Schnittstellenbeschreibung für den Zugang zum Sicherheitenmanagement-System der Deutschen Bundesbank

Version 21.0

Inhalt

1 ALLGEMEINES 4

1.1 EINLEITUNG 4

1.2 ZWECK DES DOKUMENTS 4

1.3 TECHNISCHE SPEZIFIKATION 5

1.4 ZUGANG ZU DEN POSTFÄCHERN FÜR PDF-DOKUMENTE 7

1.5 ZUGANG ZUR BENUTZEROBERFLÄCHE „COLLATERALMANAGEMENT ACCESS PORTAL“ (CAP) 7

2 SICHERHEITENPOOL (SICHERHEITENKONTO) 8

2.1 ABFRAGE DES SICHERHEITENPOOL (SICHERHEITENKONTO 2 UND 5) 9

2.1.1 ABFRAGE DES SICHERHEITENKONTOS A2A 9

2.1.1.1 ABFRAGE PER SWIFT MT 298 10

2.1.1.2 STATUSMELDUNG MT 298 12

2.1.2 ABFRAGE DER SICHERHEITENPOOLS U2A 14

2.2 SONSTIGE SICHERHEITENPOOLS (ZUSÄTZLICHE SICHERHEITENKONTEN) 15

2.3 ZWEITES SICHERHEITENKONTO – BESICHERUNG BBK-EIGENGESCHÄFTE 17

3 FORMEN DER AUFTRAGSERTEILUNG IM RAHMEN DER NUTZUNG VON SICHERHEITEN 20

3.1 KONTOGUTHABEN (CASH COLLATERAL) 20

3.1.1 KONTOGUTHABEN VIA SWIFT 20

3.1.1.1 EIN- UND AUSLIEFERUNG VON KONTOGUTHABEN MT 598 21

3.1.1.2 EIN- UND AUSLIEFERUNG VON KONTOGUTHABEN - STATUSMELDUNG MT 598 24

3.1.2 KONTOGUTHABEN VIA EXTRANET CAP 27

3.2 MARKTFÄHIGE SICHERHEITEN – TEILMENGE DER EADB 29

3.2.1 HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA SWIFT 30

3.2.1.1 HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA SWIFT DOMESTIC 30

3.2.1.1.1 EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 540 DOMESTIC 30

3.2.1.1.2 STORNO EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 540 DOMESTIC 33

3.2.1.1.3 BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 544 DOMESTIC 33

3.2.1.1.4 STORNO BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 544 DOMESTIC 36

3.2.1.1.5 AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 542 DOMESTIC 36

3.2.1.1.6 STORNO AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 542 DOMESTIC 39

3.2.1.1.7 BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 546 DOMESTIC 40

3.2.1.1.8 STORNO BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 546 DOMESTIC 43

3.2.1.2 HEIMISCHE NUTZUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN VIA SWIFT NACHRICHT IM LINK-VERFAHREN 44

3.2.1.2.1 EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 540 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM EUROPE AG 44

3.2.1.2.2 STORNO EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 540 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM EUROPE AG 48

3.2.1.2.3 BESTÄTIGUNG EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 544 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM EUROPE AG 49

3.2.1.2.4 STORNO EINLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 544 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM EUROPE AG 53

3.2.1.2.5 AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 542 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM EUROPE 54

3.2.1.2.6 STORNO AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 542 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM EUROPE AG 57

3.2.1.2.7 BESTÄTIGUNG AUSLIEFERUNG MARKTFÄHIGER SICHERHEITEN MT 546 IM LINK-VERFAHREN ÜBER CLEARSTREAM EUROPE AG 58

3.2.1.2.8 Storno Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 im Link-Verfahren über Clearstream Europe AG 62
3.2.2 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via ExtraNet CAP 63
4 Mitteilungen 69
4.1 Sicherheitenkonto-Mitteilung via ExtraNet-Postfach 70
4.2 Bestandsmitteilung Sicherheitenkonto 71
4.3 Bestandsaufstellung Dispositionsdepot 72
4.3.1 Bestandsaufstellung Dispositionsdepot via SWIFT MT 535 73
4.3.2 Bestandsaufstellung Dispositionsdepot via ExtraNet CAP 78
5 Rollenkonzept CAP 79
Glossar 81

Annex

I. Glossar

1 Allgemeines

1.1 Einleitung

Seit der Einführung des ECMS am 16. Juni 2025 ist die Verwaltung der notenbankfähigen Sicherheiten für geldpolitische Kreditgeschäfte des Eurosystems sowie für den TARGET-Contingency-Fall auf einer zentralen technischen Plattform integriert. Über ein einziges Gateway über alle Zentralbanken hinweg greifen die geldpolitischen Geschäftspartner auf das ECMS zu und profitieren von einem einfacheren und effizienteren Verfahren zur grenzüberschreitenden Mobilisierung von Sicherheiten für geldpolitische Kreditgeschäfte. Im Rahmen des Sicherheitenmanagements stellt die Deutsche Bundesbank den Geschäftspartnern nach Betriebsaufnahme des ECMS zwei weitere Sicherheitenpools (Sicherheitenkonten) außerhalb des ECMS zur Verfügung.

1.2 Zweck des Dokuments

Dieses Dokument beschreibt somit **nur** die Schnittstelle, die von Geschäftspartnern im Rahmen des Sicherheitenmanagements für alle nicht-geldpolitischen Sicherheitenpools[1] (alias Sicherheitenkonten) gegenüber der Deutschen Bundesbank zu nutzen sind. Es umfasst die A2A-Nutzung („application-to-application"), die sowohl über SWIFT und die MTs stattfinden kann. Auch die U2A-Nutzung („user-to-application"), die 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. Das Verfahren für die Einreichung und Verwaltung von nicht-marktfähigen Sicherheiten (Mobilisation and Administration of Credit Claims - MACCs) ist nicht Gegenstand dieses Dokuments.

[1] Siehe Punkt 2.

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 das Collateral Management Access Portal (CAP). 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 E-Mailverfahren zur Übermittlung von Aufträgen an die Bundesbank zur Anwendung. Dieses Verfahren setzt zwingend die vorherige Rücksprache mit der Bundesbank (Sicherheitenbelieferung ZA 3, Tel.: +49 (0)69 2388 2662, E-Mail: ZA3-Sicherheitenbelieferung@bundesbank.de) voraus.

Für die Nutzung der A2A-Anbindung, bei der Nachrichten im SWIFT-Format 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. Nähere Informationen dazu sind auf der Homepage der Deutschen Bundesbank unter

Service -> Banken und Unternehmen -> Collateralmanagement (Access Portal (CAP) -> Betriebs- und Supportzeiten eingestellt.

1.4 Zugang zu den Postfächern für PDF-Dokumente

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.

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

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 Sicherheitenpool (Sicherheitenkonto)

Im Sicherheitenpool 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 diese Schnittstellenbeschreibung nur für die nicht-geldpolitischen Sicherheitenkonten wie z. B. für das Sicherheitenkonto für die Besicherung von Bundesbankeigengeschäften, wie den Zentralbankservice (Sicherheitenkonto BBk-Eigengeschäfte) Anwendung findet. Im Folgenden wird der Begriff „Sicherheitenkonto“ synonym „Sicherheitenpool“ genutzt, da dieser von der Anwendung CAP verwendet wird.

Nummer	Typ	Funktion	Abwicklung über CEU-Konto
2	Sicherheitenkonto BBk-Eigengeschäfte	Besicherung von Bundesbankeigengeschäften, wie z. B. Zentralbankservice	CEU-Konto 7110 (BIC: MARKDEFFERM)
5	Sicherheitenkonto Einlagensicherung	Besicherung von Zahlungsversprechen gem. gesonderter Vereinbarung	CEU-Konto 8069 (BIC: MARKDEFFEIS)

2.1 Abfrage des Sicherheitenpool (Sicherheitenkonto 2 und 5)

2.1.1 Abfrage des Sicherheitenkontos A2A

Geschäftspartner, die den Kommunikationskanal A2A SWIFT nutzen, können auf diesem Wege Informationen zum Sicherheitenpool abrufen. Die Möglichkeit zur Abfrage besteht zwischen 6:40 und 17:45 Uhr, zusätzlich in der Regel zwischen 19:00 und 19:30 Uhr. 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 Sicherheitenpools wird durch ein SWIFT MT 298 seitens des Geschäftspartners initiiert, daraufhin wird ebenfalls ein SWIFT MT 298 an den Geschäftspartner gesendet, dass die Summe der einzelnen Sicherheitenarten und Arten der Inanspruchnahme sowie Angaben zum freien Beleihungswert beinhaltet.

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

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

					sender to send the messages on its behalf. In case of option R, the proprietary code must be in the MFI format. Moreover the data source scheme code shall be always EMFI. 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.
M	97A	SAFE	Safekeeping Account		:4!c//35x Contains the Sicherheitenkontonummer in local CMS
M	98A	VALU	Value Date		:4!c//8!n The value date of the safekeeping

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

2.1.1.2 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

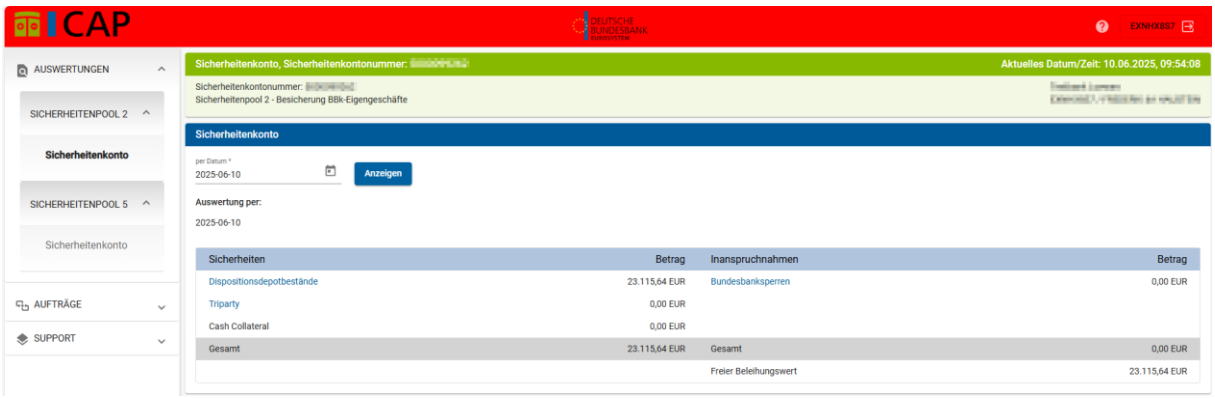
M	16R	STAT			
M	25D	IPRC	Status		:IPRC//<status code> Qualifier = IPRC (Instruction process status) Status Code= REJT (Instruction has been rejected for further processing)

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 der Sicherheitenpools U2A

Beispiel: Abfrage des Sicherheitenpools über ExtraNet CAP



Über den Kalenderbutton erfolgt die Eingabe bzw. die Auswahl des Datums für die Abfrage der Daten der Sicherheitenpools 2 und 5. 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 Sonstige Sicherheitenpools (zusätzliche Sicherheitenkonten)

Die Deutsche Bundesbank bietet außerhalb des ECMS die Führung weiterer Sicherheitenkonten[2] für Zwecke außerhalb der Geldpolitik an.
Alle Sicherheitenkonten unterscheiden sich, 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
Für das zweite Sicherheitenkonto besteht ein Rollenkonzept (siehe Abschnitt 5). Es stehen die bereits etablierten Kommunikationskanäle zur Verfügung.

So kann die Sicherheitenpoolabfrage ebenso U2A über CAP oder A2A per SWIFT erfolgen.

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



Da das geldpolitische Sicherheitenkonto im ECMS geführt wird, können über CAP keine direkten Umbuchungen zwischen zwei Wertpapierdepots eines Geschäftspartners vorgenommen werden. Umbuchungen sind jeweils im ECMS bzw. in CAP zu instruieren.

[2] In der Anwendung CAP werden diese mit dem Begriff „Sicherheitenpool“ bezeichnet.

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



2.3 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 Bundesbanksperre 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 Sicherheitenkonto 2, 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.

Zugelassene Wertpapiere im Wertpapierdepot (Depotart –070)

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

Die zugelassenen Wertpapiere dürfen nur über Clearstream Europe AG und über vom Eurosystem genehmigte direkte und indirekte Links zwischen Clearstream Europe AG und anderen

(internationalen) Zentralverwahren eingeliefert werden (assessed Eurosystem direct Links/relayed Links).

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 Sicherheitenkonto 2 ist Cash Collateral auf eine Höhe von 250 Mio. € beschränkt.

Für die Nutzung von Cash Collateral ist ein primäres 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.

Für das Sicherheitenkonto 2 gilt: 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 auf Initiative des Geschäftspartners ist geschäftstäglich innerhalb 7:00-16:00 Uhr möglich.

Cash Collateral wird nicht verzinst. Beträgt die jeweils aktuelle Short-Term-Rate (€STR) für die geldpolitische Einlagefazilität weniger als 0,20% p. a., erhebt die Bank auf das Guthaben ein Entgelt in Höhe der jeweils aktuellen €STR abzüglich 20 Basispunkten. Vom Einlagenkreditinstitut zu entrichtende Entgelte werden am ersten TARGET-Geschäftstag des Folgemonats einem vom Einlagenkreditinstitut zu benennenden MCA-Konto des Einlagenkreditinstituts oder eines Verrechnungsinstituts belastet.

3 Formen der Auftragserteilung im Rahmen der Nutzung von Sicherheiten

3.1 Kontoguthaben (Cash Collateral)

Geschäftspartner haben die Möglichkeit, Kontoguthaben (Cash Collateral) als kurzfristige Sicherheit zur Besicherung von Eigengeschäften der Bank zum Ausgleich einer Unterdeckung bis zu einer Höhe von 250 Mio. EUR zu verwenden. Die Mobilisierung von Kontoguthaben erfolgt mittels SWIFT-Nachricht MT 598 sowie über ExtraNet CAP durch den Geschäftspartner.

Bei Einreichung via SWIFT informiert die Bundesbank über den Eingang der Kontoguthaben-Instruktion anhand der Statusmeldung MT 598 (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 (Status-Code „REJT“). Wurde die Instruktion erfolgreich verarbeitet, wird in der Statusmeldung MT 598 der Status-Code „CONF“ angezeigt.

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 auf Initiative des Geschäftspartners ist geschäftstäglich innerhalb 7:00-16:00 Uhr möglich.

3.1.1 Kontoguthaben via SWIFT

3.1.1.1 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.

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 „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. Technical sender (e.g. BIC) can differentiate from the

					counterparty, if the counterparty authorizes the sender to send the messages on its behalf. 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 (Eurosytem's MFI). 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 (e.g. MEOR//EMFI/SI123456789).
M	97A	SAFE	Account	Option A	:4!c//35x Contains the counterparties safekeeping account number at Deutsche Bundesbank (Sicherheitenkonto)
M	98A	VALU	Value Date	Option A	:4!c//8!n :VALU//YYYYMMDD This field specifies the value date of the mobilization/demobilization of cash as collateral
M	19A	DELT	Sign, Currency Code, Amount		:4!c//[N]3!a15d :DELT//The amount of cash as collateral (delta amount) DELT: identification of a delta amount (positive or negative amounts are possible, e.g. 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 mandatory and is included in the maximum length. The number of digits following the comma must not exceed 2.
M	16S	CASH			

3.1.1.2 Ein- und Auslieferung von Kontoguthaben - Statusmeldung MT 598

Die Deutsche Bundesbank versendet die Statusmeldung Kontoguthaben (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 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

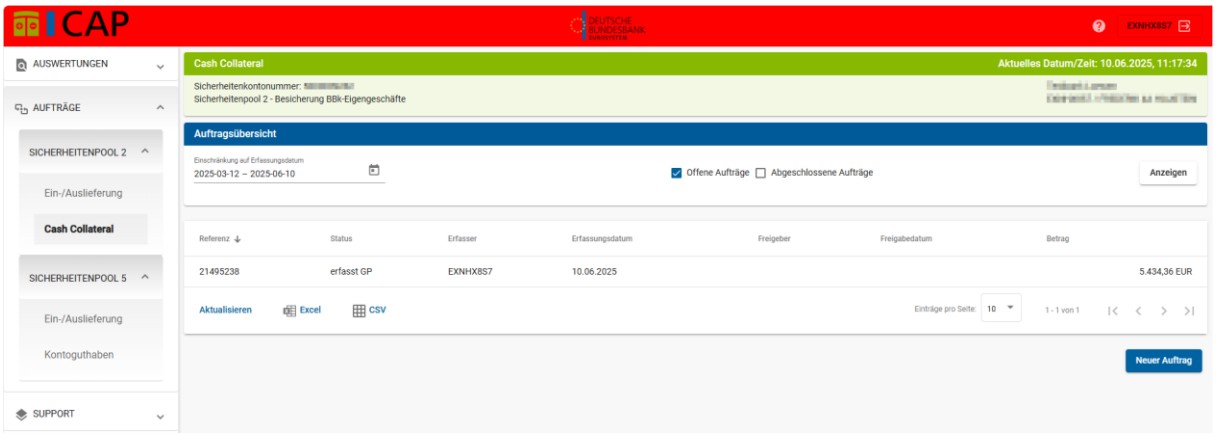
M	25D	IPRC	Instruction Process Status	Option D	:4!c/[8c]/4!c „IPRC“// Status code Status code= PACK (Instruction has been acknowledged/accepted for further processing) or CONF (Instruction has been successfully processed) REJT (Instruction has been rejected for further processing)

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 safekeeping account) DDAT (Unrecognised or invalid settlement date) LATE (Instruction was received after market deadline) SYNT (Syntax error) NARR (see narrative field of reason)
O	70D	REAS	Narrative		:4!c//6*35x „REAS“// Additional unstructured information
M	16S				REAS
M	16S				STAT
M	16S				GENL

3.1.2 Kontoguthaben via ExtraNet CAP

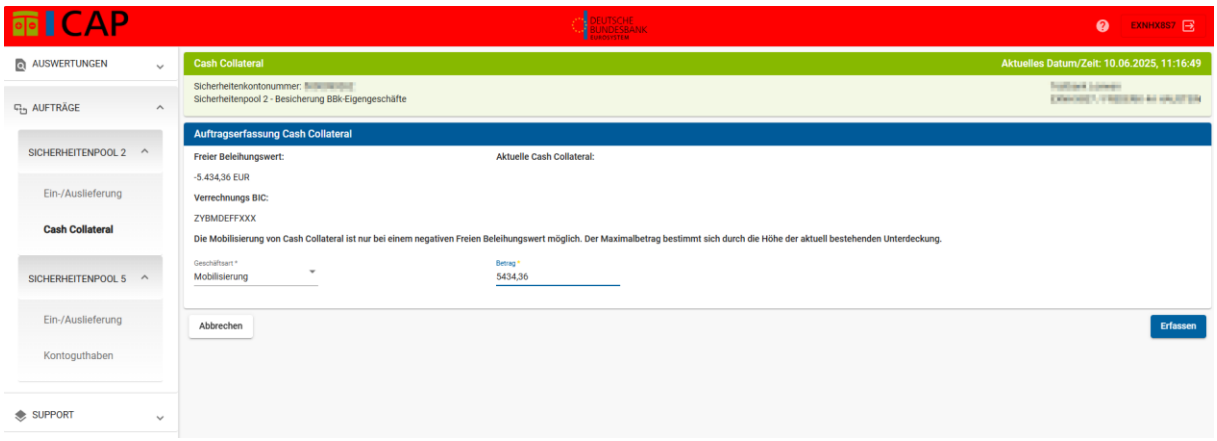
Beispiel: Auftragsübersicht Kontoguthaben



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 Kalendertag eingeblendet. Es kann auch eine Auswahl getroffen werden, ob offene und/oder abgeschlossene Aufträge eingesehen werden möchten.

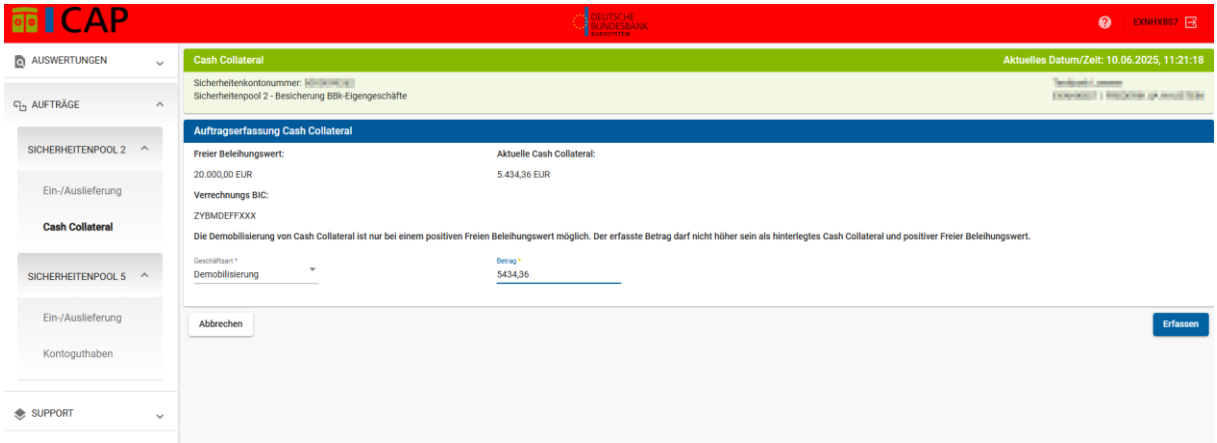
Das Aufrufen der Auftragserfassung des Kontoguthabens erfolgt über den „Neuer Auftrag“ Button.

Beispiel: Auftragserfassung Einlieferung (Mobilisierung) von Kontoguthaben



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.



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

3.2 Marktfähige Sicherheiten – Teilmenge der EADB

Die Einreichung zugelassener marktfähiger Wertpapiere bei der Deutschen Bundesbank ist lediglich über die hierfür eingerichtete Lagerstelle möglich. Eine 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 Europe AG) CEU zu übertragen. In dieser Schnittstellenbeschreibung wird das Link-Verfahren dem Abschnitt „heimischen Nutzung marktfähiger Sicherheiten“ zugeordnet.

Die Auftragserteilung einer Sicherheiteneinlieferung kann mittels ExtraNet CAP oder SWIFT MT 540/ erfolgen. Die Sicherheitenauslieferung einer markfähigen Sicherheit kann ebenfalls über ExtraNet CAP oder SWIFT MT 542 instruiert werden. Die erfolgreiche Ein-/Ausbuchung wird per SWIFT MT 544 bzw. SWIFT MT 546 bestätigt.

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 ZA 3, Tel.: +49 (0)69 2388 2662, E-Mail: ZA3-Sicherheitenbelieferung@bundesbank.de) in Verbindung zu setzen.

Parallel zur Übermittlung des entsprechenden Auftrags an die Bundesbank (vgl. nachfolgende Abschnitte) hat der Geschäftspartner über seine Depotbank eine entsprechende Lieferinstruktion gegen, dass das relevante Konto der Bundesbank bei Clearstream Europe AG (CEU) zu beauftragen:

- **7110 (MARKDEFFERM), für BBk-Eigengeschäfte („Siko2“)**
- **8069 (MARKDEFFEIS), für Einlagensicherungszwecke („Siko5“).**

3.2.1 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via SWIFT

3.2.1.1 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via SWIFT domestic

3.2.1.1.1 Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 540 domestic

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”/DAKVDEFFXXX (BIC code of Clearstream Europe AG)
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”

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 CEU 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 Europe AG
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET

M=Mandatory O=Optional

3.2.1.1.2 Storno Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 540 domestic

Die Storno-Nachricht für die heimische Einlieferung einer marktfähigen Sicherheit entspricht der in Kapitel 3.2.1.1.1 dargestellten Nachricht zur Einlieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

3.2.1.1.3 Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 544 domestic

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 (Disposi-tionsdepotnummer)
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 in-structing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

M	16R			Start of Block	SETPRTY
M	95a	DEAG	Party	Option P or R	For CEU participants: Option R: 4!c/8c/34x; DEAG//DAKV/XXXX For Euroclear and Clear-stream Banking Luxemburg participants: Option P: 4!c//4!a2!a2!c[3!c]; DEAG//MGTCBEBEECL re-spectively 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 set-tlement Clearstream Europe AG
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET

M=Mandatory O=Optional

3.2.1.1.4 Storno Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 544 domestic

Die Storno-Nachricht für die Bestätigung der Einlieferung einer heimischen marktfähigen Sicherheit entspricht der in Kapitel 3.2.1.1.3 dargestellten Nachricht zur Bestätigung der Einlieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

3.2.1.1.5 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	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 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/DAKVDEFFXXX BIC code Clearstream Europe AG.
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 CEU 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 Europe AG.
M	16S			End of Block	SETPRTY

End of Mandatory Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of Block	SETDET

M=Mandatory O=Optional

3.2.1.1.6 Storno Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 542 domestic

Die Storno-Nachricht für die Auslieferung einer heimischen marktfähigen Sicherheit entspricht der in Kapitel 3.2.1.1.5 dargestellten Nachricht zur Auslieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

3.2.1.1.7 Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 domestic

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 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	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"//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 CEU 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

3.2.1.1.8 Storno Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 domestic

Die Storno-Nachricht für die Bestätigung der Auslieferung einer heimischen marktfähigen Sicherheit entspricht der in Kapitel 3.2.1.1.7dargestellten Nachricht zur Bestätigung der Auslieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

3.2.1.2 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.

3.2.1.2.1 Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 540 im Link-Verfahren über Clearstream Europe AG

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"/DAKVDEFFXXX BIC code Clearstream Europe AG.
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

3.2.1.2.2 Storno Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 540 im Link-Verfahren über Clearstream Europe AG

Die Storno-Nachricht für die Einlieferung einer marktfähigen Sicherheit im Link-Verfahren entspricht der in Kapitel 3.2.1.2.1 dargestellten Nachricht zur Einlieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

3.2.1.2.3 Bestätigung Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 544 im Link-Verfahren über Clearstream Europe AG

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
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	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 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 CEU 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

3.2.1.2.4 Storno Einlieferung marktfähiger Sicherheiten MT 544 im Link-Verfahren über Clearstream Europe AG

Die Storno-Nachricht für die Einlieferung einer marktfähigen Sicherheit im Link-Verfahren entspricht der in Kapitel 3.2.1.2.3 dargestellten Nachricht zur Einlieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

3.2.1.2.5 Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 542 im Link-Verfahren über Clearstream Europe

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	TRADDET

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

3.2.1.2.6 Storno Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 542 im Link-Verfahren über Clearstream Europe AG

Die Storno-Nachricht für die Auslieferung einer marktfähigen Sicherheit im Link-Verfahren entspricht der in Kapitel 3.2.1.2.5 dargestellten Nachricht zur Auslieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

3.2.1.2.7 Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 im Link-Verfahren über Clearstream Europe AG

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	TRADDET

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 instructing party
M	16S			End of Block	SETPRTY

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

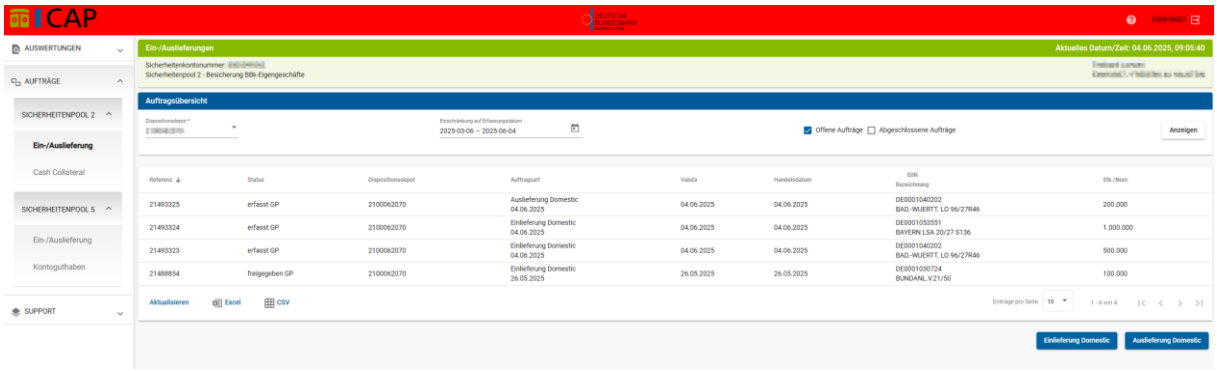
M=Mandatory O=Optional

3.2.1.2.8 Storno Bestätigung Auslieferung marktfähiger Sicherheiten MT 546 im Link-Verfahren über Clearstream Europe AG

Die Storno-Nachricht für die Auslieferung einer marktfähigen Sicherheit im Link-Verfahren entspricht der in Kapitel 3.2.1.2.7 dargestellten Nachricht zur Auslieferung. In Mandatory Sequence A - General Information Feld 23G wird der Code CANC genutzt.

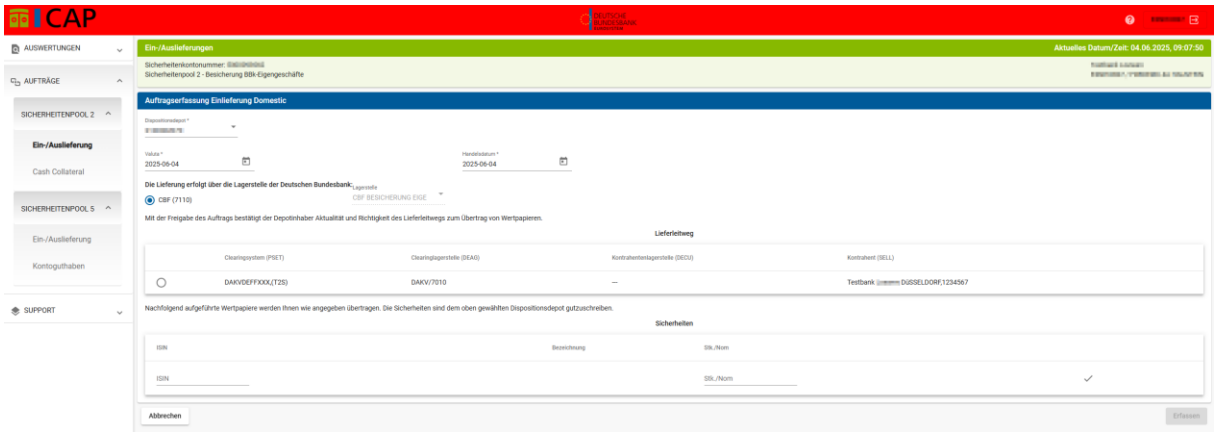
3.2.2 Heimische Nutzung marktfähiger Sicherheiten via ExtraNet CAP

Beispiel: Auswahlmaske Aufträge Ein-/Auslieferungen



Auswahlmöglichkeit der Ein- und Auslieferungsaufträge:
Einlieferung Domestic
Auslieferung Domestic

Beispiel: Auftragserfassung Einlieferung Domestic



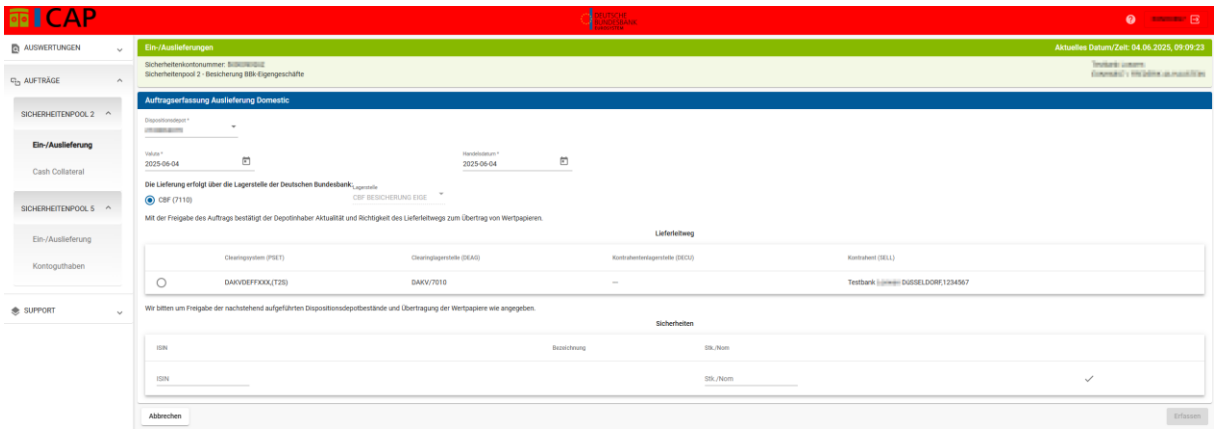
Der Geschäftspartner hat die Möglichkeit über diese Maske die Lagerstelle für die Sicherheiteneinlieferung CEU (7110) zu wählen.

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 (Sicherheitenbelieferung ZA 3, Tel.: +49 (0)69 2388 2662,
E-Mail: ZA3-Sicherheitenbelieferung@bundesbank.de) aufzunehmen.

Beispiel: Auftragserfassung Auslieferung Domestic



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

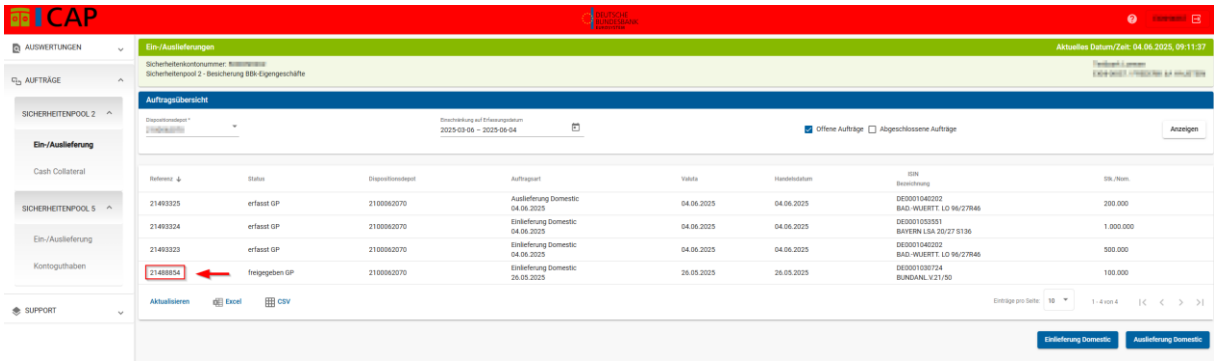
Der Geschäftspartner muss den kundenspezifischen Lieferleitweg auswählen, indem er den Radio Button zu Beginn der gewünschten Zeile in der Tabelle „Lieferleitweg“ aktiviert.

Für die Aktualität dieser Lieferleitwege ist der Geschäftspartner verantwortlich. Änderungen können dem Sicherheitenbelieferung während der Geschäftszeiten per Mail an ZA3-.Sicherheitenbelieferung@bundesbank.de mitgeteilt werden.
Diese Tabelle wird erst mit Auswahl der Lagerstelle eingeblendet.

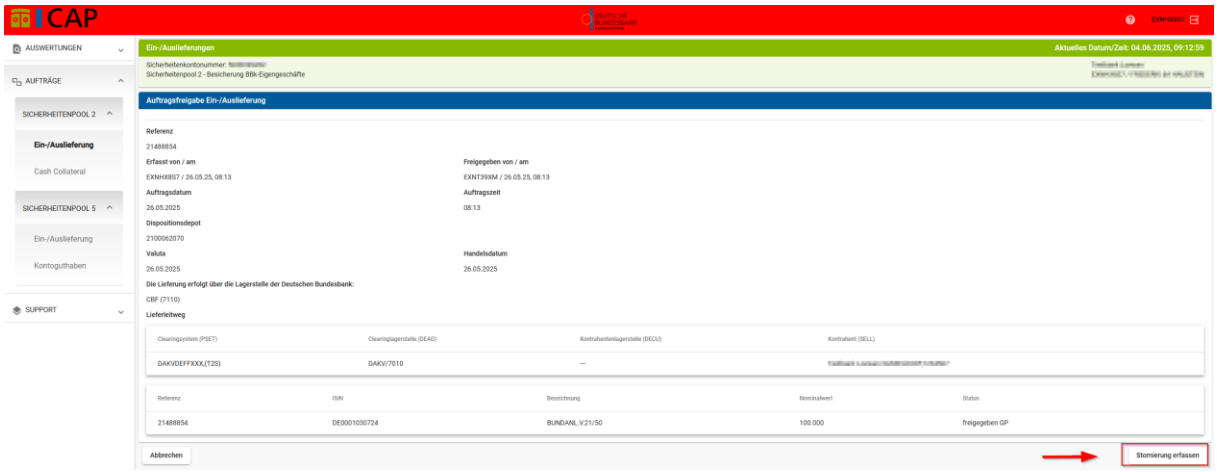
Sofern für die ausgewählte Lagerstelle kein Lieferleitweg hinterlegt sein sollte, ist die Erfassung des Auftrags nicht möglich. In diesem Fall ist Kontakt mit der zuständigen Stelle im Hause der Deutschen Bundesbank (Sicherheitenbelieferung ZA 3, Tel.: +49 (0)69 2388 2662, E-Mail: ZA3-Sicherheitenbelieferung@bundesbank.de) aufzunehmen.

Beispiel: Erfassung Storno-Auftrag

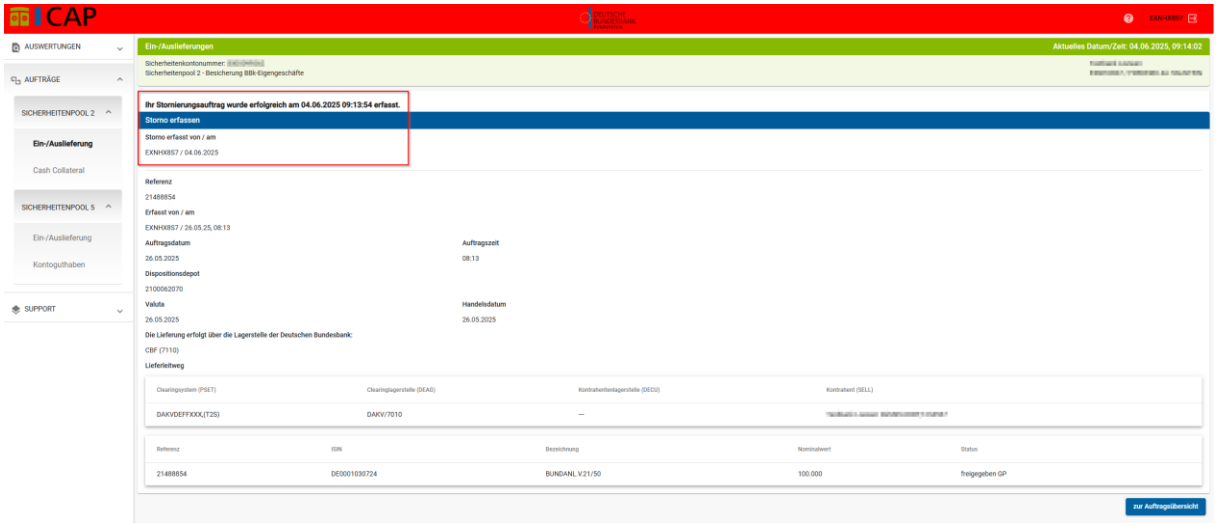
Erfassung des Auftrags nach dem Vier-Augen-Prinzip



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



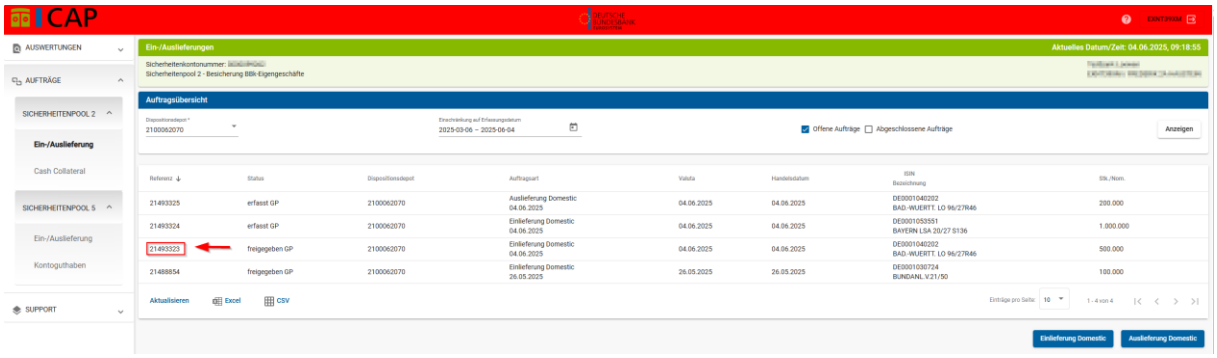
Nach der Auswahl der Referenznummer verzweigt CAP daraufhin in die Detailansicht des Auftrags, in der sich nun der Button zur Storno-Erfassung befindet.



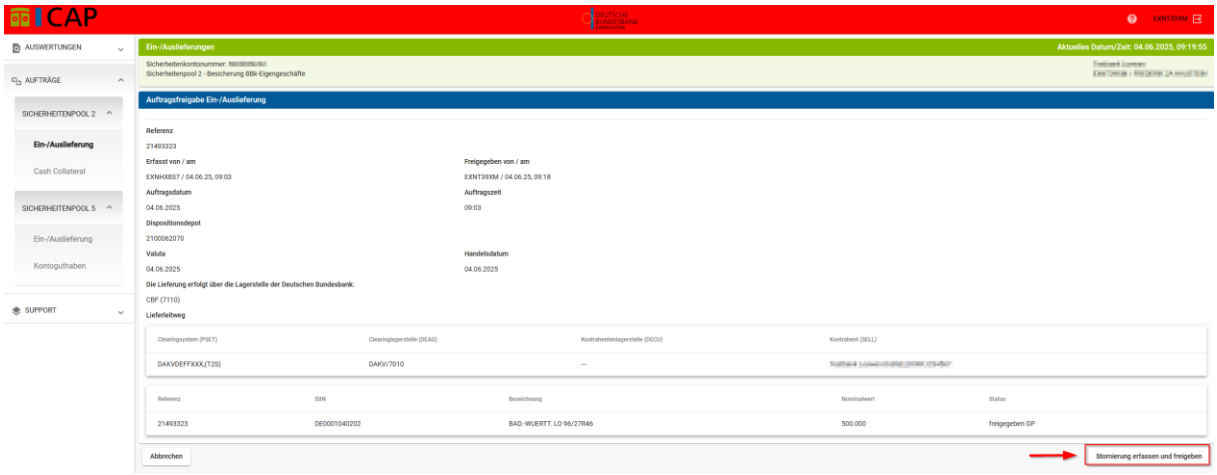
Nach der erfolgreichen Erfassung des Stornos, kann der Geschäftspartner diesen Auftrag durch einen zweiten User freigeben oder, falls der Storno Auftrag nicht mehr gewünscht wird auch wieder löschen.

Sollten bei einer Stornierung in CAP Probleme auftreten, ist das Sicherheitenbelieferung zu kontaktieren (Tel.: +49 (0)69 2388 2662,
E-Mail: ZA3-Sicherheitenbelieferung@bundesbank.de).

Erfassung des Auftrages nach dem Zwei-Augen-Prinzip:



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.



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 Sicherheitenmanagement-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 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 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.

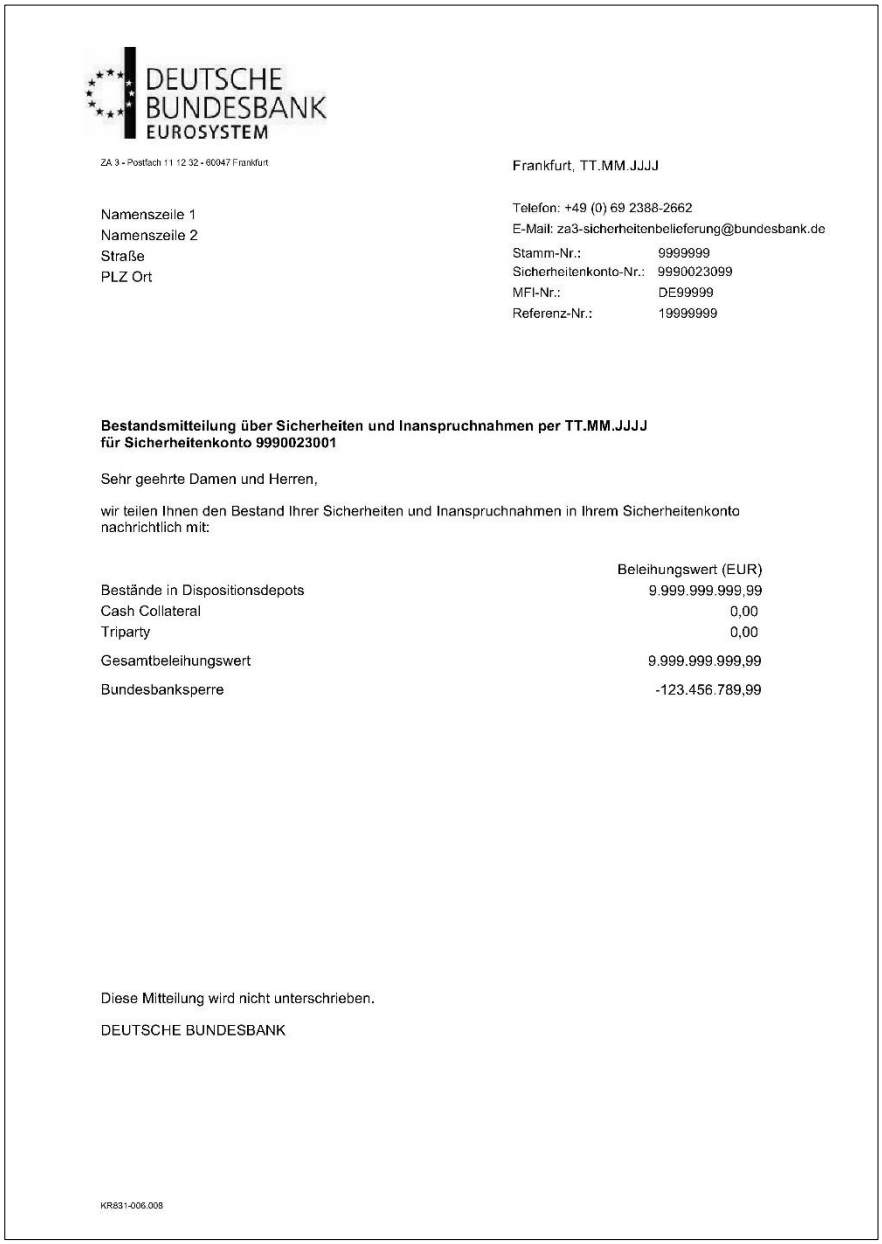
Der Zugang zum ExtraNet-Postfach ist Gegenstand von Abschnitt 1.4 dieser Schnittstellenbeschreibung.

4.1 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) und den Gesamtbeleihungswert.

4.2 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.



DEUTSCHE BUNDESBANK
EUROSYSTEM

ZA 3 - Postfach 11 12 32 - 60047 Frankfurt

Namenszeile 1
Namenszeile 2
Straße
PLZ Ort

Frankfurt, TT.MM.JJJJ

Telefon: +49 (0) 69 2388-2662
E-Mail: za3-sicherheitenbelieferung@bundesbank.de
Stamm-Nr.: 9999999
Sicherheitenkonto-Nr.: 9990023099
MFI-Nr.: DE99999
Referenz-Nr.: 19999999

Bestandsmitteilung über Sicherheiten und Inanspruchnahmen per TT.MM.JJJJ
für Sicherheitenkonto 9990023001

Sehr geehrte Damen und Herren,

wir teilen Ihnen den Bestand Ihrer Sicherheiten und Inanspruchnahmen in Ihrem Sicherheitenkonto nachrichtlich mit:

	Beleihungswert (EUR)
Bestände in Dispositionsdepots	9.999.999.999,99
Cash Collateral	0,00
Triparty	0,00
Gesamtbeleihungswert	9.999.999.999,99
Bundesbanksperre	-123.456.789,99

Diese Mitteilung wird nicht unterschrieben.

DEUTSCHE BUNDESBANK

KR831-006.008

4.3 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 auch als PDF-Datei im ExtraNet-Postfach erhältlich.

4.3.1 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	CODE	Indicator	Complete/Updates Indicator	:4!c/[8c]/4!c “CODE”//<Indicator code> Indicator code : “COMP” (Statement gives complete information)
M	22F	STTY	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	STBA	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	SAFE	Account	Option A	:4!c//35x “SAFE”//Account number of “Dispositionsdepot”
M	17B	ACTI	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	CONS	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) Indentifier 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

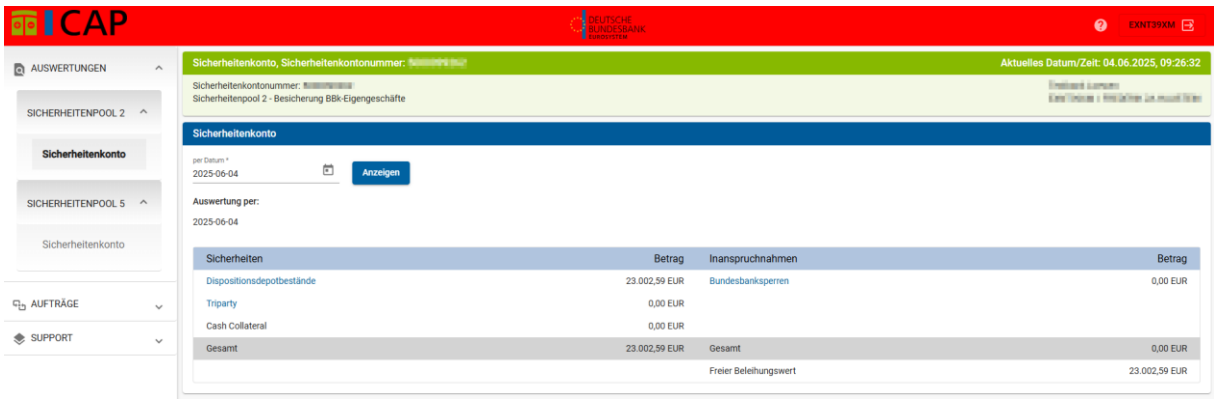
End of Sequence B Sub-safekeeping account

M	16R			End of Block	SUBSAFE

M=Mandatory O=Optional

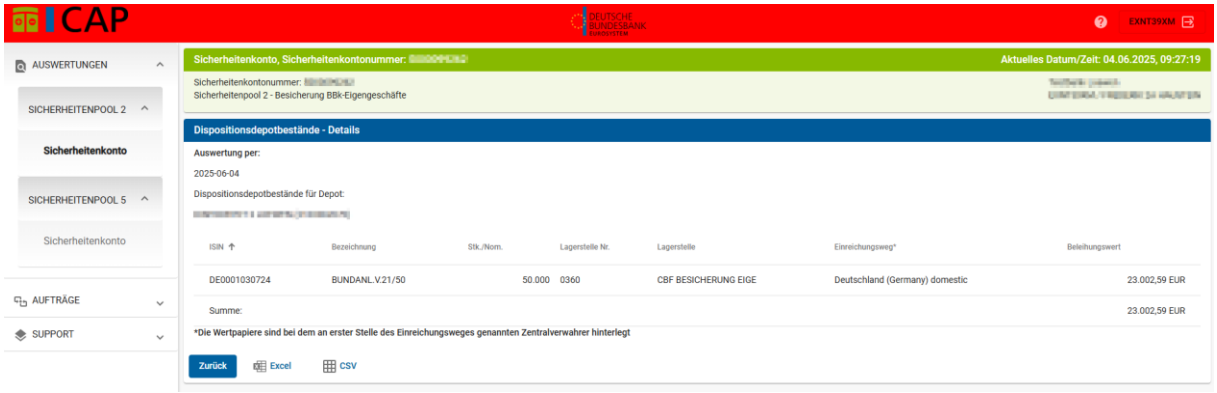
4.3.2 Bestandsaufstellung Dispositionsdepot via ExtraNet CAP

Ansicht des Sicherheitenkontos:



Verzweigung durch Klick auf Dispositionsdepotbestände

Ansicht Dispositionsdepotbestände:



5 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 2- BBk-Eigengeschäfte

Funktion	Berechtigung	Beschreibung	Name der Rolle in CAP
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-Prizip)
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

Für ggf. bestehende SiPo5-Berechtigungen gelten vorstehende Ausführungen entsprechend.

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
CEU	Clearstream Europe AG
EADB	Eligible Assets Database
ExtraNet	E-Business-Plattform der Deutschen Bundesbank
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)
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 Nachrichtentausch 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 Ver-

	rechnung 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).
U2A	User-to application: Benutzer erteilt manuell Aufträge über die vom Sicherheitenmanagement-System der Bundesbank bereitgestellte Eingabemaske