	

	<b>DlvgSttlmPties</b>				
	type SettlementParties18				
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>			
		type PartyIdentification52			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification58Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification62Choice		
			xs:sequence	<b>Prtryld</b>	
			xs:choice	type GenericIdentification24	<b>Id</b>
				xs:sequence	type Restricted-FINXMax34Text
					<i>pattern value= "([0-9a-zA-Z1-?:\ ! , ' + ]([0-9a-zA-Z1-?:\ ! , ' + ])*([0-9a-zA-Z1-?:\ ! , ' + ])?)"</i>

					<i>Length 1 .. 34</i>
					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNu- mericText
		<b>Pty2</b>			
		type PartyIdentificatio- nAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			
		<b>Pty3</b>			
		type PartyIdentificatio- nAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			

#### 4.2.2.2.4 Storno Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten XML im CCBM-Verfahren

<u>Element/Attribut</u>					
<b>SctiesTxCxlReqStsAdv</b>					
type=SecuritiesTransactionCancellation-RequestStatusAdviceV03					
xs:sequence	<b>CxlReqRef</b>				
	type=Identification1				
	xs:sequence	<b>Id</b>			
		type=Max35Text			
	<b>Txid</b>				
	type=TransactionIdentifications17				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxId</b>			
		type=References22Choice			
		xs:choice	<b>SctiesStlmTxId</b>		
			type=SettlementTypeAndIdentification13		
			xs:sequence	<b>Txid</b>	
				type=Max35Text	
				<i>Length 1-35</i>	
				<b>SctiesMvmntTp</b>	
				type ReceiveDelivery1Code	
				<i>Anwendbare Codes:</i>	
				<i>RECE</i>	
				<b>Pmt</b>	
				type DeliveryReceiptType2Code	

				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>FREE APMT</i>	
	<b>PrcgSts</b>				
	type=ProcessingSta- tus20Choice				
	xs:choice	<b>Canc</b>			
		type=CancellationSta- tus9Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=CancellationReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=Cancellation- Reason3Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>
					type=CancelledSta- tusReason5Code
					Anwendbare Codes:
					CANI OTHR
		<b>Dnd</b>			
		type=DeniedSta- tus6Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=DeniedReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=DeniedReason2Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>
					type=Denied- Reason4Code

					Anwendbare Codes:
					ADEA DCAN DPRG DREP
					DSET LATE OTHR CDRG
					CDCY CDRE



#### 4.2.2.2.5 Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML im CCBM-Verfahren

<u>Element/Attribut</u>					
<b>SctiesSttlmTxInstr</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-InstructionV02Subset					
xs:sequence	<b>TxId</b>				
	type RestrictedFINXMax16Text				
	Length 1-16				
	Pattern value="([0-9a-zA-Zl- ?:\ )\ , '1+ ]([0-9a-zA-Zl- ?:\ )\ , '1+ ]*([0-9a-zA-Zl- ?:\ )\ , '1+ ])?)"				
	<b>SttlmTpAndAddtlParameters</b>				
	type SettlementTypeAndAdditionalParameters4				
	xs:sequence	<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			
		Anwendbare Codes:			
		DELI			
		<b>Pmt</b>			
		type DeliveryReceiptType2Code			
		Anwendbare Codes			
		Free			

	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDetails15				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDate TimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
		<b>SttlmDt</b>			
		type Settlement- Date4Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDate TimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				<i>Format yyyy-mm-dd</i>	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentification15				
	xs:sequence	<b>ISIN</b>			
		type ISINIdentifier			
		pattern value="[A-Z0-9]{12,12}"			
	<b>QtyAndAcctDtIs</b>				

	type QtyAndAcctDtls				
	xs:sequence	<b>SttlmQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrument-Quantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimal-Number	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type Restricted-FINXMax35Text		
			<i>pattern value="[0-9a-zA-Z/\- \?:\ \],\ + ]{1,35}"</i>		
			<i>Length 1 .. 35</i>		
		<b>SfkpgPlc</b>			

		type SafekeepingPlace- Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
			type SafekeepingPlace- TypeAndAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>ID</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>Pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<b>SttlmParams</b>				
	type SettlementDetails35				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransactionType4Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
			type SecuritiesTransaction- Type1Code		
			<i>Anwendbare Codes</i>		
			<i>COLO REPU TRAD</i>		
	<b>RcvgSttlmPties</b>				
	type SettlementParties18				
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>			

		type PartyIdentification52			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification58Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification62Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
			<b>SfkpgAcct</b>		
			type SecuritiesAccount17		
			xs:sequence	<b>Id</b>	
				type RestrictedFINXMax35Text	
				<b>Tp</b>	
				type GenericIdentification25	
			xs:sequence		<b>Id</b>

				xs:choice	typeExact4AlphaNumericText
					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNumericText
		<b>Pty2</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			
		<b>Pty3</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			

#### 4.2.2.2.6 Storno Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML im CCBM-Verfahren

<b>Element/Attribut</b>			
<b>SctiesMsgCxlAdv</b>			
type= "SecuritiesMessageCancellationAdviceV02Subset"			
xs:sequence	<b>Ref</b>		
	type= "References20Choice"		
	xs:sequence	<b>SctiesSttlmTxInstr</b>	
		type SecuritiesSettlementTransactionInstructionV02Subset	
		xs:sequence	<b>TxId</b>
			type Restricted-FINXMax16Text
			Length 1-16
			pattern value="([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ]*([0-9a-zA-Z\-\?\:\(\)\.,\'+ ])?\(\)\.,\'+ ])?\(\)\.,\'+ ])*")"
			<b>SctiesMvmntTp</b>
			type ReceiveDelivery1Code
			Anwendbare Codes:
			DELI

			<b>Pmt</b>
			type DeliveryReceipt- Type2Code
			Anwendbare Codes
			Free
	<b>AcctOwnr</b>		
	type= "PartyIdentifica- tion51Choice		
	xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
		type AnyBICIdentifier	
		pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0- 9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"	
	<b>SfkpgAcct</b>		
	type SecuritiesAc- count17		
	xs:sequence	<b>Id</b>	
		type RestrictedFINXMax35Text	
		pattern value="[0-9a-zA-Z/\-?:(\)\.,\'+ {1,35}"	
		Length 1 .. 35	



#### 4.2.2.2.7 Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML im CCBM-Verfahren

<u>Element / Attribute</u>					
<b>SctiesSttlmTxConf</b>					
type SecuritiesSettlementTransaction-ConfirmationV02Subset					
xs:sequence	<b>TxldDtIs</b>				
	type SettlementTypeAndIdentification11				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxld</b>			
		type Restricted-FINXMax16Text			
		length 1 .. 16			
		pattern "[([0-9a-zA-Z- ?:\ )\ , '+ ]([0-9a-zA-Z- ?:\ )\ , '+ ]*([0-9a-zA-Z- ?:\ )\ , '+ ])?)*"			
		<b>SctiesMvmntTp</b>			
		type ReceiveDelivery1Code			
		AnwendbareCodes:			
		DELI			
		<b>Pmt</b>			
		type DeliveryReceiptType2Code			
		Anwendbare Codes:			

		FREE			
	<b>TradDtIs</b>				
	type SecuritiesTradeDe- tails16				
	xs:sequence	<b>TradDt</b>			
		type TradeDate2Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				Format yyyy-mm-dd	
		<b>FctvSttlmDt</b>			
		type Settlement- Date5Choice			
		xs:sequence	<b>Dt</b>		
		xs:choice	type DateAndDateTimeChoice		
			xs:sequence	<b>Dt</b>	
			xs:choice	type ISODate	
				Format yyyy-mm-dd	
	<b>FinInstrmId</b>				
	type SecurityIdentifica- tion15				
	xs:sequence	<b>ISIN</b>			
		type ISINIdentifier			

		<i>pattern "[A-Z0-9]{12,12}"</i>			
	<b>QtyAndAcctDtls</b>				
	type QuantityAndAccount20				
	xs:sequence	<b>SttIdQty</b>			
		type Quantity10Choice			
		xs:sequence	<b>Qty</b>		
		xs:choice	type FinancialInstrumentQuantity15Choice		
			xs:sequence	<b>FaceAmt</b>	
			xs:choice	type RestrictedFINImpliedCurrencyAndAmount	
				<i>fractionDigits value="5"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
				<i>minInclusive value="0"</i>	
				<b>Unit</b>	
				Type RestrictedFINDecimalNumber	
				<i>fractionDigits value="14"</i>	
				<i>totalDigits value="14"</i>	
		<b>SfkpgAcct</b>			
		type SecuritiesAccount17			
		xs:sequence	<b>Id</b>		
			type RestrictedFINXMax35Text		
			<i>pattern value="[0-9a-zA-Z/\- ?:\ )\L, '1+ ]{1,35}"</i>		

			<i>Length 1 .. 35</i>		
		<b>SfkpgPlc</b>			
		type SafekeepingPlace- Format4Choice			
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>		
		xs:choice	type SafekeepingPlaceTypeAn- dAnyBICIdentifier1		
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>	
				type SafekeepingPlace1 Code	
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>	
				<b>Id</b>	
				type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
	<b>SttlmParams</b>				
	type SettlementDetails33				
	xs:sequence	<b>SctiesTxTp</b>			
		type SecuritiesTransactionType6Choice			
		xs:sequence	<b>Cd</b>		
		xs:choice	type SecuritiesTransaction- Type1Code		
				<i>Anwendbare Codes</i>	
				<i>COLO REPU TRAD</i>	

	<b>RcvgSttlmPties</b>				
	type SettlementParties18				
	xs:sequence	<b>Dpstry</b>			
		type PartyIdentification52			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification58Choice		
			xs:sequence	<b>AnyBIC</b>	
			xs:choice	type AnyBICIdentifier	
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>	
		<b>Pty1</b>			
		type PartyIdentificationAndAccount63			
		xs:sequence	<b>ID</b>		
			type PartyIdentification62Choice		
			xs:sequence	<b>Prtryld</b>	
			xs:choice	type GenericIdentification24	<b>Id</b>
				xs:sequence	type RestrictedFINXMax34Text
					<i>pattern value= "([0-9a-zA-Z1-?:\ ! , ' + ]([0-9a-zA-Z1-?:\ ! , ' + ])*([0-9a-zA-Z1-?:\ ! , ' + ])?)"</i>

					<i>Length 1 .. 34</i>
					<b>Issr</b>
					type Max4AlphaNu- mericText
		<b>Pty2</b>			
		type PartyIdentificatio- nAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			
		<b>Pty3</b>			
		type PartyIdentificatio- nAndAccount63			
		<i>interacts with party 1(same structure)</i>			

#### 4.2.2.2.8 Storno Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten XML im CCBM-Verfahren

<u>Element/Attribut</u>					
<b>SctiesTxCxlReqStsAdv</b>					
type=SecuritiesTransactionCancellationRequestStatusAdviceV03					
xs:sequence	<b>CxlReqRef</b>				
	type=Identification1				
	xs:sequence	<b>Id</b>			
		type=Max35Text			
	<b>TxId</b>				
	type=TransactionIdentifications17				
	xs:sequence	<b>AcctOwnrTxId</b>			
		type=References22Choice			
		xs:choice	<b>SctiesStlmTxId</b>		
			type=SettlementTypeAndIdentification13		
			xs:sequence	<b>TxId</b>	
				type=Max35Text	
				<i>Length 1-35</i>	
				<b>SctiesMvmntTp</b>	
	-			type ReceiveDelivery1Code	
				<i>Anwendbare Codes:</i>	
				<i>DELI</i>	
				<b>Pmt</b>	
				type DeliveryReceiptType2Code	
	-			<i>Anwendbare Codes</i>	

				FREE APMT	
	<b>PrcgSts</b>				
	type=ProcessingStatus20Choice				
	xs:choice	<b>Canc</b>			
		type=CancellationStatus9Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=CancellationReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=CancellationReason3Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>
					type=CancelledStatusReason5Code
					Anwendbare Codes:
					CANI OTHR
		<b>Dnd</b>			
		type=DeniedStatus6Choice			
		xs:choice	<b>Rsn</b>		
			type=DeniedReason2		
			xs:sequence	<b>Cd</b>	
				type=DeniedReason2Choice	
				xs:choice	<b>Cd</b>
					type=DeniedReason4Code



					Anwendbare Codes:
					ADEA DCAN DPRG DREP
					DSET LATE OTHR CDRG
					CDCY CDRE

### 4.2.2.3 Grenzüberschreitende Nutzung marktfähiger Sicherheiten via ExtraNet CAP

Beispiel: Auswahlmaske Aufträge Ein-/Auslieferungen

The screenshot displays the CAP system interface for 'Ein-/Auslieferungen'. The main table lists orders with the following columns: Referenz, Status, Dispositionstyp, Auftragstyp, Valuta, Handelsdatum, ISIN, and SB./Richt. The order with reference 17114031 is highlighted with a red box, showing a status of 'freigegeben GP' and an order type of 'Auslieferung CCBM'. At the bottom of the interface, there are four buttons: 'Einlieferung Domestic', 'Auslieferung Domestic', 'Einlieferung CCBM', and 'Auslieferung CCBM'. The last two buttons are highlighted with a red box, indicating the selection options for cross-border collateral usage.

Referenz	Status	Dispositionstyp	Auftragstyp	Valuta	Handelsdatum	ISIN	SB./Richt.
17118924	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic 07.08.2023	07.08.2023	07.08.2023	DE0001053528 BAYERN LSA 20/30 S133	2.000.000
17114031	freigegeben GP	2100041001	Auslieferung CCBM 04.08.2023	04.08.2023	04.08.2023	NL0010719999 NIEDERL 14-47	1.000.000
17094508	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 31.07.2023	31.07.2023	31.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL.V.22/27	100.000
17048340	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 18.07.2023	18.07.2023	18.07.2023	DE0001053577 BAYERN LSA 20/25 S138	1.000.000
17025122	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL.V.22/27	6
17025121	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	11.07.2023	11.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL.V.22/27	64.346
17025120	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	11.07.2023	11.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL.V.22/27	785
17025118	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL.V.22/27	1.232
17025117	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL.V.22/27	1
17021591	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic 07.07.2023	07.07.2023	07.07.2023	DE0001030575 BUNDANL.V.15/46 INFLUID	1

Auswahlmöglichkeit der Ein- und Auslieferungsaufträge:

- Einlieferung CCBM
- Auslieferung CCBM

## Beispiel: Erfassungsmaske Einlieferung CCBM-Verfahren:

The screenshot displays the CAP interface for recording a CCBM delivery. The main form includes the following fields:

- Sicherheitenkontonummer:** 2300041001
- Valuta:** 2023-08-04
- Handelsdatum:** 2023-08-04
- Ausländische Korrespondenz Zentralbank:** DE NEDERLANDSCHE BAK

The 'Lieferweg' (Delivery Route) table is as follows:

Clearingsystem (PSET)	Clearingstelle (SEAG)	Kontobestandsstelle (DE0)	Kontotyp (RELL)
<input checked="" type="radio"/> ECMI/ML20CCB	MLTCCBER00XX	---	Handelsplatz (RELL)

The 'Sicherheiten' (Collateral) table is as follows:

ISIN	Bezeichnung	Sk./Nom	
NLD010721999	NEDELD 14-47	1.000.000,00	<input type="checkbox"/>
ISIN		Sk./Nom	<input checked="" type="checkbox"/>

Die Eingabe des Valuta- und Handelsdatums ist manuell oder durch Auswahl per Kalenderbutton möglich (Standardmäßig wird der aktuelle Tag eingeblendet). Für die Erfassung von Einlieferungen ist ein Valuta-Datum bis zu t+40 möglich. Im Gegensatz zu den Auslieferungen handelt es sich hierbei um Kalendertage und nicht um Geschäftstage.

Die ausländische Korrespondenzzentralbank ist anhand eines Drop Down Menüs auszuwählen (Standardmäßig erfolgt keine Vorblendung).

Der Geschäftspartner muss den kundenspezifischen Lieferleitweg auswählen, indem er den Radio Button zu Beginn der gewünschten Zeile in der Tabelle „Lieferleitweg“ aktiviert. Für die Aktualität dieser Lieferleitwege ist der Geschäftspartner verantwortlich. Änderungen können dem Sicherheitenmanagement während der Geschäftszeiten per Mail an [Sicherheitenmanagement@bundesbank.de](mailto:Sicherheitenmanagement@bundesbank.de) mitgeteilt werden.

Die Tabelle „Lieferleitwege“ wird erst mit Auswahl der Ausländischen Korrespondenz-Zentralbank eingeblendet. Sofern für die ausgewählte Ausländische Korrespondenz-Zentralbank kein Lieferleitweg hinterlegt sein sollte, ist die Erfassung des Auftrags nicht möglich. In diesem Fall ist Kontakt mit der zuständigen Stelle im Hause der Deutschen Bundesbank (Sicherheitenmanagement Z 51, Tel.: +49 (0)69 2388 2477) aufzunehmen.

## Beispiel: Erfassungsmaske Auslieferung CCBM-Verfahren:

The screenshot shows the ICAP system interface for recording a CCBM delivery order. The interface is in German and includes a sidebar with navigation options like 'AUSWERTUNGEN', 'AUFTRÄGE', and 'SICHERHEITENPOOL'. The main content area is titled 'Ein-/Auslieferungen' and contains the following fields and sections:

- Dispositorkonto:** 2100041001
- Wert:** 2023-09-04
- Verfallsdatum:** 2023-09-04
- Ausländische Korrespondenz Zentralbank:** DE NEDERLANDSCHE BNK
- Lieferleitweg:** A table with columns for clearing systems (PSGT, DEAG, DE00, DE01) and a radio button for 'ECCMNL20CCB' which is selected.
- Sicherheiten:** A table with columns for ISIN, Bezeichnung, and St./Nom.

ISIN	Bezeichnung	St./Nom
NLD010721999	NEDERLD 14-47	1.000.000,00

Buttons at the bottom include 'Abbrechen' and 'Erfassen und freigeben'.

Die Erfassung von Auslieferungen ist mit Valuta-Datum bis zu t+3 möglich.

Der Geschäftspartner kann den kundenspezifischen Lieferleitweg auswählen, indem er den Radio Button zu Beginn der gewünschten Zeile in der Tabelle „Lieferleitweg“ aktiviert.

Die Tabelle „Lieferleitwege“ wird erst mit Auswahl der Ausländischen Korrespondenz-Zentralbank eingeblendet. Sofern für die ausgewählte Ausländische Korrespondenz-Zentralbank kein Lieferleitweg hinterlegt sein sollte, ist die Erfassung des Auftrags nicht möglich. In diesem Fall ist Kontakt mit der zuständigen Stelle im Hause der Deutschen Bundesbank (Sicherheitenmanagement Z 51, Tel.: +49 (0)69 2388 2477) aufzunehmen.

## Beispiel: Erfassung Storno-Auftrag

### Erfassung des Auftrags nach dem Vier-Augen-Prinzip

The screenshot shows the CAP interface with a list of orders. The order with reference number 17114031 is highlighted in blue. The table below shows the details of the orders:

Referenz	Status	Dispositionsdepot	Auftragsart	Valuta	Handelsdatum	ISIN	SB_Nom.
1711824	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic	07.08.2023	07.08.2023	DE0001053528	2.000.000
17114031	freigegeben GP	2100041001	Auslieferung CCBM	04.08.2023	04.08.2023	NL0010721999 NEDERLD 14-47	1.000.000
17094508	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	31.07.2023	31.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	100.000
17048340	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	18.07.2023	18.07.2023	DE0001035777 BAWERN.LSA.20.25.S138	1.000.000
17025122	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	6
17025121	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	11.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	64.346
17025120	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	11.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	785
17025118	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	1.232
17025117	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDES0BL.V.22/27	1
17021091	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic	07.07.2023	07.07.2023	DE0001030575 BUNDANL.V.15/46.INFLUID	1

Um die über CAP freigegebenen Aufträge von Ein-/Auslieferungen marktfähiger Sicherheiten zu stornieren, muss der Geschäftspartner den entsprechenden Auftrag aus der Auftragsübersicht per Klick auf die Referenznummer auswählen.

The screenshot shows the CAP interface with the details of the order with reference number 17114031. The 'Stornieren erfassen' button is highlighted in blue. The details are as follows:

Referenz: 17114031  
 Erfasst von / am: EXINTFZEG / 04.08.2023  
 Freigegeben von / am: EXINTFZEG / 04.08.2023  
 Auftragsdatum: 04.08.2023  
 Auftragszeit: 14:07  
 Dispositionsdepot: 2100041001  
 Valuta: 04.08.2023  
 Handelsdatum: 04.08.2023  
 Ausländische Korrespondenz Zentralbank: DIE NEDERLANDSCHE BNK  
 Lieferleitung: Clearingstelle (REAG), Kustodeninhaltsstelle (RECU), Karlsruher (BUNR), EOMNAL20CCB, MOTOSEBDOXX, ---, Tickercode: NL0010721999

Referenz	ISIN	Bezeichnung	Nennwert	Status
17114031	NL0010721999	NEDERLD 14-47	1.000.000	freigegeben GP

Nach der Auswahl der Referenznummer verzweigt CAP daraufhin in die Detailsicht des Auftrags, in der sich nun der Button zur Storno-Erfassung befindet.

The screenshot displays the I-CAP interface for the Bundesbank. The main content area shows a confirmation message: "Ihr Stornierungsauftrag wurde erfolgreich am 04.08.2023 14:13:03 erfasst." Below this, the "Storno erfassen" section is highlighted, showing the recording details: "Storno erfasst von / am EXNCGMPO / 04.08.2023".

Additional details include:

- Referenz: 17114031
- Erfasst von / am: EXNCFZEG / 04.08.2023
- Auftragsdatum: 04.08.2023
- Auftragszeit: 14:07
- Dispositionsdepot: 2100041001
- Valuta: 04.08.2023
- Handelsdatum: 04.08.2023
- Ausländische Korrespondenz Zentralbank: DE NEDERLANDSCHE ENK
- Lieferbeleg:

Clearingsystem (PSET)	Clearingagente (BEAG)	Kontrahentenrolle (RECI)	Kontrahent (BUYR)
EDMSNL200CB	MSTCBEBXXX	--	"Niederlande" (Niederlande)

Referenz	ISN	Bezeichnung	Nennwert	Status
17114031	NL0010721999	NEDERLD 14-47	1.000.000	freigegeben GP

Buttons for "Storno erfassen" and "zur Auftragsübersicht" are visible at the bottom of the main content area.

Nach der erfolgreichen Erfassung des Stornos, kann der Geschäftspartner diesen nun durch einen zweiten User freigeben oder, falls der Storno Auftrag nicht mehr gewünscht wird auch wieder löschen.

Sollten bei einer Stornierung in CAP Probleme auftreten, ist das Sicherheitenmanagement zu kontaktieren (Tel.: +49 (0)69 2388 2477, Mail: [Sicherheitenmanagement@bundesbank.de](mailto:Sicherheitenmanagement@bundesbank.de)).

Erfassung des Storno-Auftrages nach dem Zwei-Augen-Prinzip

**Ein-/Auslieferungen** Aktuelles Datum/Zeit: 28.09.2023, 11:40:23

Sicherheitenkontonummer:   
 Sicherheitspool 1 - Geldpolitische Operationen

**Auftragsübersicht**

Dispositionszeitraum: 2100041001 Erstellung auf Erstellungsdatum: 2023-06-30 - 2023-09-28  Offene Aufträge  Abgeschlossene Aufträge Anzeigen

Referenz	Status	Dispositionszeitraum	Auftragsart	Valuta	Handelsdatum	ISIN Bezeichnung	Stk./Nenn.
17118824	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic 07.08.2023	07.08.2023	07.08.2023	DE0001053528 BAYERN LSA 20/30 S133	2.000.000
17114031	freigegeben GP	2100041001	Auslieferung CCBM 04.08.2023	04.08.2023	04.08.2023	NL0010721999 NEDERL 14-47	1.000.000
17094508	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 31.07.2023	31.07.2023	31.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL V.22/27	100.000
17048340	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 18.07.2023	18.07.2023	18.07.2023	DE0001053577 BAYERN LSA 20/25 S138	1.000.000
17025122	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL V.22/27	6
17025121	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	11.07.2023	11.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL V.22/27	64.346
17025120	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	11.07.2023	11.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL V.22/27	785
17025118	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL V.22/27	1.232
17025117	erfasst GP	2100041001	Einlieferung Domestic 10.07.2023	10.07.2023	10.07.2023	DE0001030740 BUNDESÖBL V.22/27	1
17021091	freigegeben GP	2100041001	Einlieferung Domestic 07.07.2023	07.07.2023	07.07.2023	DE0001030575 BUNDLANL V.15/46 INFLUID	1

Einträge pro Seite: 10 1 - 10 von 10 [< >]

Einlieferung Domestic Auslieferung Domestic Einlieferung CCBM Auslieferung CCBM

Um die über CAP freigegebenen Aufträge von Ein-/Auslieferungen marktfähiger Sicherheiten zu stornieren, muss der Geschäftspartner den entsprechenden Auftrag aus der Auftragsübersicht per Klick auf die Referenznummer auswählen.

**Ein-/Auslieferungen** Aktuelles Datum/Zeit: 04.08.2023, 14:07:53

Sicherheitenkontonummer:   
 Sicherheitspool 1 - Geldpolitische Operationen

**Auftragsfreie Ein-/Auslieferung**

Referenz: 17114031

Erfasst von / am: EXNFTZEO / 04.08.2023 Freigegeben von / am: EXNFTZEO / 04.08.2023

Auftragsdatum: 04.08.2023 Auftragszeit: 14:07

Dispositionszeitraum: 2100041001

Valuta: 04.08.2023 Handelsdatum: 04.08.2023

Ausländische Korrespondenz Zentralbank:  
 DE NEDERLANDSCHE BNK

Lieferleitung

Gleitsystem (PIET)	Gleitsystemstelle (BEAG)	Kontostellenbelegstelle (BEOL)	Kontostellen (BUVR)
ECMSNL200CB	MTCBEB00XX	---	***

Referenz	ISIN	Bezeichnung	Nennwert	Status
17114031	NL0010721999	NEDERL 14-47	1.000.000	freigegeben GP

Abbrechen Stornierung erfassen und freigeben

Nach der Auswahl der Referenznummer verzweigt CAP in die Detailansicht des Auftrags in der sich der Button zur Stornierung-Erfassung und die Freigabe befindet.

Diese Stornierung löst allerdings keine Aktion im Sicherheitenmanagement-System aus, sondern es wird lediglich eine E-Mail mit der Bitte um Löschung an die Bundesbank gesandt. Abhängig vom aktuellen Bearbeitungsstand des Auftrages im Sicherheitenmanagent-System kann nun von einem berechtigten Bundesbank-Mitarbeiter der Auftrag storniert werden.

Hinsichtlich der Berechtigungen erfolgen Erfassung und Freigabe des Storno-Auftrags analog der zugrundeliegenden Ursprungsgeschäftsart in CAP. Sie sind also grundsätzlich sowohl im Zwei- als auch im Vier-Augen-Prinzip möglich. Die Storno-Berechtigung ist in den Rollen zur Ein-/Auslieferung von Wertpapieren enthalten.



### **4.2.3 Nutzung von Triparty Collateral Management Systemen**

Neben der Stellung von marktfähigen Sicherheiten in Dispositionsdepots unterstützt die Deutsche Bundesbank auch die Stellung von marktfähigen Sicherheiten mittels Triparty Collateral Management Services (TPCMS). Diese führen im Auftrag und nach Vorgabe der Deutschen Bundesbank die Zulässigkeitsprüfung und Bewertung der dort verwahrten Sicherheiten aus. Darüber hinaus bietet der Triparty Agent (TPA), der im Auftrag des Sicherheitengebers (geldpolitischer Geschäftspartner) und des Sicherheitennehmers (Bundesbank) handelt, weitere Dienstleistungen wie Allokation und Substitution von Sicherheiten an.

Innerhalb des Eurosystems wird die grenzüberschreitende Nutzung von Triparty Collateral Management Services angeboten. So können in einem ausländischen Collateral Management System generierte Globalbeträge für Zwecke der Refinanzierung zu Gunsten der Bundesbank verpfändet werden. Die im Folgenden beschriebenen drei Modelle sind vom EZB-Rat diesbezüglich festgelegt worden:

- Modell 1: z.Zt. Xemac (Clearstream Banking Frankfurt)
- Modell 2: z.Zt. CmaX (Clearstream Banking Luxemburg)
- Modell 3: z.Zt. Autoselect (Euroclear Group: Euroclear France/Euroclear Bank)

Neben der bereits seit langem etablierten heimischen Nutzung von Xemac (Clearstream Banking Frankfurt) können geldpolitische Geschäftspartner der Deutschen Bundesbank über das CCBM-Verfahren den von Clearstream Banking Luxemburg betriebenen Triparty Service „CmaX“ oder den von Euroclear France/Euroclear Bank angebotenen Service „Autoselect“ nutzen. Grundsätzlich werden Kapitalmaßnahmen in allen drei Modellen durch den Triparty-Agenten übernommen bzw. die betroffenen Papiere werden automatisch im Vorfeld substituiert. Instruktionen für die Nutzung von Triparty Collateral Management Systemen können während der regulären Betriebszeit des Sicherheitenmanagement-Systems der Deutschen Bundesbank – unter Berücksichtigung der Öffnungszeiten des Triparty Agenten sowie der CCBM-Zeiten – erteilt werden. Instruktionen für Modell 1 sind ausschließlich an den TPA, Instruktionen für die Modelle 2 und 3 an den TPA und die Deutsche Bundesbank zu senden.

Die je nach Modell variierenden Prozesse und die zugehörige Nutzung der SWIFT-Nachrichten für eine grenzüberschreitende Nutzung können Sie den folgenden Abschnitten entnehmen. Ungeachtet der aufgeführten Status Mandatory (M), Optional (O) und Conditional (C) sind bei der Instruktion gegenüber der Deutschen Bundesbank alle in den aufgeführten Nachrichten angegebenen Felder verpflichtend zu befüllen.

#### **4.2.3.1 Modell 1: Xemac**

Für Geschäftspartner der Deutschen Bundesbank besteht die Möglichkeit, Xemac-Globalbeträge für die Sicherheitenstellung zu Gunsten der Bundesbank zu nutzen. Dazu können bei CBF und CBL hinterlegte notenbankfähige Wertpapiere verwendet und in Form eines Globalbetrages zugunsten der Bundesbank verpfändet werden. Sollte eine Instruktion zur Erhöhung des Globalbetrags mangels Sicherheiten in Xemac nicht vollständig ausgeführt werden können, so kommt es mit Teilallokation zum Abschluss des Prozesses. Soll der Globalbetrag auf den ursprünglich angefragten Betrag erhöht werden, muss der Geschäftspartner, sobald wieder ausreichend Sicherheiten vorhanden sind, eine neue Instruktion senden. Allokationen in Xemac finden kontinuierlich zwischen 7:00 Uhr und 17:40 Uhr statt. Im Falle einer solchen heimischen Nutzung findet keine Kommunikation zwischen dem Geschäftspartner und der Bundesbank statt, der Geschäftspartner instruiert ausschließlich Xemac.

Im Falle von Globalbetragsminderungen durch Kapitalmaßnahmen, für die es keine Möglichkeit der Substitution oder Re-Allokation im CMS des TPA gibt, sendet Xemac am Geschäftstag vor dem Zahltag (T-1) zwischen 18:00 Uhr und 19:00 Uhr eine Instruktion zur zwangsweisen Globalbetragsherabsetzung infolge einer Kapitalmaßnahme an die Bundesbank. Gleichzeitig wird der Gegenwert der Kapitalmaßnahme einbehalten.

Nun sind zwei Fälle zu unterscheiden:

##### **Fall A: Der verbleibende Sicherheitenpool ist ausreichend, den ausstehenden Kredit zu besichern**

In diesem Fall reduziert die Bundesbank die entsprechende Sicherheitenposition im Sicherheitenkonto des Geschäftspartners, passt ggf. die auf dem primären MCA-Konto in TARGET-BBk geführte Kreditlinie an und sendet eine Instruktion zur Freigabe des Gegenwerts der Kapitalmaßnahme an Xemac. Die Zahlung wird wie gewohnt direkt von CBF zugunsten des Sicherheitengebers abgewickelt.

**Fall B: Der verbleibende Sicherheitenpool ist (zunächst) *nicht* ausreichend den ausstehenden Kredit zu besichern**

Die Bundesbank initiiert einen Margin Call und sendet eine Instruktion zur Einbehaltung des Gegenwertes der Kapitalmaßnahme an Xemac. Falls der Sicherheitenpool bis 9:30 Uhr des Auszahlungstages (T) wieder ausreicht, sendet die Bundesbank eine Instruktion zur Freigabe des Gegenwertes der Kapitalmaßnahme an Xemac. Je nach Zeitpunkt der Freigabe kann es demnach zu einer verzögerten Zahlungsabwicklung durch CBF kommen.

Falls der Sicherheitenpool bis 9:30 Uhr des Auszahlungstages (T) nicht ausreicht, transferiert CBF den aus der Kapitalmaßnahme resultierenden Betrag auf das T2-Konto der Bundesbank. Weitere Schritte erfolgen nach bilateraler Absprache mit dem Geschäftspartner.

Neben den Kapitalmaßnahmen kann auch die abendliche Neubewertung zu Anpassungen des Globalbetrags führen. So kann eine Zwangsherabsetzung des Globalbetrags infolge einer Neubewertung (mit Preisdaten oder aufgrund fehlender Notenbankfähigkeit einer Sicherheit (EADB)) bei fehlender Möglichkeit der Substitution / Reallokation in Xemac erfolgen und ggf. zu einem Margin Call führen. Die Ergebnisse der Neubewertung werden, sofern sie eine Änderung des Globalbetrags zur Folge haben, bereits zu Beginn des neuen TARGET-Geschäftstages berücksichtigt.

#### **4.2.3.2 Modell 2: CmaX**

##### **4.2.3.2.1 Eigenschaften Modell 2**

Mit der Banque Centrale du Luxembourg (BCL) als Korrespondenzzentralbank können Globalbeträge über das Triparty Collateral Management System „CmaX“ der CBL zugunsten der Bundesbank zur Besicherung geldpolitischer Geschäfte verpfändet werden. Wesentliche Merkmale des Modells 2 sind, dass zum einen eine tatsächliche Übertragung der Wertpapiere auf ein gesondertes Depot des Geschäftspartners zugunsten der Notenbank erfolgt und zum anderen der Geschäftspartner für Globalbetragsänderungen/-reduzierungen parallel den TPA und die HCB (hier: Bundesbank) zu instruieren hat. Zudem sind Teilallokationen möglich, d.h. Anfragen zur Änderung eines Globalbetrags müssen nicht vollständig ausgeführt werden. Damit bleibt eine Instruktion zur Erhöhung des Globalbetrags so lange schwebend, bis der ursprünglich angefragte Betrag erreicht werden kann oder der Geschäftspartner eine neue Instruktion sendet. CmaX bietet einen kontinuierlichen Service zwischen 21:00 Uhr (D-1) und 20:00 Uhr (D). Die erste Allokation findet in Echtzeit statt, anschließend findet die Batchverarbeitung (3 Zyklen pro Stunde) Anwendung. Der Annahmeschluss seitens der Bundesbank für Globalbetragsänderungen für CmaX ist 17:15 Uhr. Ergebnisse der Neubewertung (Preisdaten und Zulässigkeitsprüfung) werden im Sicherheitenkonto ab 7:00 Uhr des nächsten Geschäftstages berücksichtigt.

#### 4.2.3.2.2 Änderung Globalbetrag CmaX

MT 527 des Geschäftspartners an die Deutsche Bundesbank (HCB) BIC Code MARKDEF-FCCB

#### Wichtige Hinweise zur Befüllung des MT 527:

- Alle angegebenen Felder sind ungeachtet des Status bei der Instruktion gegenüber der Bundesbank zu befüllen.
- Für die Feldbelegungen bei Tag :20C: sind nur fortlaufende, alphanumerische Zeichenfolgen mit Großbuchstaben und ohne Leer- und Sonderzeichen erlaubt.

Se- quence	M/O	Tag	Field name	Content/Options	Quali- fier	Definition / Description of use for Model 2
<b>A</b>	<b>Mandatory Sequence - General In- formation</b>					
	M	:16R:	Start of Block	GENL		
	M	:28E:	Page Num- ber/Continu- ation Indica- tor	5n/4!c	-	As the trade details can fit on one MT527, :28E:00001/ONLY shall apply
	M	:20C:	Sender's Message Reference	:4!c//16x	SEME	This field must contain a unique reference for this SWIFT message
	M	:20C:	Sender's Collateral Reference	:4!c//16x	SCTR	This field must contain the counterparty's reference for this exposure. This reference must remain the same for all MT527 mes- sages that relate to the same exposure.
	M	:20C:	Client's Col- lateral Ref- erence	:4!c//16x	CLCI	This field must contain the counterparty's instruction reference. This reference identi- fies the instruction type and must be fol- lowed by a <i>unique sequence number</i> for the specified SCTR.
	M	:23G:	Function of the Mes- sage	4!c//4!c]	-	The following function must always be ap- plied for model 2: NEWM - New instruction -
	M	:98a:	Execution Requested date	A::4!c//8!n	EXRQ	This field must contain the value date an must not be earlier than the current busi- ness date
	M	:22H:	Instruction Type Indica- tor	:4!c//4!c	CINT	This field must be used to identify the type of instruction and must contain one of the following code words: - INIT Creation of a Triparty Collateral Man- agement exposure (for opening) - PADJ Principal Adjustment(TCMS)
	M	:22H:	Exposure Type Indica- tor	:4!c//4!c	COLA	This field must be used to identify the type of Triparty Collateral Management product and must contain the following code word: - SLOA Triparty Collateral Management Service (TCMS)
	M	:22H:	Client Indi- cator	:4!c//4!c	REPR	This field must be used to indicate whether the customer is the Collateral Giver or the Collateral Receiver of the exposure and must contain the following code word as fixed value in the instruction received by the CCB: - RECE Collateral Receiver

			M	:22F:	Automatic Allocation Indicator	:4!c/[8c]/4!c	AUTA	This field is used to indicate the Auto Assign facility is in use for the transaction - AUTO Collateral allocation is made automatically (for use by Collateral Givers that have subscribed to the AutoAssign facility)
	<b>A1</b>	Mandatory Repeatable Subsequence - Collateral Parties						
			M	:16R:	Start of Block	COLLPRTY		
			M	:95a:	Party A	P::4!c//4!a2!a2!c[3!c]	PTYA	This field must contain the BIC code of the collateral Giver
			M	:16S:	End of Block	COLLPRTY		
			M	:16R:	Start of Block	COLLPRTY		
				:95a:	Party B	P::4!c//4!a2!a2!c[3!c]	PTYB	This field must contain the BIC code of the CCB In case, CMax is used: BCLXLULLXXX
			M	:16S:	End of Block	COLLPRTY		
			M	:16R:	Start of Block	COLLPRTY		
				:95a:	Triparty Agent	R::4!c/8c/34x	TRAG	Triparty Agent: Subfield 2 must contain the Data Source Scheme "CEDE". Subfield 3 must contain the Triparty collateral account number of the CP at the TPA
			M	:16S:	End of Block	COLLPRTY		
		<b>End of Subsequence A1 - Collateral Parties</b>						
			M	:16S:	End of Block	GENL		
		<b>End of Sequence A - General Information</b>						
	<b>B</b>	<b>Mandatory Sequence - Deal Transaction Details</b>						
			M	:16R:	Start of Block	DEALTRAN		
			M	:98a:	Closing Date	Option A or B	TERM	For an open-ended exposure, option B must be used with the code word "OPEN".
			M	:19A:	Transaction Amount	:4!c//[N]3!a15d	TRAA	This field must contain the ISO currency code followed by the exposure amount (principal amount). The sign subfield (N) must be left blank. The exposure amount must be set to '0' in the event of TCMS exposure with no principal amount for principal adjustment
			M	:16S:	End of Block	DEALTRAN		
		<b>End of Sequence B - Deal Transaction Details</b>						

### **4.2.3.3 Modell 3: Autoselect**

#### **4.2.3.3.1 Eigenschaften Modell 3**

Mit der Banque de France bzw. der Banque Nationale de Belgique als Korrespondenzzentralbank können Globalbeträge über das Triparty Collateral Management System „Autoselect“ der Euroclear France bzw. der Euroclear Bank zugunsten der Bundesbank zur Besicherung geldpolitischer Geschäfte verpfändet werden. Auch bei diesem Modell findet eine tatsächliche Übertragung der Wertpapiere und eine parallele Instruktion des TPA und der HCB durch den Geschäftspartner statt. Die Übertragung der Wertpapiere erfolgt auf ein gesondertes Depot der Notenbank. Zudem sind Teilallokationen möglich, d.h. Anfragen zur Änderung eines Globalbetrags müssen nicht vollständig ausgeführt werden. Damit behält eine Instruktion zur Erhöhung des Globalbetrags so lange Gültigkeit, bis der ursprünglich angefragte Betrag erreicht werden kann. Eine bereits teilallokierte, noch gültige Instruktion kann nur durch einen neuen Auftrag ggf. in Höhe des bereits allokierten Globalbetrags beendet werden. Eine Beendigung des Auftrages durch eine Stornierung kann nur dann erfolgen, wenn Autoselect die Instruktion noch nicht für die Verarbeitung angenommen hat (bevor der TPA den MT 558 IPRC/TREA versendet hat). Der Status der Stornierung wird dem Geschäftspartner mitgeteilt. Der von Autoselect bestätigte Globalbetrag kann neben Wertpapieren auch eine Cash-Komponente enthalten. Diese wird bei Einbuchung des Betrages in das Sicherheitenkonto des Geschäftspartners seitens der Bundesbank nicht berücksichtigt.

Euroclear Bank verarbeitet 2 Batches während der Nachtverarbeitung, dann 14 Allokationszyklen zwischen 4:30 Uhr und 17:45 Uhr. Der Annahmeschluss seitens der Bundesbank für Globalbetragsänderungen für Autoselect Euroclear Bank ist 17:15 Uhr. Euroclear France bietet 13 Allokationszyklen zwischen 4:30 Uhr und 16:30 Uhr. Die Neubewertung wird im Sicherheitenkonto ab 7:00 Uhr des nächsten Geschäftstages berücksichtigt.

#### **4.2.3.3.2 Initiierung/Änderung Globalbetrag/Stornierung Autoselect**

MT 527 des Geschäftspartners an die Deutsche Bundesbank (HCB) BIC Code  
MARKDEFFCCB

##### Wichtige Hinweise zur Befüllung des MT 527:

- Erstmalige Initiierung Feld 22H::CINT//INIT
- Globalbetragsänderung Feld 22H::CINT//PADJ
- Reduzierung auf Null und gleichzeitige Schließung der Transaktion Feld 22H::CINT//TERM
- Stornierung einer zuvor nur an die Bundesbank versandten Instruktion Feld 23G::CANC. Das Feld 20C::TRCI wird in diesem Fall zum Pflichtfeld. Die Stornierung ist nur möglich, wenn der Status „unmatched“ ist (:25D::MTCH/NMAT) oder der Auftrag für ein gültiges Valutadatum in der Zukunft erteilt wurde.
- Für die Feldbelegungen bei Tag :20C: sind nur fortlaufende, alphanumerische Zeichenfolgen mit Großbuchstaben und ohne Leer- und Sonderzeichen erlaubt.
- Alle angegebenen Felder sind unter Beachtung der Spalte „Field Usage“ bei der Instruktion gegenüber der Bundesbank zu befüllen.



Tag	Status	Field Name	Format	Qualifier	Code word / Field Usage
<b>Sequence A - General information</b>					
:16R:	M	Start of block	16c	GENL	Start of a sequence
:28E:	M	Page Number/Continuation Indicator	5n/4!c		Page number with an indicator : - LAST for the last page - MORE for an intermediary page - ONLY if only one page
:20C:	M	Sender's Message reference	:SEME//16x	SEME	Reference of the message for the sender of the message.
:20C:	M	Client's collateral instruction reference	:CLCI//16x	CLCI	Reference of the instruction for the sender of the message.
:20C:	C	Triparty's collateral instruction reference	:TRCI//16x	TRCI	Reference of the instruction for the triparty agent. Not allowed if :23G:NEWM ; M if :23G:CANC. Bundesbank will provide the value upon request.
:20C:	O	Sender's collateral transaction reference	:SCTR//16x	SCTR	Reference of the transaction for the sender of the message.
:20C:	C	Receiver's collateral transaction reference	:RCTR//16x	RCTR	Reference of the transaction for the triparty agent. M if :23G:NEWM and :22a::CINT//INIT (always NONREF); O if :23:CANC and :22a::CINT//INIT) if :20C::SCTR is present; M in all other cases
:23G:	M	Function of the message	4!c		Function of the message: NEWM for a message sent to create a new instruction or CANC for a message to cancel an existing instruction (in that case the data in the message must be the same as in the instruction to cancel).
:98a:	M	Execution requested date/time	option A	EXRQ	Execution date/time of the instruction. Must be the current date at max 10 days in the future.
:22a:	M	Collateral instruction type indicator	option H	CINT	Type of instruction: INIT to initiate a transaction, PADJ to adapt the requested amount of the transaction and TERM to close a transaction.
:22a:	M	Exposure type indicator	option H	COLA	Type of transaction, always repurchase operations (must be REPO).
:22H:	M	Collateral receive/provide indicator	:REPR//4!c	REPR	Role of the sender. Must always be RECE.
:13B:	M	Eligibility set profile number	:ELIG/[8c]/30x	ELIG	This is the eligibility set that must be used to select the collateral as defined in the triparty agreement: ECLR/DE-BASIC
<b>Sub-sequence A1 - Collateral parties</b>					
:16R:	M	Start of block	16c	COLLPRTY	Start of a sequence
:95R:	M	Party A	:PTYA/[8c]/5!n	PTYA	Data Source Scheme ECLR and Euroclear account of the CCB.
:16S:	M	End of block	16c	COLLPRTY	End of a sequence
<b>End of Sub-sequence A1 - Collateral parties</b>					
<b>Sub-sequence A1 - Collateral parties</b>					
:16R:	M	Start of block	16c	COLLPRTY	Start of a sequence
:95R:	M	Party B	:PTYB/[8c]/5!n	PTYB	Data Source Scheme ECLR and Euroclear account of the counterparty
:16S:	M	End of block	16c	COLLPRTY	End of a sequence
<b>End of Sub-sequence A1 - Collateral parties</b>					
:16S:	M	End of block		GENL	End of a sequence
<b>End of Sequence A - General information</b>					

<b>Sequence B - Deal transaction details</b>					
:16R:	M	Start of block	16c	DEALTRAN	Start of a sequence
:98a:	M	Closing date/time	option A or B	TERM	This is the repurchase date/time of the triparty transaction. It must be OPEN to indicate it is an open-ended transaction; to be used with option B. In case of a closing transaction instruction the closing date has to be indicated with using option A.
:19A:	M	Transaction amount/Aggregate risk value	:TRAA/[N]3!a 15d	TRAA	This is the requested amount for the transaction. Please note: If 22a::CINT/TERM: this field includes the following amount. The last intended amount before this transaction.
:19A:	C	Termination Transaction Amount	:TRTE/[N]3!a 15d	TRTE	IF 22a::CINT/ TERM: this field is mandatory and must indicate the following amount: The last intended amount before this transaction
:92a:	M	Pricing rate/Lending fee rate	option A	PRIC	This is the interest rate of the transaction. Seeing that we will not take an interest, it must be 0 (e.g, PRIC//0,).
:22F:	M	Method of interest computation indicator	:MICO/[8c]4! c	MICO	This is the computation method of the interest, we do not use it but it must be filled by A004.
:16S:	M	End of block	16c	DEALTRAN	End of a sequence
<b>End of Sequence B - Deal transaction details</b>					

#### 4.2.4 Statusnachrichten

Diese SWIFT-Nachrichten/XML-Äquivalente stehen ausschließlich im A2A-Modus zu Verfügung und dienen der Information im Falle von Settlement-Problemen, die bei Ein- oder Auslieferungen von marktfähigen Sicherheiten auftreten können. Bei generellem Bedarf können Statusnachrichten bei der Deutschen Bundesbank angefordert werden.

##### 4.2.4.1 Statusnachricht MT 548

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
Mandatory Sequence A General Information					
M	16R			Start of block	GENL
M	20C	SEME		Sender message reference	:4!c//16x SEME//transaction reference number of the operation.
M	23G	INST		Function of the message	4!c[/4!c]; "INST" for instruction status
Mandatory Repetitive Subsequence A1 Linkages					
M	16R				LINK
M	20C	RELA	Reference		:4!c//16x RELA//Reference of the linked message which was previously sent. Reference of the MT54x NEWM.
M	16S				LINK
Mandatory Repetitive Subsequence A2 Status					
M	16R				STAT
M	25D	4!c	Status	Option D	:4!c/[8c]/4!c Only following status qualifier are used = IPRC (Instruction processing status) CPRC (Cancellation processing status) TPRC (Processing change command status)


					SPRC (Request for statement/Processing advice status) INMH (Inferred matching status) MTCH (Matching status) SETT (Settlement status) (e.g. MTCH//NMAT)
Optional Repetitive Subsequence A2a Reason					
M	16R				REAS
M	24B	4!c	Reason		:4!c/[8c]/4!c Above mentioned Status codes with the correspondent reason code please see SWIFT user handbook (e.g. NMAT//CMIS)
O	70D	REAS	Narrative	Reason narrative	:4!c//6*35x REAS//additional unstructured information
M	16S				REAS
M	16S				STAT
M	16S				GENL

#### **4.2.4.2 Statusnachricht XML**

Platzhalter

#### 4.2.5 Bestätigung von Zins- und Fälligkeitszahlungen

Geschäftspartnern wird je nach Weisung die Bestätigung von Zins- und Fälligkeitszahlungen per Brief oder als PDF im ExtraNet-Postfach zur Verfügung gestellt.



**DEUTSCHE  
BUNDESBANK  
EUROSYSTEM**

Z 5 Wertpapierabwicklung und Sicherheitenmanagement  
Postfach 11 12 32 - 60047 Frankfurt

NAME1 2000558A1  
NAME2 2000558A1  
ABTEIL  
KONTPERS  
STR.1  
STR.2  
1111 ORT  
[REDACTED]

Frankfurt, 21.02.2013

Telefon: +49 (0) 69 2388-2439 oder 2473  
Telefon: +49 (0) 211 874-1423 oder 1424  
Telefax: +49 (0) 69 9566-509985  
E-Mail: [z5.wertpapierverwaltung@bundesbank.de](mailto:z5.wertpapierverwaltung@bundesbank.de)

Stamm-Nr.: [REDACTED]  
Depot-Nr.: [REDACTED]  
Depot-Inh.: [REDACTED]  
Depotart: Depot A - Dispositionsdepot  
Beleg-Nr.: 816904 / 692811  
Referenz-Nr.: 4224264

**Ertrag (Zinsen)**  
Ex-Tag: 20.02.2013

Nominal	ISIN: [REDACTED]	WKN: [REDACTED]	Zinsertrag
EUR 8.500.000,00	2,70 %	[REDACTED]	3,00 %
[REDACTED]			

Lagerstelle	CBF DISPO-BESTÄNDE		
Verwahrart	Sammelverwahrung		
Bruttobetrag		EUR	255.000,00
<b>Zu Gunsten Ihres Kontos</b>	<b>Valuta: 20.02.2013</b>	<b>EUR</b>	<b>255.000,00</b>

Unsere Steuer-Nr.: 004722010527 bei Finanzamt Frankfurt/Main V

Die Gutschrift erfolgt unter Vorbehalt des Eingangs.  
Kapitalerträge sind einkommensteuerpflichtig.  
Gebietsansässigen Empfängern von Erträgen aus ausländischen Wertpapieren obliegt eine Meldepflicht nach §59 AWV (Außenwirtschaftsverordnung), wenn die Gutschrift EUR 12.500,00 übersteigt.  
Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK



Z 5 Wertpapierabwicklung und Sicherheitenmanagement  
Postfach 11 12 32 - 60047 Frankfurt

NAME1 2000140A1  
NAME2 2000140A1  
ABTEIL  
KONTPERS  
STR.1  
STR.2  
1111 ORT  
[redacted]

Frankfurt, 18.02.2013

Telefon: +49 (0) 69 2388-2439 oder 2473

Telefon: +49 (0) 211 874-1423 oder 1424

Telefax: +49 (0) 69 9566-509985

E-Mail: z5.wertpapierverwaltung@bundesbank.de

Stamm-Nr.: [redacted]

Depot-Nr.: [redacted]

Depot-Inh.: [redacted]

Depotart: Depot A - Dispositionsdepot

Beleg-Nr.: 816839 / 0

Referenz-Nr.: 4224069

**Fälligkeit (Gesamtrückzahlung)**

Ex-Tag: 06.02.2013

<b>Nominal</b> EUR 25.000.000,00	<b>ISIN:</b> [redacted] 0,622 %	<b>WKN:</b> [redacted]	<b>Rückzahlung</b> 100,00 %
-------------------------------------	------------------------------------	------------------------	--------------------------------

Lagerstelle CBF DISPO-BESTAENDE  
Verwahrart Sammelverwahrung

Bruttobetrag	EUR	25.000.000,00
<b>Zu Gunsten Ihres Kontos</b>	<b>Valuta: 06.02.2013 EUR</b>	<b>25.000.000,00</b>

Unsere Steuer-Nr.: 004722010527 bei Finanzamt Frankfurt/Main V

Die Gutschrift erfolgt unter Vorbehalt des Eingangs.  
Kapitalerträge sind einkommensteuerpflichtig.  
Gebietsansässigen Empfängern von Erträgen aus ausländischen Wertpapieren obliegt eine Meldepflicht nach §59 AWW (Außenwirtschaftsverordnung), wenn die Gutschrift EUR 12.500,00 übersteigt. Für eingelöste DM-Auslandsanleihen besteht keine Meldepflicht (§64 AWW).  
Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK

## 5 Mitteilungen

Bestimmte Mitteilungen werden Geschäftspartnern ausschließlich im ExtraNet-Postfach der Fachanwendung CAP zur Verfügung gestellt. Der Benutzer kann den Empfang (Download) der Mitteilung bestätigen, was zur Folge hat, dass diese - auch für die übrigen berechtigten Benutzer des Instituts - im Postfach nicht mehr sichtbar ist. Wird der Download der Mitteilung nicht durch einen Benutzer bestätigt, so kommt die maximale Aufbewahrungsfrist für Mitteilungen im ExtraNet-Postfach von 90 Tagen zum Tragen.

Beim Eingang einer von der Bundesbank versandten Nachricht im ExtraNet-FT-Postfach (Bereich Sicherheitenmanagement) besteht die Möglichkeit, eine Mailbenachrichtigung zu erhalten. In der Grundeinstellung ist diese Funktion deaktiviert, sie kann jedoch von den für das ExtraNet-FT-Postfach registrierten Benutzern bei Bedarf einzeln über folgenden Link im Bereich „Datei-Download“ freigeschaltet werden:

<https://extranet.bundesbank.de/FT/>

Eine Änderung der Einstellung über den Basisservice Filetransfer ist jederzeit möglich.

Der Zugang zum ExtraNet-Postfach ist Gegenstand von Abschnitt 1.4 dieser Schnittstellenbeschreibung.



## 5.1 Tenderabrechnung

Tenderabrechnungen werden allen geldpolitischen Geschäftspartnern der Deutschen Bundesbank als PDF-Datei im ExtraNet-Postfach zur Verfügung gestellt. Zusätzlich besteht für Geschäfte mit Festzins die Möglichkeit Tenderabrechnungen A2A in Form eines SWIFT MT 320 und für Geschäfte mit Zinsanpassung/spreadbasierten Tendern in Form eines MT 398 zu erhalten. Bei vorzeitiger Rückzahlung oder Fälligkeit von Geschäften steht eine PDF-Datei im ExtraNet-Postfach zur Verfügung. Im Sonderfall von Rückrechnungen/Kürzungen mangels Deckung werden die entsprechenden SWIFT MT 320 bzw. MT 398 (Storno des ursprünglichen Geschäftes, rückgerechneter Betrag, verbleibender Betrag) bereitgestellt.

Sofern Bedarf besteht, können in einem Folgerelease auch die jeweiligen XML-Äquivalente zur Verfügung gestellt werden.

### 5.1.1 Tenderabrechnung via ExtraNet-Postfach

Abrechnung Offenmarktkredit mit fester Verzinsung während der Laufzeit



Zentralsbereich Märkte  
Postfach 11 12 22 - 60047 Frankfurt



Frankfurt, 15.05.2017  
Geldpolitische Tenderoperationen  
Telefon: +49 (0) 69 2388-1480  
Telefax: +49 (0) 69 2388-1440  
omts@bundesbank.de

Stamm-Nr.:  
Sicherheitenkonto-Nr.:  
MFI-Nr.:  
Beleg-Nr.: 12648  
Referenz-Nr.: 8079837

#### Abrechnung Offenmarktkredit

Nachstehenden Offenmarktkredit rechnen wir gemäß unseren Allgemeinen Geschäftsbedingungen -Abschnitt V- ab:

Tender ID: T71201701  
Valutatag: 15.05.2017  
Verfalltag: 22.05.2017  
Laufzeit: 7 Tage

Zuteilung EUR:	20.000.000,00
Zinssatz:	1,00 %
Zinsen EUR:	3.888,89
Rückzahlung EUR:	20.003.888,89

Die Zuteilung werden wir am Valutatag dem Konto [redacted] gutschreiben.  
Den Rückzahlungsbetrag werden wir am Verfalltag dem o.a. Konto belasten.

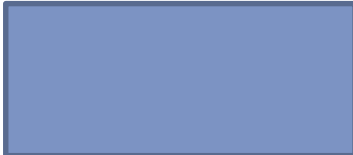
Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK

Abrechnung Offenmarktkredit bei Geschäften mit Zinsanpassung mit dem Hauptrefinanzierungssatz als Zinsbasis (kein GLRG-III) (spreadbasiert)

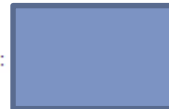


Zentralbereich Märkte - Postfach 11 12 32 - 60047 Frankfurt



Frankfurt, 28.07.2021  
Geldpolitische Tenderoperationen  
Telefon: +49 (0) 69 2388-1480  
Telefax: +49 (0) 69 2388-1440  
omtos@bundesbank.de

Stamm-Nr.:  
Sicherheitenkonto-Nr.:  
MFI-Nr.:




Beleg-Nr.: 20337  
Referenz-Nr.: 12327454

**Abrechnung Offenmarktkredit**

Nachstehenden Offenmarktkredit mit Zinsanpassung rechnen wir gemäß unseren Allgemeinen Geschäftsbedingungen -Abschnitt V- ab:

Tender ID: DP4056002  
Valutatag: 28.07.2021  
Verfalltag: 29.07.2021  
Laufzeit: 3 Tage

Zuteilung EUR:	10.000,00
Zinssatz:	Verzinsung variabel
Zinsbasis:	Hauptrefinanzierung
Spread in Basispunkten:	5
Rückzahlung EUR:	10.000,00 zzgl. Zinsen*

Die Zuteilung werden wir am Valutatag dem Konto  gutschreiben.

Den Rückzahlungsbetrag werden wir am Verfalltag dem o.a. Konto belasten.

\* Die Zinsberechnung erfolgt gemäß gesonderter Zinsabrechnung laut Tenderankündigung.

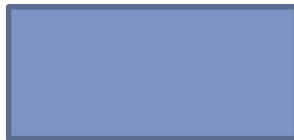
Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK

Abrechnung Offenmarktkredit bei Geschäften mit Zinsanpassung mit dem Einlagenfazilitätsatz als Zinsbasis (kein GLRG-III) (spreadbasiert)



Zentralbereich Märkte - Postfach 11 12 32 - 60047 Frankfurt



Frankfurt, 26.07.2021  
Geldpolitische Tenderoperationen  
Telefon: +49 (0) 69 2388-1480  
Telefax: +49 (0) 69 2388-1440  
ombos@bundesbank.de

Stamm-Nr.:  
Sicherheitenkonto-Nr.:  
MFI-Nr.:  
Beleg-Nr.: 20312  
Referenz-Nr.: 12325974




**Abrechnung Offenmarktkredit**

Nachstehenden Offenmarktkredit mit Zinsanpassung rechnen wir gemäß unseren Allgemeinen Geschäftsbedingungen -Abschnitt V- ab:

Tender ID: T40560010  
Valutatag: 26.07.2021  
Verfalltag: 30.07.2021  
Laufzeit: 4 Tage

Zuteilung EUR:	100.000,00
Zinssatz:	Verzinsung variabel
Zinsbasis:	Einlagenfazilität
Spread in Basispunkten:	10
Rückzahlung EUR:	100.000,00 zzgl. Zinsen*

Die Zuteilung werden wir am Valutatag dem Konto  gutschreiben.

Den Rückzahlungsbetrag werden wir am Verfalltag dem o.a. Konto belasten.

\* Die Zinsberechnung erfolgt gemäß gesonderter Zinsabrechnung laut Tenderankündigung.

Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK

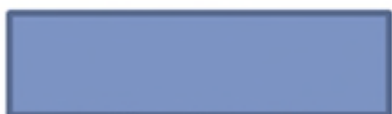
Zinsabrechnung für Geschäfte mit Zinsanpassung (spreadbasiert)



Zentralbereich Märkte  
Postfach 11 12 22 - 60047 Frankfurt



Frankfurt, 02.06.2017  
Geldpolitische Tenderoperationen  
Telefon: +49 (0) 69 2388-1480  
Telefax: +49 (0) 69 2388-1440  
omts@bundesbank.de



Beleg-Nr.: 12891  
Referenz-Nr.: 8100756

Zinsabrechnung Offenmarktkredit

Für nachstehenden Offenmarktkredit berechnen wir gemäß unseren Allgemeinen Geschäftsbedingungen - Abschnitt V - den folgenden Zinsbetrag:

Tender ID: T71201708  
Valutatag: 30.05.2017  
Verfalltag: 02.06.2017  
Laufzeit: 3 Tage

Zuteilungsbetrag EUR	Zinssatz %	mit Wirkung vom	Zinstage	Zinsen EUR
1.000.000,00	0,10	30.05.2017	1	2,78
1.000.000,00	0,20	31.05.2017	2	11,11
			Summe	13,89

Den Zinsbetrag haben wir über das Konto  verrechnet

Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK



## Abrechnung Termineinlage



Zentralbereich Märkte  
Postfach 11 12 22 - 60047 Frankfurt



Frankfurt, 22.05.2017  
Geldpolitische Tenderoperationen  
Telefon: +49 (0) 69 2388-1480  
Telefax: +49 (0) 69 2388-1440  
omts@bundesbank.de


Stamm-Nr.:   
MFI-Nr.:   
Beleg-Nr.: 3622  
Referenz-Nr.: 8087105

### Abrechnung Termineinlage

Nachstehende Termineinlage rechnen wir gemäß unseren Allgemeinen Geschäftsbedingungen -Abschnitt V- ab:

Tender-ID: T71201704  
Valutatag: 22.05.2017  
Fälligkeitsdag: 24.05.2017  
Laufzeit: 2 Tage

Zuteilung EUR: 1.000.000,00  
Zinssatz: 0,50 %  
Zinsen EUR: 27,78  
Rückzahlung EUR: 1.000.027,78

Den Zuteilungsbetrag belasten wir am Valutatag dem Konto   
Den Rückzahlungsbetrag schreiben wir dem o.a. Konto am Fälligkeitsdag gut.

Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK

Abrechnung Offenmarktkredit für die gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäfte der Serie 3 (GLRG-III)

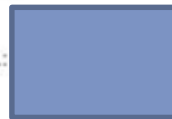


Zentralbereich Märkte - Postfach 11 12 32 - 60047 Frankfurt



Frankfurt, 12.05.2022  
Geldpolitische Tenderoperationen  
Telefon: +49 (0) 69 2388-1480  
Telefax: +49 (0) 69 2388-1440  
omtlos@bundesbank.de

Stamm-Nr.:  
Sicherheitenkonto-Nr.:  
MFI-Nr.:  
Beleg-Nr.: 21038  
Referenz-Nr.: 12776385



#### Abrechnung Offenmarktkredit


Nachstehenden Offenmarktkredit mit Zinsanpassung rechnen wir gemäß unseren Allgemeinen Geschäftsbedingungen -Abschnitt V- ab:

Tender ID: TTLTRO38  
Valutatag: 13.05.2022  
Verfalltag: 21.05.2022  
Laufzeit: 8 Tage

**Zuteilung EUR:** 2.500,00  
**Zinssatz:** Verzinsung variabel

**Spread in Basispunkten:** 0

**Rückzahlung EUR:** 2.500,00 zzgl. Zinsen\*

Die Zuteilung werden wir am Valutatag dem Konto  gutschreiben.

Den Rückzahlungsbetrag werden wir am Verfalltag dem o.a. Konto belasten.

\* Die Zinsberechnung erfolgt gemäß gesonderter Zinsabrechnung laut Tenderankündigung.

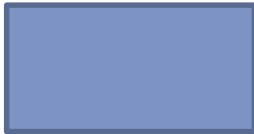
Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK

Mitteilung über die Festetzung des Spreadsatzes bei gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäften der Serie 3 (GLRG-III)



Zentralbereich Märkte – Postfach 11 12 32 – 60047 Frankfurt



Frankfurt, 04.08.2021  
Geldpolitische Tenderoperationen  
Telefon: +49 (0) 69 2388-1480  
Telefax: +49 (0) 69 2388-1440  
ombs@bundesbank.de

Stamm-Nr.:  
Sicherheitenkonto-Nr.:  
MFI-Nr.:  
Beleg-Nr.: 20151  
Referenz-Nr.: 12347154

**Abrechnung Offenmarktkredit  
hier: Festsetzung Spreadsatz**

Für nachstehenden Offenmarktkredit

Referenznummer: TLTRO3NR1  
Valutatag: 08.07.2021  
Verfalltag: 28.01.2022  
Laufzeit: 204 Tage  
Ausst. Betrag EUR 1.000,00

haben wir den Spreadsatz mit Wirkung vom 08.07.2021 wie folgt festgelegt.

Finaler Spreadsatz in %: -0,123456

Die Zinsabrechnung erfolgt am Fälligkeitstag gesondert.

Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

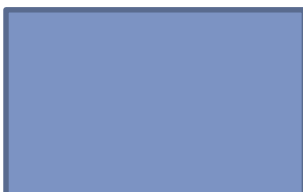
DEUTSCHE BUNDESBANK



Mitteilung über den finalen Zinssatz (Voravis 5 Tage vor Fälligkeit) bei gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäften der Serie 3 (GLRG-III)



Zentrabereich Märkte - Postfach 11 12 32 - 60047 Frankfurt



Frankfurt, 12.05.2022

Geldpolitische Tenderoperationen

Telefon: +49 (0) 69 2388-1480

Telefax: +49 (0) 69 2388-1440

omtos@bundesbank.de

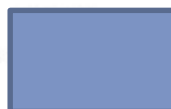
Stamm-Nr.:

Sicherheitenkonto-Nr.:

MFI-Nr.:

Beleg-Nr.: 20798

Referenz-Nr.: 12776317



#### Zinsabrechnung Offenmarktkredit

Für nachstehenden Offenmarktkredit berechnen wir gemäß unseren Allgemeinen Geschäftsbedingungen - Abschnitt V - den folgenden Zinsbetrag:

Tender ID: TTLTRO35  
Valutatag: 27.04.2022  
Verfalltag: 17.05.2022  
Laufzeit: 20 Tage

	Ausst. Betrag EUR	Zinssatz %	mit Wirkung vom	Zinstage	Zinsen EUR
	1.000,00	-1,0250	27.04.2022	20	-0,67
Davon: *					
BVZ2		-2,0000	27.04.2022	7	-0,39
PostVZ		-0,5000	04.05.2022	13	-0,18
				Summe	-0,57

Den Zinsbetrag haben wir über das Konto  verrechnet.

\* Maßgeblich ist der errechnete Zinsbetrag für die gesamte Laufzeit. Differenzen in der Summe der Davon-Positionen ergeben sich durch Rundung der Zahlen.

Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK

## 5.1.2 Tenderabrechnung für Teilnehmer

### 5.1.2.1 Tenderabrechnung für Teilnehmer bei Geschäften mit Festzins via SWIFT MT 320

Die Deutsche Bundesbank (Sender BIC: MARKDEFFOBS) übermittelt die SWIFT-Nachricht an den Geschäftspartner.

Status	Tag	Field Name	Content/Options	Verwendung / Feldbelegung
<b>Mandatory Sequence A General Information</b>				
M	15A	New Sequence	Empty field	
M	20	Sender's Message Reference	16x	Transaktionsnummer der Bundesbank
O	21	Related Reference	16x	wenn Feld 22A mit "CANC" belegt ,hier Inhalt Feld 20 der Ursprungsnachricht
M	22A	Type of Operation	4!c	"NEWT" bei einer Neuzuteilung, "CANC" bei einem Storno auf Grund einer Rückrechnung
O	94A	Scope of Operation	4!c	"BILA"
M	22B	Type of Event	4!c	"CONF"
M	22C	Common Reference	4!a2!c4!n4!a2!c	(Bank Code 1)(Location Code 1)(Reference Code)(Bank Code 2)(Location Code 2) ; z.B: MARKDE0003BDWBMM
O	21N	Contract Number Party A	16x	TenderID und die letzten 7 Stellen der Transaktionsnummer (Wird im MT 202 und MT 204 im Feld 21 wiedergegeben)
M	82a	Party A	A, D, or J	"MARKDEFFOBS"
M	87a	Party B	A, D, or J	BIC des Kontrahenten
O	83a	Fund or Instructing Party	A, D, or J	Dieses Feld wird nicht genutzt.
O	77D	Terms and Conditions	6*35x	„/OMG/“ Bei einer GLRG-III Tenderabrechnung wird dieses Feld mit folgender Information befüllt sein: /OMG/ /rueckwirkende Anpassung //des Spreadsatzes moeglich/
<b>End of Sequence A General Information</b>				
<b>Mandatory Sequence B Transaction Details</b>				
M	15B	New Sequence	Empty field	
M	17R	Party A's Role	1!a	„ L“ (Lender) (OMK) für Refinanzierungsgeschäfte oder „B“ (Borrower) bei Termingeld
M	30T	Trade Date	8!n	Zuteilungstag
M	30V	Value Date	8!n	Value date
M	30P	Maturity Date	8!n	Maturity date

M	32B	Currency and Principal Amount	3!a15d	Belegung mit Wahrung „EUR“ und Zuteilungsbetrag
O	32H	Amount to be Settled	[N]3!a15d	Dieses Feld wird nicht genutzt.
O	30X	Next Interest Due Date	8!n	Next Interest Due Date (Zinsfalligkeitstag)
M	34E	Currency and Interest Amount	[N]3!a15d	Belegung mit Wahrung „EUR“ und Zinsbetrag
M	37G	Interest Rate	[N]12d	Zinssatz
M	14D	Day Count Fraction	7x	Zinsusance „ACT/360“
O	30F	Last Day of the First Interest Period	8!n	Diese Felder werden nicht genutzt.
O	38J	Number of Days	1!a3!n	
<b>End of Sequence B Transaction Details</b>				
<b>Mandatory Sequence C Settlement Instructions for Amounts Payable by Party A</b>				
M	15C	New Sequence	Empty field	
O	53a	Delivery Agent	A, D, or J	Diese Felder werden nicht genutzt.
O	86a	Intermediary 2	A, D, or J	
O	56a	Intermediary	A, D, or J	
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	"Account BIC des primaren MCAs des Geldpolitischen Geschaftspartners" bei der Bundesbank
O	58a	Beneficiary Institution	A, D, or J	Dieses Feld wird nicht belegt.
<b>End of Sequence C Settlement Instructions for Amounts Payable by Party A</b>				
<b>Mandatory Sequence D Settlement Instructions for Amounts Payable by Party B</b>				
M	15D	New Sequence	Empty field	
O	53a	Delivery Agent	A, D, or J	Diese Felder werden nicht genutzt.
O	86a	Intermediary 2	A, D, or J	
O	56a	Intermediary	A, D, or J	
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	„Relevanter TARGET CLM BIC der Bundesbank“ MARKDEFFOBS
O	58a	Beneficiary Institution	A, D, or J	Dieses Feld wird nicht belegt.
<b>End of Sequence D Settlement Instructions for Amounts Payable by Party B</b>				
<b>Optional Sequence E Settlement Instructions for Interests Payable by Party A</b>				
M	15E	New Sequence	Empty field	Sequence <b>E</b> wird nicht genutzt.
O	53a	Delivery Agent	A, D, or J	
O	86a	Intermediary 2	A, D, or J	
O	56a	Intermediary	A, D, or J	
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	

O	58a	Beneficiary Institution	A, D, or J	<b>End of Sequence E Settlement Instructions for Interests Payable by Party A</b>
<b>Optional Sequence F Settlement Instructions for Interests Payable by Party B</b>				
M	15F	New Sequence	Empty field	
O	53a	Delivery Agent	A, D, or J	
O	86a	Intermediary 2	A, D, or J	Sequence F wird nicht genutzt.
O	56a	Intermediary	A, D, or J	
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	
O	58a	Beneficiary Institution	A, D, or J	
<b>End of Sequence F Settlement Instructions for Interests Payable by Party B</b>				
<b>Optional Sequence G Tax Information</b>				
M	15G	New Sequence	Empty field	Sequence G wird nicht genutzt.
M	37L	Tax Rate	12d	
M	33B	Transaction Currency and Net Interest Amount	3!a15d	
O	36	Exchange Rate	12d	
O	33E	Reporting Currency and Tax Amount	3!a15d	
<b>End of Sequence G Tax Information</b>				
<b>Optional Sequence H Additional Information</b>				
M	15H	New Sequence	Empty field	Diese Felder werden nicht genutzt.
O	29A	Contact Information	4*35x	
O	24D	Dealing Method	4!c[/35x]	
O	84a	Dealing Branch Party A	A, B, D, or J	
O	85a	Dealing Branch Party B	A, B, D, or J	
O	88a	Broker Identification	A, D, or J	
O	71F	Broker's Commission	3!a15d	
O	26H	Counterparty's Reference	16x	
O	21G	Broker's Reference	16x	
O	72	Sender to Receiver Information	6*35x	/REC/Die geldliche Verrechnung bei //Fälligkeit erfolgt über Konto: //Account-BIC des primären MCAs
<b>End of Sequence H Additional Information</b>				
<b>Optional Sequence I Additional Amounts</b>				
M	15I	New Sequence	Empty field	Sequence I wird nicht genutzt
M	18A	Number of Repetitions	5n	
----->				
M	30F	Payment Date	8!n	

M	32H	Currency, Payment Amount	[N]3!a15d	
-----				
O	53a	Delivery Agent	A, D, or J	
O	86a	Intermediary 2	A, D, or J	
O	56a	Intermediary	A, D, or J	
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	
<b>End of Sequence   Additional Amounts</b>				
M = Mandatory, O = Optional				

**5.1.2.2 Tenderabrechnung für Teilnehmer bei Geschäften mit Zinsanpassung  
(kein GLRG-III)/spreadbasierten Tendern via SWIFT MT 398**

Die Deutsche Bundesbank (Sender BIC: MARKDEFFOBS) übermittelt die SWIFT-Nachricht an den Geschäftspartner.

Status	Tag	Field Name	Content/Options	Verwendung / Feldbelegung
M	20	Transaction Reference Number	16x	Bundesbank Transaktionsnummer
M	12	Sub-Message Type	3!n	"320"
M	77E	Proprietary Message	73x [n*78x]	Ab hier wird der MT 320 mit den Feldern wie in der vorhergehenden Tabelle dargestellt "integriert". Der MT 320 wird nur mit seinen Geschäftsdaten aufgenommen, keine Swift Header / Trailer.

**Inhalt von Feld 77E:**

<b>Mandatory Sequence A General Information</b>				
M	15A	New Sequence	Empty field	-
M	20	Sender's Message Reference	16x	Bundesbank Transaktionsnummer
O	21	Related Reference	16x	wenn Feld 22A mit "CANC" belegt hier Inhalt Feld 20 der Ursprungsnachricht
M	22A	Type of Operation	4!c	"NEWT" bei einer Neuzuteilung, "CANC" bei einem Storno auf Grund einer Rückrechnung
O	94A	Scope of Operation	4!c	"BILA"
M	22B	Type of Event	4!c	"CONF"

M	22C	Common Reference	4!a2!c4!n4!a2!c	(Bank Code 1)(Location Code 1)(Reference Code)(Bank Code 2)(Location Code 2) ; z.B: MARKDE0003BDWBMM
O	21N	Contract Number Party A	16x	TenderID und die letzten 7 Stellen der Transaktionsnummer
M	82a	Party A	A, D, or J	"MARKDEFFOBS"
M	87a	Party B	A, D, or J	BIC des Kontrahenten
O	77D	Terms and Conditions	6*35x	"/OMG/"
<b>End of Sequence A General Information</b>				
<b>Mandatory Sequence B Transaction Details</b>				
M	15B	New Sequence	Empty field	
M	17R	Party A's Role	1!a	„L“ (Lender) (OMK) für Refinanzierungsgeschäfte und „B“ (Borrower) für Termingeld
M	30T	Trade Date	8!n	Zuteilungstag
M	30V	Value Date	8!n	Value date
M	30P	Maturity Date	8!n	Maturity date
M	32B	Currency and Principal Amount	3!a15d	Währung "EUR" und Zuteilungsbeitrag
M	30X	Next Interest Due Date	8!n	Next Interest Due Date (Zinsfälligkeitstag)
M	14D	Day Count Fraction	7x	Zinsusance (ACT/360)
<b>End of Sequence B Transaction Details</b>				
<b>Mandatory Sequence C Settlement Instructions for Amounts Payable by Party A</b>				
M	15C	New Sequence	Empty field	-
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	"Account BIC des primären MCA-Konto des Geldpolitischen Geschäftspartners" bei der Bundesbank
<b>End of Sequence C Settlement Instructions for Amounts Payable by Party A</b>				
<b>Mandatory Sequence D Settlement Instructions for Amounts Payable by Party B</b>				

M	15D	New Sequence	Empty field	-
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	„Relevanter TARGET CLM BIC der Bundesbank“: MARKDEFFOBS
<b>End of Sequence D Settlement Instructions for Amounts Payable by Party B</b>				
<b>Optional Sequence H Additional Information</b>				
M	15H	New Sequence	Empty field	-
O	72	Sender to Receiver Information	6*35x	/REC/Die geldliche Verrechnung bei //Faelligkeit erfolgt über Konto : //Account BIC des primären MCA-Konto
<b>End of Sequence H Additional Information</b>				



### 5.1.3 Mitteilung über die Festsetzung des Spreadsatzes bei gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäften (GLRG–III)

#### 5.1.3.1 Mitteilung über die Festsetzung des Spreadsatzes für Teilnehmer via SWIFT MT 320

Die Deutsche Bundesbank (Sender BIC: MARKDEFFOBS) übermittelt die SWIFT-Nachricht an den Geschäftspartner.

Status	Tag	Field Name	Content/Options	Verwendung / Feldbelegung
<b>Mandatory Sequence A General Information</b>				
M	15A	New Sequence	Empty field	
M	20	Sender's Message Reference	16x	Transaktionsnummer der Bundesbank
O	21	Related Reference	16x	Inhalt Feld 20 der Ursprungsnachricht
M	22A	Type of Operation	4!c	AMND Korrektur eines bestehenden Geschäftes
O	94A	Scope of Operation	4!c	"BILA"
M	22B	Type of Event	4!c	"CONF"
M	22C	Common Reference	4!a2!c4!n4!a2!c	(Bank Code 1)(Location Code 1)(Reference Code)(Bank Code 2)(Location Code 2) ; z.B: MARKDE0003BDWBMM
O	21N	Contract Number Party A	16x	TenderID und die letzten 7 Stellen der Transaktionsnummer können der Position 21 in der Prämienvergütungsabrechnung oder der Position 20 der Ursprungsnachricht entnommen werden.
M	82a	Party A	A, D, or J	"MARKDEFFOBS"
M	87a	Party B	A, D, or J	BIC des Kontrahenten
O	83a	Fund or Instructing Party	A, D, or J	Dieses Feld wird nicht genutzt.
O	77D	Terms and Conditions	6*35x	/OMG/ /Festsetzung Praemie/
<b>End of Sequence A General Information</b>				
<b>Mandatory Sequence B Transaction Details</b>				
M	15B	New Sequence	Empty field	
M	17R	Party A's Role	1!a	„ L “ (Lender) (OMK) für Refinanzierungsgeschäfte
M	30T	Trade Date	8!n	Zuteilungstag
M	30V	Value Date	8!n	Value date
M	30P	Maturity Date	8!n	Maturity date
M	32B	Currency and Principal Amount	3!a15d	Belegung mit Währung „EUR“ und Zuteilungsbetrag
O	32H	Amount to be Settled	[N]3!a15d	Dieses Feld wird nicht genutzt.

O	30X	Next Interest Due Date	8!n	Next Interest Due Date (Zinsfälligkeitstag)
M	34E	Currency and Interest Amount	[N]3!a15d	Belegung mit Währung „EUR“ und Nettobetrag aus Zins und Prämie (auch negative Werte möglich)
M	37G	Interest Rate	[N]12d	Nettoabrechnungssatz aus Ursprungszins und Prämie (auch negativ Werte möglich)
M	14D	Day Count Fraction	7x	Zinsusance „ACT/360“
O	30F	Last Day of the First Interest Period	8!n	Diese Felder werden nicht genutzt.
O	38J	Number of Days	1!a3!n	
<b>End of Sequence B Transaction Details</b>				
<b>Mandatory Sequence C Settlement Instructions for Amounts Payable by Party A</b>				
M	15C	New Sequence	Empty field	
O	53a	Delivery Agent	A, D, or J	Diese Felder werden nicht genutzt.
O	86a	Intermediary 2	A, D, or J	
O	56a	Intermediary	A, D, or J	
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	"Account BIC des primären MCA-Konto des Geldpolitischen Geschäftspartners" bei der Bundesbank
O	58a	Beneficiary Institution	A, D, or J	Dieses Feld wird nicht belegt.
<b>End of Sequence C Settlement Instructions for Amounts Payable by Party A</b>				
<b>Mandatory Sequence D Settlement Instructions for Amounts Payable by Party B</b>				
M	15D	New Sequence	Empty field	
O	53a	Delivery Agent	A, D, or J	Diese Felder werden nicht genutzt.
O	86a	Intermediary 2	A, D, or J	
O	56a	Intermediary	A, D, or J	
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	„Relevanter TARGET CLM BIC der Bundesbank“ MARKDEFFOBS
O	58a	Beneficiary Institution	A, D, or J	Dieses Feld wird nicht belegt.
<b>End of Sequence D Settlement Instructions for Amounts Payable by Party B</b>				
<b>Optional Sequence E Settlement Instructions for Interests Payable by Party A</b>				
M	15E	New Sequence	Empty field	Sequence <b>E</b> wird nicht genutzt.
O	53a	Delivery Agent	A, D, or J	
O	86a	Intermediary 2	A, D, or J	
O	56a	Intermediary	A, D, or J	
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	
O	58a	Beneficiary Institution	A, D, or J	

<b>End of Sequence E Settlement Instructions for Interests Payable by Party A</b>				Sequence F wird nicht genutzt.
<b>Optional Sequence F Settlement Instructions for Interests Payable by Party B</b>				
M	15F	New Sequence	Empty field	
O	53a	Delivery Agent	A, D, or J	
O	86a	Intermediary 2	A, D, or J	
O	56a	Intermediary	A, D, or J	
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	
O	58a	Beneficiary Institution	A, D, or J	
<b>End of Sequence F Settlement Instructions for Interests Payable by Party B</b>				
<b>Optional Sequence G Tax Information</b>				Sequence G wird nicht genutzt.
M	15G	New Sequence	Empty field	
M	37L	Tax Rate	12d	
M	33B	Transaction Currency and Net Interest Amount	3!a15d	
O	36	Exchange Rate	12d	
O	33E	Reporting Currency and Tax Amount	3!a15d	
<b>End of Sequence G Tax Information</b>				
<b>Optional Sequence H Additional Information</b>				Diese Felder werden nicht genutzt.
M	15H	New Sequence	Empty field	
O	29A	Contact Information	4*35x	
O	24D	Dealing Method	4!c[/35x]	
O	84a	Dealing Branch Party A	A, B, D, or J	
O	85a	Dealing Branch Party B	A, B, D, or J	
O	88a	Broker Identification	A, D, or J	
O	71F	Broker's Commission	3!a15d	
O	26H	Counterparty's Reference	16x	
O	21G	Broker's Reference	16x	
O	72	Sender to Receiver Information	6*35x	/REC/Die geldliche Verrechnung bei //Fälligkeit erfolgt über Konto: //Account BIC des primären MCA-Kontos
<b>End of Sequence H Additional Information</b>				
<b>Optional Sequence I Additional Amounts</b>				Sequence I wird nicht genutzt
M	15I	New Sequence	Empty field	
M	18A	Number of Repetitions	5n	
----->				
M	30F	Payment Date	8!n	
M	32H	Currency, Payment Amount	[N]3!a15d	

-----				
O	53a	Delivery Agent	A, D, or J	
O	86a	Intermediary 2	A, D, or J	
O	56a	Intermediary	A, D, or J	
M	57a	Receiving Agent	A, D, or J	
<b>End of Sequence   Additional Amounts</b>				
M = Mandatory, O = Optional				

#### **5.1.4 Gutschrift/Belastung Offenmarktgeschäft pacs.009/pacs.010**

Im Falle der Nutzung einer festen Kreditlinie finden die Nachrichten pacs.009 bzw. pacs.010 als Connected Payment Anwendung, ohne die Kreditlinie zu verändern (Betrag Kreditlinienänderung=0). Die im Connected Payment pacs.009 im Tag InstrId (Instruction Id) angegebene Tender-ID wird in der camt.054 in Feld 21 wiedergegeben.

## 5.2 Sicherheitenkonto-Mitteilung via ExtraNet-Postfach

Sofern es auf einem Sicherheitenkonto zu Bestandsveränderungen kommt, werden von der Deutschen Bundesbank Sicherheitenkontomitteilungen erstellt. Sie werden den Geschäftspartnern ausschließlich elektronisch (ExtraNet-Postfach) zur Verfügung gestellt. Eine Sicherheitenkontomitteilung enthält den Nominalwert sowie den Beleihungswert je Sicherheitenposition (nur sofern vorhanden), den Gesamtbeleihungswert sowie die noch zur Verfügung stehende Kreditlinie.



Z.B. Wertpapierabwicklung und Sicherheitenmanagement  
Postfach 11 12 22 - 60047 Frankfurt

DEUTSCHE BUNDESBANK  
EUROSYSTEM

Frankfurt, 20.05.2017

Telefon: +49 (0) 69 2388-2477

Telefax: +49 (0) 69 2388-2496

E-Mail: sicherheitenmanagement@bundesbank.de

Stamm-Nr.: [REDACTED]

Sicherheitenkonto-Nr.: [REDACTED]

MFI-Nr.: [REDACTED]

Referenz-Nr.: 7453980

### Sicherheitenkontomitteilung Nr. 664

Der Beleihungswert Ihres Sicherheitenkontos setzt sich per 19.05.2017 wie folgt zusammen:

	EUR
Bestände in Dispositionsdepots	5.143.098.840,79
Kreditforderungen	588.320.667,42
Cash Collateral	0,00
Triparty	21.980.410.473,96
Termineinlagen	0,00
Sonstige Sicherheiten	0,00
	<hr/>
	27.711.829.982,17
Die noch zur Verfügung stehende Kreditlinie beträgt:	8.000.000.000,00
Fixe Kreditlinie	8.000.000.000,00

Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK

### **5.3 Bestandsmitteilung Sicherheitenkonto**

Bestandsmitteilungen stellen eine Übersicht des Sicherheitenbestandes eines Geschäftspartners und seiner Inanspruchnahmen dar und werden auf Anforderung durch den Geschäftspartner bzw. zum Jahresultimo auf Initiative der Bundesbank erstellt. Die Bestandsmitteilung enthält den Nominalwert sowie die Beleihungswerte je Sicherheitenposition sowie den Gesamtbeleihungswert aller Sicherheiten, die Inanspruchnahmen und den freien Beleihungswert. Sie werden ausschließlich im ExtraNet-Postfach zur Verfügung gestellt.

XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX  
XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX  
XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX  
XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX

Frankfurt, 31.12.2016

Telefon: +49 (0) 69 2388-2477

Telefax: +49 (0) 69 2388-2496

E-Mail: sicherheitenmanagement@bundesbank.de

Stamm-Nr.: XXXXXXXX

Sicherheitenkonto-Nr.: XXXXXXXX

MFI-Nr.: XXXXXXXX

Referenz-Nr.: 7303971

**Bestandsmitteilung über Sicherheiten und Inanspruchnahmen per 30.12.2016  
für Sicherheitenkonto XXXXXXXX**

Sehr geehrte Damen und Herren,

wir teilen Ihnen den Bestand Ihrer Sicherheiten und Inanspruchnahmen in Ihrem Sicherheitenkonto nachrichtlich mit:

	Beleihungswert (EUR)
Bestände in Dispositionsdepots	XXXXXXXXXX
Kreditforderungen	XXXXXXXXXX
Cash Collateral	0,00
Triparty	0,00
Termineinlagen	0,00
Sonstige Sicherheiten	0,00
<b>Gesamtbleihungswert</b>	<b>XXXXXXXXXX</b>
Offenmarktkredite	0,00
Antragsübernachtkredit	0,00
Kundensperre	0,00
Bundesbanksperre	0,00
Kreditlinie	0,00

Inanspruchnahmen durch automatisch aufgenommenen Übernachtkredit erfragen Sie bitte bei den Kunden-Betreuungs-Services.

Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK



## **5.4 Bestandsaufstellung Dispositionsdepot**

Auf Antrag des Geschäftspartners kann ein sogenannter „erweiterter Dispositionsdepotauszug“ per SWIFT-Nachricht MT 535 oder in Papierform zur Verfügung gestellt werden. In diesem Auszug wird dann jede marktfähige Sicherheit mit ihrem Nominal- und Beleihungswert ausgewiesen.

Der erweiterte Dispositionsdepotauszug ist außer als SWIFT-Nachricht MT 535 (dto. XML-Format) auch als PDF-Datei im ExtraNet-Postfach erhältlich.

### 5.4.1 Bestandsaufstellung Dispositionsdepot via SWIFT MT 535

Die Deutsche Bundesbank (Sender BIC: MARKDEFFCCB) übermittelt die SWIFT-Nachricht an den Geschäftspartner.

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Code word/Field usage
--------	-----	-----------	--------------------	---------------------	-----------------------

Mandatory Sequence A - General Information

M	16R			Start of Block	GENL
M	28E			Page Number/Continuation Indicator	5n/4!c /LAST Last page of a statement with more than one page /MORE Intermediate page of a statement which contains additional page /ONLY Only page of the statement
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c/16x "SEME"//Reference assigned by the Sender to unambiguously identify the message
M	23G			Function of the Message	4!c/4!c "NEWM" for new message
O	98A	PREP	Date/Time	Option C	:4!c/8!n6!n "PREP"//yymmddhhmm Date/time at which the message was prepared
M	98A	STAT	Date	Option A	:4!c/8!n „STAT“//Date at which the statement is based
M	22F	SFRE	Indicator	Statement Frequency Indicator	:4!c/[8c]/4!c „SFRE“//frequency of the statement Indicator codes: "DAIL" (Statement is sent daily) or "MNTH" (Statement is sent monthly) or

					“WEEK” (Statement is sent weekly) or “YEAR” (Statement is sent yearly)
M	22F	COD E	Indicator	Complete/Updates Indicator	:4!c/[8c]/4!c “CODE”//<Indicator code> Indicator code : “COMP” (Statement gives complete information)
M	22F	STT Y	Indicator	Statement Type	:4!c/[8c]/4!c “STTY”//<Indicator code of the usage purpose of the statement of holding> Indicator code: “CUST” (Statement is a custody statement)
M	22F	STB A	Indicator	Statement Basis	“STBA”//type of balances on which the statement is prepared Indicator code: “SETT” (Statement is based on actual settlement date positions)
M	97A	SAF E	Account	Option A	:4!c//35x “SAFE”//Account number of “Dispositionsdepot”
M	17B	ACT I	Flag	Activity Flag	:4!c//1!a „ACTI“// <flag code> Whether the holdings are reported in this statement. Flag code = “Y” for “YES”
M	17B	CON S	Flag	Sub-safekeeping Statement	:4!c//1!a „CONS“//<flag code> Whether the statement reports holdings at subsafekeeping account level. Flag code = “N” for “No”

End of Mandatory Sequence A - General Information

M	16S			End of Block	GENL
---	-----	--	--	--------------	------

Optional Repetitive Sequence B Sub-safekeeping account

M	16R			Start of Block	SUBSAFE
---	-----	--	--	----------------	---------

Optional Repetitive Subsequence B1 Financial Instrument

M	16R			Start of Block	FIN
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN1!e12!c]; [4*35x] ISIN code
M	93B	AGGR	Balance	Option B	:4!c/[8c]/4!c/[N]15d „AGGR“//quantity type code/Balance Type code : "FAMT" if quantity is expressed as a face amount "UNIT" if quantity is expressed as a number
M	16R			Start of Block	FIA
O	92A	VAHA			:4!c/[N]15d VAHA//Valuation Haircut
M	16S			End of Block	FIA

Optional Repetitive Subsequence B1b Sub-balance

M	16R			Start of Block	SUBBAL
M	93B	AGGR	Balance	Option B	:4!c/[8c]/4!c/[N]15d „AGGR“//quantity type code/Balance Type code : "FAMT" if quantity is expressed as a face amount "UNIT" if quantity is expressed as a number
O	93B	NAVL			:4!c/[8c]/4!c/[N]15d NAVL//Quantity Type Code)(Balance)
O	94A	SAFE	Place	Option F	:4!c/[8c]/4!c/[30x] „SAFE“//Place code/Identifier code (Place of Safekeeping) Place code : „CUST“ (Local Custodian) „NCSD“ (National Central Securities Depository)

					„ICSD“ (National Central Securities Depository) Identifier code: BIC of the “Correspondent Central Bank or “Central Securities Depository”
O	19A	COVA	Amount	Collateral Value	:4!c//[N]3!a15d „COVA“//Currency code/Amount
O	92B	EXCH		Exchange Rate	:4!c//3!a/3!a/15d EXCH//First Currency Code/Second Currency Code/Rate

End of Subsequence B1b Sub-balance

M	16S			End of Block	SUBBAL
---	-----	--	--	--------------	--------

End of Subsequence B1 Financial Instrument

M	16R			End of Block	FIN
---	-----	--	--	--------------	-----

End of Sequence B Sub-safekeeping account

M	16R			End of Block	SUBSAFE
---	-----	--	--	--------------	---------

M=Mandatory            O=Optional

#### 5.4.2 Bestandsaufstellung Dispositionsdepot via Extranet XML

BalForAcct wiederholt sich pro reporteter ISIN

<b><u>Element / Attribute</u></b>						
<b>SctiesBal- CtdyRpt</b>						
type= SecuritiesBalanceCus- todyReportV05						
xs:sequence	<b>Pgntn</b>					
	type=Pagination					
	xs:sequence	<b>PgNb</b>				
		type= Max5Numeric- Text				
		<i>pattern value</i> "[0-9]{1,5}"				
		<b>LastPgInd</b>				
		type= YesNoIndicator				
		<i>Anwendbare Codes</i>				
		<i>true false</i>				

	<b>StmtGnlDtIs</b>					
	type Statement33					
	xs:sequence	<b>StmtId</b>				
		type Max35Text				
		<i>min length "1" max length "35"</i>				
		<b>StmtDtTm</b>				
		type DateAnd-DateTimeChoice				
		xs:sequence	<b>Dt</b>			
		xs:choice	type ISODate			
			<i>Format yyyy-mm-dd</i>			
		<b>Frqcy</b>				
		type Frequency-9Choice				
		xs:sequence	<b>Cd</b>			
		xs:choice	type Event-Frequency7Code			
			<i>enumeration value="YEAR"</i>			
			<i>enumeration value="ADHO"</i>			

			<i>enumeration</i> <i>value="MNTH"</i>			
			<i>enumeration</i> <i>value="DAIL"</i>			
			<i>enumeration</i> <i>value="INDA"</i>			
			<i>enumeration</i> <i>value="WEEK"</i>			
			<i>enumeration</i> <i>value="SEMI"</i>			
			<i>enumeration</i> <i>value="QUTR"</i>			
			<i>enumeration</i> <i>value="TOMN"</i>			
			<i>enumeration</i> <i>value="TOWK"</i>			
			<i>enumeration</i> <i>value="TWMN"</i>			
			<i>enumeration</i> <i>value="OVNG"</i>			
			<i>enumeration</i> <i>value=ONDE"</i>			
		<b>UpdTp</b>				



		type Update- Type2Choice				
		xs:sequence	<b>Cd</b>			
		xs:choice	type Statement- UpdateType1- Code			
			<i>Anwendbare Codes</i>			
			<i>COMP DELT</i>			
		<b>StmntBsis</b>				
		type Statement- Basis3Choice				
		xs:sequence	<b>Cd</b>			
		xs:choice	type Statement- Basis1Code			
			<i>Anwendbare Codes</i>			
			<i>CONT SETT TRAD</i>			
		<b>ActvtyInd</b>				
		type YesNoIndi- cator				
		<i>Anwendbare Codes</i>				
		<i>true false</i>				
		<b>SubAcctInd</b>				

		type YesNoIndicator				
		<i>Anwendbare Codes</i>				
		<i>true false</i>				
	<b>SfkpgAcct</b>					
	type SecuritiesAccount14					
	xs:sequence	<b>Id</b>				
		type Max35Text				
		<i>minLength value="1"</i>				
		<i>maxLength value="35"</i>				
	<b>BalForAcct</b>					
	type AggregateBalanceInformation16					
	xs:sequence	<b>FinInstrmId</b>				
		type SecurityIdentification14				
		xs:sequence	<b>ISIN</b>			
			type ISINIdentifier			
			<i>pattern value=</i>			

			"[A-Z0-9]{12, 12}"			
		<b>ValtnHrcutDtIs</b>				
		type BasicCollateralValuation1Details				
		xs:sequence	<b>ValtnHrcut</b>			
			type PercentageRate			
			<i>fractionDigits</i> <i>value="10"</i>			
			<i>totalDigits</i> <i>value="11"</i>			
		<b>AggtBal</b>				
		type Balance1				
		xs:sequence	<b>ShrtLngInd</b>			
			type ShortLong1Code			
			<i>Anwendbare Codes</i>			
			<i>SHOR LONG</i>			
			<b>Qty</b>			
			type Balance-Quantity4Choice			

			xs:sequence	<b>Qty</b>		
			xs:choice	type Quantity6Choice		
				xs:sequence	<b>Qty</b>	
				xs:choice	type FinancialInstrumentQuantity1Choice	
					xs:sequence	<b>FaceAmt</b>
					xs:choice	type ImpliedCurrencyAndAmount
						fractionDigits value="5"
						totalDigits value="18"
						minInclusive value="0"
						<b>Unit</b>
						type Decimal-Number
						fractionDigits value="17"
						<b>AmtsdVal</b>

						type ImpliedCur- rencyAndAmount
						fractionDigits value="5"
						totalDigits value="18"
						minInclusive value="0"
		<b>SfkpgPlc</b>				
		type Safekeeping- PlaceFormat- 3Choice				
		xs:sequence	<b>TpAndId</b>			
		xs:choice	type Safekeeping- PlaceTypeAn- dAnyBICIdenti- fier1			
			xs:sequence	<b>SfkpgPlcTp</b>		
				type Safekeeping- Place1Code		
				<i>Anwendbare Codes</i>		
				<i>CUST ICSD NCSD SHHE</i>		

				<b>Id</b>		
				type AnyBICIdentifier		
				<i>pattern value="[A-Z]{6,6}[A-Z2-9][A-NP-Z0-9]([A-Z0-9]{3,3}){0,1}"</i>		
		<b>Acct-BaseCcyAmts</b>				
		type BalanceAmounts3				
		xs:sequence	<b>ElgblCollVal</b>			
			type AmountAndDirection6			
			xs:sequence	<b>Amt</b>		
				type ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount		
				base="ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount_SimpleType"		

				<i>fractionDigits va- lue="5"</i>		
				<i>totalDigits va- lue="18"</i>		
				<i>minInclusive va- lue="0"</i>		
				attribute name="Ccy" type="Active- OrHistoricCur- rency-Code" use="required"		
				<b>Sgn</b>		
				type PlusOrMi- nusIndicator		
				<i>Anwendbare Codes</i>		
				<i>true false</i>		

### 5.4.3 Bestandsaufstellung Dispositionsdepot via ExtraNet CAP

Ansicht des Sicherheitenkontos:

Sicherheiten	Betrag	Inanspruchnahmen	Betrag
Dispositionsdepotbestände	2.898.714,38 EUR	Offenmarktkredite	0,00 EUR
Triparty	0,00 EUR	Antragsübernachkredit	0,00 EUR
Kredittforderungen	0,00 EUR	Bundesbankgipern	0,00 EUR
Terminanlagen	0,00 EUR	Kundensparren	69.134,00 EUR
Sonstige Sicherheiten	0,00 EUR		
Cash Collateral	0,00 EUR		
<b>Gesamt</b>	<b>2.898.714,38 EUR</b>	<b>Gesamt</b>	<b>69.134,00 EUR</b>
		Freier Beleihungswert	2.829.580,38 EUR
		Feste Kreditlinie	100.000.000,00 EUR
		Verfügbare Kreditlinie in T2	2.829.580,38 EUR
		Antragsübernachkredit in Höhe von	2.500.000,00 EUR bearbragt

Verzweigung durch Klick auf Dispositionsdepotbestände

Ansicht Dispositionsdepotbestände:

ID#	Bezeichnung	SK_Nom	Lagerstelle Nr.	Lagerstelle	Einreichungsweg	Beleihungswert
DE0001195226	BUNDANLV 03/24	2.500.000	0300	CBF DISPO-BESTAENDE	Deutschland (Germany) domestic	2.898.714,38 EUR
<b>Summe:</b>						<b>2.898.714,38 EUR</b>

\*Die Wertpapiere sind bei dem an erster Stelle des Einreichungsweges genannten Zentralverwahrer hinterlegt.



## 6 Rollenkonzept CAP

Die Zuweisung der CAP-Rollen erfolgt über das ExtraNet.

### Zu beachten ist:

- Es besteht die Möglichkeit zur Anwendung des 2-Augen-Prinzips. Die entsprechende Rolle für CAP kann im Rahmen des schriftlichen Registrierungsprozesses für jede Geschäftsart separat beantragt werden.
- Für das 4-Augen-Prinzip gilt: Erfasser ungleich Freigeber; dem Erfasser wird der Button „Freigeben“ nicht angeboten.
- Beim 2-Augen-Prinzip erfolgt unmittelbar nach der Erfassung eine automatisierte Freigabe.
- Die Berechtigung für das 2-Augen-Prinzip schließt die Berechtigung für das 4-Augen-Prinzip aus. Sofern einem Benutzer die Rollen für das 2- und 4-Augen-Prinzip parallel zugewiesen werden, ist das 4-Augen-Prinzip maßgeblich.
- Aufträge können nicht geändert, sondern nur gelöscht und neu erfasst werden;
- Lesender Zugriff beinhaltet die Funktion zum CSV- und XLS-Export;
- Die Zuweisung von Rollen erfolgt über die Benutzerkennung;
- Schreibende Rolle beinhaltet lesende Rolle;
- Für jede Funktion ist die Vergabe einer nur lesenden Rolle als auch einer schreibenden Rolle möglich.

### Sicherheitenpool 1 – Geldpolitische Operationen

<b>Funktion</b>	<b>Berechtigung</b>	<b>Beschreibung</b>	<b>Name der Rolle in CAP</b>
Sicherheitenkonto	Lesen	Lesender Zugriff auf alle Funktionen im Menüpunkt „Auswertungen“ inkl. den Unterfunktionen (Dispositionsdepotbestände. Termineinlagenbestände etc.); bedeutet nicht: lesender Zugriff auf Menüpunkt „Aufträge“	SiPo 1 - Auswertung Sicherheitenkonto

Feste Kreditlinie	Schreiben	Erfassung, Freigabe, Löschung feste Kreditlinie	SiPo 1 - Erfasser Feste Kreditlinie (4-Augen-Prinzip)
Feste Kreditlinie	Schreiben	Erfassung, Löschung feste Kreditlinie, automatisierte Freigabe	SiPo 1 - Erfasser Feste Kreditlinie (2-Augen-Prinzip)
Feste Kreditlinie	Lesen	Lesen Aufträge feste Kreditlinie	SiPo 1 - Leser Feste Kreditlinie
Ein-/Auslieferungen	Schreiben	Erfassung, Freigabe, Löschung Ein- und Auslieferungen	SiPo1 – Erfasser Ein-/Auslieferungen (4-Augen-Prinzip))
Ein-/Auslieferungen	Schreiben	Erfassung, Löschung Ein- und Auslieferungen, automatisierte Freigabe	SiPo1 – Erfasser Ein-/Auslieferungen (2-Augen-Prinzip)
Ein-/Auslieferungen	Lesen	Lesen Aufträge Ein- und Auslieferungen	SiPo1 - Leser Ein-/Auslieferungen
Antragsübernacht-kredit	Schreiben	Erfassung, Freigabe, Löschung Antragsübernacht-kredit	SiPo 1-Erfasser Antragsübernacht-kredit (4-Augen-Prinzip)
Antragsübernacht-kredit	Schreiben	Erfassung, Löschung Antragsübernacht-kredit, automatisierte Freigabe	SiPo 1-Erfasser Antragsübernacht-kredit (2-Augen-Prinzip)
Antragsübernacht-kredit	Lesen	Lesen Aufträge Antragsübernacht-kredit	SiPo 1-Leser Antragsübernacht-kredit

Cash Collateral	Schreiben	Erfassung, Freigabe, Löschung Kontoguthaben	SiPo 1-Erfasser Cash Collateral (4-Augen-Prinzip)
Cash Collateral	Schreiben	Erfassung, Löschung Kontoguthaben, automatisierte Freigabe	SiPo 1-Erfasser Cash Collateral (2-Augen-Prinzip)
Cash Collateral	Lesen	Lesen Aufträge Kontoguthaben	SiPo 1-Leser Cash Collateral
Depotübertrag	Schreiben	Erfassung, Freigabe, Löschung Depotübertrag	SiPo 1-Erfasser Depotübertrag (4-Augen-Prinzip)
Depotübertrag	Schreiben	Erfassung, Löschung Depotübertrag, automatisierte Freigabe	SiPo 1-Erfasser Depotübertrag (2-Augen-Prinzip)
Depotübertrag	Lesen	Lesen Aufträge Depotübertrag	SiPo 1-Leser Depotübertrag

## Sicherheitenpool 2- BBk-Eigengeschäfte

<b>Funktion</b>	<b>Berechtig</b> <b>ung</b>	<b>Beschreibung</b>	<b>Name der Rolle in CAP</b>
Sicherheitenkonto	Lesen	Lesender Zugriff auf alle Funktionen im Menüpunkt „Auswertungen“ inkl. den Unterfunktionen (Dispositionsdepotbestände. Termineinlagenbestände etc.); bedeutet nicht: lesender Zugriff auf Menüpunkt „Aufträge“	SiPo 2 – Auswerter Sicherheitenkonto
Ein-/ Auslieferungen	Schreiben	Erfassung, Freigabe, Löschung Ein- und Auslieferungen	SiPo 2 – Erfasser Ein-/Auslieferungen (4-Augen-Prinzip)
Ein-/ Auslieferungen	Schreiben	Erfassung, Löschung Ein- und Auslieferungen automatisierte Freigabe	SiPo 2 – Erfasser Ein-/ Auslieferungen (2-Augen-Prinzip)
Ein- und Auslieferungen	Lesen	Lesen Aufträge Ein- und Auslieferungen	SiPo 2 – Leser Ein-/Auslieferungen
Cash Collateral	Schreiben	Erfassung, Freigabe, Löschung Kontoguthaben	SiPo 2 – Erfasser Cash Collateral (4-Augen-Prinzip)
Cash Collateral	Schreiben	Erfassung, Löschung Kontoguthaben, automatisierte Freigabe	SiPo 2 – Erfasser Cash Collateral (2-Augen-Prinzip)
Cash Collateral	Lesen	Lesen Aufträge Kontoguthaben	SiPo 2 – Leser Cash Collateral

### Sicherheitenpool 3 – Zusatz-Sicherheitenkonto

<b>Funktion</b>	<b>Berechtig</b> <b>ung</b>	<b>Beschreibung</b>	<b>Name der Rolle in CAP</b>
Sicherheitenkonto	Lesen	Lesender Zugriff auf alle Funktionen im Menüpunkt „Auswertungen“ inkl. den Unterfunktionen (Dispositionsdepotbestände. Termineinlagenbestände etc.); bedeutet nicht: lesender Zugriff auf Menüpunkt „Aufträge“	SiPo3 - Auswerter Sicherheitenkonto
Ein-/Auslieferungen	Schreiben	Erfassung, Freigabe, Löschung Ein- und Auslieferungen	SiPo3 -Erfasser Ein-/Auslieferungen (4-Augen-Prinzip)
Ein-/Auslieferungen	Schreiben	Erfassung, Löschung Ein- und Auslieferungen automatisierte Freigabe	SiPo3 - Erfasser Ein-/Auslieferungen (2-Augen-Prinzip)
Ein-/Auslieferungen	Lesen	Lesen Aufträge Ein- und Auslieferungen	SiPo3 – Leser Ein-/Auslieferungen
Depotübertrag	Schreiben	Erfassung, Freigabe, Löschung Depotübertrag	SiPo 3-Erfasser Depotübertrag (4-Augen-Prinzip)
Depotübertrag	Schreiben	Erfassung, Löschung Depotübertrag, automatisierte Freigabe	SiPo 3-Erfasser Depotübertrag (2-Augen-Prinzip)
Depotübertrag	Lesen	Lesen Aufträge Depotübertrag	SiPo 3-Leser Depotübertrag

## Annex

### I. BIC-Adressen der Korrespondenzzentralbanken für die MT 540/MT 542 – Nachrichten im CCBM Verfahren

List of BIC codes to be used in Repetitive Mandatory Sequence C – Financial Instrument/Account

Field 94 A:SAFE („Place of safekeeping) Option B: SHHE//

Country	Central Bank	BIC Code
Austria	Österreichische Nationalbank	NABAATWWCCB
Belgium	Banque Nationale de Belgique	ECMSBEBBCCB
Croatia	Hrvatska narodna banka	NBHRHR2XCCB
Cyprus	Central Bank of Cyprus	CBCYCY2NCCB
Finland	Suomen Pankki	SPFBFIHHCCB
France	Banque de France	BDFEFR2LCCB
Greece	Bank of Greece	BNGRGRAACCB
Ireland	Central Bank of Ireland	IRCEIE2DCCB
Italy	Banca d'Italia	BITAITRRCCB
Latvia	Latvijas Banka	LACBLV2XCCB
Lithuania	Lietuvos bankas	LIABLT2XCCB
Luxembourg	Banque Centrale du Luxembourg	BCLXLULLCCB
Malta	Central Bank of Malta	MALMTMTCCB
The Netherlands	De Nederlandsche Bank	ECMSNL2ACCB
Portugal	Banco de Portugal	BGALPTPLCCB
Slovakia	Národná banka Slovenska	NBSBSKBXCCB
Slovenia	Banka Slovenije	BSLJSI2XCCB
Spain	Banco de Espana	ESPBESMMCCB

BIC-Adressen für „Place of Settlement“ (MT 540/MT 542-Nachrichten im CCBM-Verfahren)

List of BIC codes to be used in Repetitive Mandatory Subsequence E1 – Settlement Parties  
Field 95 P: PSET („Place of settlement“):

<b>Country</b>	<b>SSS Names</b>	<b>BIC Code</b>
Austria	OEKB OeKB CSD GmbH	OCSDATWWXXX
Belgium	Euroclear Bank	MGTCBEBEECL
	NBB Clearing	NBBEBEBB216
Croatia	Croatian Central Securities Depository (SKDD)	SDAHR22XXX
Cyprus	Central Depository and Central Registry of Securities (CDCR)	XCYSCY2N
Estonia	Estonian Central Securities Depository (EVK)	ECSDEE2X
Finland	Euroclear Finland	APKEFIHHATP
France	Euroclear France	SICVFRPPXXX
Greece	BOGS	BNGRGRAASSS
Ireland	Euroclear Bank	MGTCBEBEECL
Italy	Monte Titoli	MOTIITMMXXX
Latvia	Latvian Central Depository (LCD)	LCDELV22
Lithuania	Central Securities Depository of Lithuania	CSDLLT22
Luxembourg	Clearstream Luxembourg	CEDELULL
	LuxCSD	LUXCLULLXXX
Malta	Central Securities Depository	XMALMTMT
Netherlands	Euroclear Netherlands	NECINL2A
Portugal	Interbolsa	IBLSPTPPXXX
Slovakia	Centralny depozitar cennych papierov SR (CDSR)	CSDSSKBAXXX
Slovenia	Centralna Klirinsko Depotna Druzba d.d. (KDD)	KDDSSI22
Spain	Iberclear	IBRCESMM

## II. Glossar

A2A	Application-to-application: Hauseigene Software-Anwendung des Geschäftspartner kommuniziert mit dem Sicherheitenmanagement-System der Bundesbank direkt oder über ExtraNet
BIC	Business Identifier Code
CAP	Collateralmanagement Access Portal
CBF	Clearstream Banking Frankfurt
CBL	Clearstream Banking Luxembourg
CCBM	Correspondent Central Banking Model: Verfahren zur Nutzung ausländischer marktfähiger Sicherheiten unter Einbeziehung einer Heimat- und einer Korrespondenzzentralbank
CP	Connected Payment
EADB	Eligible Assets Database
ExtraNet	E-Business-Plattform der Deutschen Bundesbank
EZB	Europäische Zentralbank
HCB	Home Central Bank: Heimatzentralbank im CCBM-Verfahren
MACCs	Mobilisation und Administration of Credit Claims: bundesbankeigenes System zur Einreichung und Verwaltung von Kreditforderungen
MCA	Main Cash Account im zentralen Liquiditätsmodul in TARGET-BBk (CLM)
Eligible Link	Nutzung marktfähiger Sicherheiten mittels Verbindungen zwischen Wertpapierabwicklungssystemen (SSS-Links)
RP	Regular Payment
Sicherheitenkonto	Kontomäßige Gegenüberstellung des bewerteten Sicherheitenbestandes auf der einen Seite mit den Kreditinanspruchnahmen und des freien Beleihungswertes (Saldogröße) auf der anderen Seite



SWIFT	Society of Worldwide Interbank Financial Telecommunication: Internationale Genossenschaft der Geldinstitute, die ein Telekommunikationsnetz (SWIFT-Netz) für den Nachrichtenaustausch zwischen den Mitgliedern betreibt.
TARGET	TARGET umfasst Zahlungsverkehrssysteme in Euro, über die eine Abwicklung in Zentralbankgeld erfolgt und die zentrale Liquiditätsmanagementdienste, Echtzeit-Brutto-Abwicklung von Zahlungen sowie Dienste für die Nebensystem-Abwicklung zur Verfügung stellen und die geldliche Verrechnung im Zusammenhang mit der Wertpapierabwicklung und der Abwicklung von Instant Payments ermöglichen.
TARGET-BBk	Das von der Deutschen Bundesbank betriebene TARGET-Komponentensystem.
TARGET Services	TARGET Services sind eine Reihe von Dienstleistungen, die vom Eurosystem entwickelt und betrieben werden. Zu diesen Finanzmarktinfrastrukturdienstleistungen zählen TARGET (zur Abwicklung von Zahlungen), T2S (zur Abwicklung von Wertpapieren), TIPS (ein Dienst für Instant-Zahlungen) und ECMS (ein Dienst für das Sicherheitenmanagement).
TPA	Triparty Agent
TPCMS	Triparty Collateral Management System
U2A	User-to application: Benutzer erteilt manuell Aufträge über die vom Sicherheitenmanagement-System der Bundesbank bereitgestellte Eingabemaske
XML	„Extensible Markup Language“: Auszeichnungssprache um Datenstrukturen zu speichern, zu bearbeiten und auszuwerten