



Transaction
Management unter T2S
SWIFT ISO
15022 Beispiele

Version 1.4 / Public / Juni 2019

Inhaltsverzeichnis

1. Einleitung	3
1.1 Ziel des Dokuments.....	3
1.2 Inhalt und Aufbau des Dokuments.....	3
2. Market Claims.....	4
2.1 Market Claim – Beispiel Cash Dividende	4
2.1.1 Underlying Settlement Instruction MT543 Delivery vs. Payment	4
2.1.2 MT548 Settlement Status and Processing Advice	5
2.1.3 MT544-547 Settlement Confirmation.....	6
2.1.4 MT566 Corporate Action Confirmation.....	8
2.2 Market Claim – Beispiel Ausschüttung in Stücke.....	11
2.2.1 Underlying Settlement Instruction MT543 Delivery vs. Payment	11
2.2.2 MT548 Settlement Status and Processing Advice	12
2.2.3 MT544-547 Settlement Confirmation.....	14
2.3 Reverse Claim – Beispiel Cash Dividende	15
2.3.1 Underlying Settlement Instruction MT541 Receive vs. Payment	16
2.3.2 MT548 Settlement Status and Processing Advice	16
2.3.3 MT544-547 Settlement Confirmation.....	17
2.3.4 MT566 Corporate Action Confirmation.....	19
3. Transformations.....	22
3.1 Transformation – Beispiel Exchange Offer (EXOF).....	22
3.1.1 Underlying Settlement Instruction MT540 Receive Free	22
3.1.2 MT548 Status Nachricht zum Storno der Underlying Settlement Instruction.....	23
3.1.3 MT548 Status Nachricht zur Transformation Instruction.....	24
3.1.4 MT544-547 Settlement Confirmation.....	25
3.2 Transformation – Beispiel Spitzenbehandlung.....	26
3.2.1 Underlying Settlement Instruction MT541 Receive vs. Payment	27
3.2.2 MT548 Status Nachricht zum Storno der Underlying Settlement Instruction	27
3.2.3 MT548 Status Nachricht zur Transformation Instruction.....	28
3.2.4 MT544-547 Settlement Confirmation: MT545 Receive vs. Payment	31
3.2.5 MT544-547 Settlement Confirmation: MT545 Payment Free of Receive Credit.....	32

1. Einleitung

1.1 Ziel des Dokuments

In diesem Dokument finden sich Fallbeispiele von SWIFT Nachrichten laut ISO15022, die im Rahmen der Prozesse des Transaction Management unter T2S am Österreichischen Kapitalmarkt von der OeKB CSD erstellt werden.

Diese Fallbeispiele referenzieren auf das Dokument Transaction Management mit T2S, das den Leitfaden zur Anwendung der T2S Standards für den österreichischen Kapitalmarkt darstellt.

1.2 Inhalt und Aufbau des Dokuments

Dieses Dokument beinhaltet Beispiele von SWIFT Nachrichten für die Prozesse der Market Claims und Transformations.

In Kapitel 2 werden die SWIFT Nachrichten zu Market Claims/Reverse Claims dargestellt.

Für Claims aus Cash-Distributions werden von der OeKB CSD folgende SWIFT Nachrichten übermittelt:

- MT548 Settlement Status and Processing Advice
- MT545 oder M547 Settlement Confirmation
- MT566 Corporate Action Confirmation

Für Claims aus Stücke-Distributions werden von der OeKB CSD folgende SWIFT Nachrichten übermittelt:

- MT548 Settlement Status and Processing Advice
- MT544 oder M546 Settlement Confirmation

In Kapitel 3 werden die SWIFT Nachrichten zu Transformations dargestellt.

Für Transformations werden von der OeKB CSD folgende SWIFT Nachrichten übermittelt:

- MT548 Settlement Status and Processing Advice
- MT544, MT545, MT546 oder MT547 Settlement Confirmation

2. Market Claims

2.1 Market Claim – Beispiel Cash Dividende

Trade Date vor Ex-Tag / offene Settlementstransaktion am Record Date

Die Instruction Owner CSD ermittelt am Record Date EOD die offenen Settlementinstruktionen und generiert für anspruchsberechtigte Transaktionen entsprechende Market Claim Instructions. Am Trade-Date wurde das Geschäft „Cum-Dividende“ abgeschlossen. Offene Ansprüche sind in diesem Fall „vom Verkäufer zum Käufer“ zu übertragen.

Die Market Claim Instructions werden als sese.023 Nachrichten an T2S weitergeleitet.

Fallbeispiel DVCA

Ex-Tag	21.03.2016
Record Date	22.03.2016
Payment Date	24.03.2016

Underlying Settlement Instruction

Trade Date	17.03.2016
Intended Settlement Date	21.03.2016

Market Claim Instruction

Trade Date	17.03.2016
Intended Settlement Date	24.03.2016
Effective Settlement Date	30.03.2016

2.1.1 Underlying Settlement Instruction MT543 Delivery vs. Payment

Die OeKB CSD erhält eine MT543 Settlement Nachricht von einem Kunden.

```
:16R:GENL
:20C::SEME//272883
:23G:NEWM
:16S:GENL
:16R:TRADDET
:98A::SETT//20160321
:98A::TRAD//20160317
:35B:ISIN AT0000741053
EVN AKT O.N.
:16S:TRADDET
:16R:FIAC
:36B::SETT//UNIT/300,
```

```

:97A::SAFE//OCSD567800
:16S:FIAC
:16R:SETDET
:22F::SETR//TRAD
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::REAG//BKAUATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:AMT
:19A::SETT//EUR3450,
:16S:AMT
:16S:SETDET

```

2.1.2 MT548 Settlement Status and Processing Advice

Von der OeKB CSD wird eine MT548 Settlement Status Nachricht an die Kunden - über das Erstellen und Versenden jener Market Claim Instructions, die zuvor als sese.023 Nachrichten an das T2S System übermittelt wurden, verschickt.

Im diesem Beispiel der SWIFT MT548 Settlement Status Nachricht sind sowohl PartyHold und CSDHold gesetzt. Nach Aufheben des CSDHold durch die CSD bzw. nach Aufheben des Party Holds durch den CSD Teilnehmer erfolgt jeweils eine nochmalige Information in Form einer weiteren SWIFT MT548 Settlement Status Nachricht über den aktualisierten Status.

Referenzfelder im Linkage Block:

- **RELA**: Dieses Feld enthält „NONREF“, wenn eine Instruktion für ein berechtigtes Depot erstellt wird.
- **PCTI**: Dieses Feld enthält die Referenz des von OeKB CSD generierten Market Claims
Diese ist im Falle einer Stornierung oder einer Änderung der Instruktion zu verwenden.
- **PREV**: Dieses Feld enthält die Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruktion.
- **MITI**: Eindeutige T2S Referenz der Market Claim Instruktion
- **CORP**: Referenz der Corporate Action

Beispiel MT548

```

:16R:GENL
:20C::SEME//OCSD101100156701
:23G:INST
:98C::PREP//20160324184500
:16R:LINK
:20C::RELA//NONREF
:16S:LINK
:16R:LINK

```

:20C::PCTI//CS160324101	Referenz des von OeKB CSD erstellten Market Claims
:16S:LINK	
:16R:LINK	
:20C::PREV//272883	Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction
:16S:LINK	
:16R:LINK	
:20C::MITI//1905171339612455	T2S Referenz der Market Claim Instruktion
:16S:LINK	
:16R:LINK	
:20C::CORP//DVCA00005575	Referenz der Corporate Action
:16S:LINK	
:16R:STAT	
:25D::IPRC//PACK	
:16S:STAT	
:16S:GENL	
:16R:SETTRAN	
:35B:ISIN AT0000741053	
:36B::SETT//UNIT/0,	
:19A::SETT//EUR91,35	
:97A::SAFE//OCSD567800	
:22F::SETR//CLAI	
:22F::STCO//NPAR	
:22H::REDE//DELI	
:22H::PAYM//APMT	
:98A::TRAD//20160317	
:98A::SETT//20160324	
:16R:SETPRTY	
:95P::PSET//OCSDATWWXXX	
:16S:SETPRTY	
:16R:SETPRTY	
:95P::REAG//BKAUATWWXXX	
:16S:SETPRTY	
:16S:SETTRAN	

2.1.3 MT544-547 Settlement Confirmation

Von der OeKB CSD wird nach dem Zeitpunkt der Ausführung der Market Claim Instruction eine SWIFT MT544-547 Settlement Confirmation Nachricht an die Kunden verschickt.

Referenzfelder im Linkage Block:

- **RELA:** Dieses Feld enthält „NONREF“, wenn eine Instruktion für ein berechtigtes Depot erstellt wird.
- **PCTI:** Dieses Feld enthält die Referenz des von OeKB CSD generierten Market Claims.
- **PREV:** Dieses Feld enthält die Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction

- **MITI**: Eindeutige Transaktionsreferenz des Market Claim von T2S
- **CORP**: Referenz der Corporate Action

Market Claims spezifische Daten in der Mandatory Sequence E Settlement Details der Nachricht:

- :22F: - Type of Settlement Transaction
- **CLAI**: Zeigt an, dass die Instruktion aus einem Market Claim oder Reverse Claim resultiert.

Daten in der Mandatory Sequence C Financial Instrument/Account der Nachricht:

- :36B: - Quantity of Financial Instrument Settled
- **ESTT**: Die tatsächlich abgewickelte Wertpapiermenge.
Bei PFD (Payment free of Delivery) Instruktionen ist dieses Feld = 0.

Beispiel MT547

```

:16R:GENL
:20C::SEME//OCSD102023456815
:23G:NEWM
:98C::PREP//20160330151014
:16R:LINK
:20C::RELA//NONREF
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PCTI//CS160324101 Referenz des von OeKB CSD erstellten Market Claims
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PREV//272883 Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::MITI//1905171339612455 T2S Referenz der Market Claim Instruction
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::CORP//DVCA00005575 Referenz der Corporate Action
:16S:LINK
:16S:GENL
:16R:TRADDET
:98A::TRAD//20160317
:98A::SETT//20160324
:98C::ESET//20160330152141
:35B:ISIN AT0000741053
:22F::PRIR//0004
:16S:TRADDET
:16R:FIAC
:36B::ESTT//UNIT/0,

```

:97A::SAFE//OCSD567800
:97A::CASH//CATEUR01234567890
:16S:FIAC
:16R:SETDET
:22F::SETR//CLAI
:22F::STCO//NPAR
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::REAG//BKAUATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:AMT
:19A::ESTT//EUR91,35
:16S:AMT
:16S:SETDET

2.1.4 MT566 Corporate Action Confirmation

Von der OeKB CSD werden nach Ausführung der Market Claim Instruction (MT544-547) SWIFT MT566 Corporate Action Confirmation Nachrichten an die Kunden übermittelt.

Referenzfelder im Linkage Block:

- **PREV:** Dieses Feld enthält die Referenz der Underlying MT564 REPE.
- **RELA:** Dieses Feld enthält die Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction.

Market Claims spezifische Daten in der Optional Sequence C Corporate Action Details:

- :22F: ADDB-Indicator: Additional Business Process Indicator
- **CLAI:** falls die Corporate Action Confirmation aus einem Market Claim/Reverse Claim resultiert.

Market Claims abhängige Daten in der Mandatory Sequence B Underlying Securities:

- :93B: - CONB – Confirmed Balance
- **UNIT** oder **FAMT:** negatives Vorzeichen (N) in der Nachricht an den Verkäufer des Trades

Trade Market Claim:

Buyer (OCSD123456) 300 Units
Seller (OCSD567800) -300 Units
Market Claim: from the Seller to the Buyer

Trade Date 17.03.2016; Effective Settlement Date 30.03.2016

Ex-Tag 21.03.2016
 Record Date 22.03.2016
 Payment Date 24.03.2016

Market Claim Kriterien: Trade-Date < Ex-Date & Effective Settlement Date > Record-Date

Beispiel MT566 CLAI Seller (Debit)

:16R:GENL
 :20C::CORP//DVCA00005575
 :20C::SEME//CS2996333
 :23G:NEWM
 :22F::CAEV//DVCA
 :98C::PREP//20160330184609
 :16R:LINK
 :13A::LINK//564
 :20C::PREV//CS2992381 Referenz der Underlying MT564 REPE
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::RELA//272883 Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction
 :16S:LINK
 :16S:GENL
 :16R:USECU
 :97A::SAFE//OCSD567800
 :35B:ISIN AT0000741053
 EVN AKT O.N.
 :93B::CONB//UNIT/N300, SELLER OF TRADE, daher N
 :16S:USECU
 :16R:CADETL
 :98A::XDTE//20160321
 :98A::RDTE//20160322
 :22F::ADDB//CLAI
 :16S:CADETL
 :16R:CACONF
 :13A::CAON//001
 :22F::CAOP//CASH
 :16R:CASHMOVE
 :22H::CRDB//DEBT SELLER (DEBT) to BUYER
 :97A::CASH//CATEUR01234567890
 :19B::PSTA//EUR91,35
 :19B::GRSS//EUR126,
 :19B::NETT//EUR91,35
 :19B::TAXR//EUR34,65
 :98A::POST//20160330
 :98A::VALU//20160330

:98A::PAYD//20160324
:92F::GRSS//EUR0,42
:92A::TAXR//27,5
:16S:CASHMOVE
:16S:CACONF
:16R:ADDINFO
:70E::ADTX//Compensation payment for OTC instruction with trade date 17/03/2016.
:16S:ADDINFO

Beispiel MT566 CLAI Buyer (Credit)

:16R:GENL
:20C::CORP//DVCA00005575
:20C::SEME//CS3605110
:23G:NEWM
:22F::CAEV//DVCA
:98C::PREP//20160330184610

:16R:LINK
:13A::LINK//564
:20C::PREV//CS2582180
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::RELA//272993

Referenz der Underlying MT564 REPE

Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction

:16S:LINK
:16S:GENL
:16R:USECU
:97A::SAFE//OCSD123456
:35B:ISIN AT0000741053
EVN AKT O.N.
:93B::CONB//UNIT/300,
:16S:USECU
:16R:CADETL
:98A::XDTE//20160321
:98A::RDTE//20160322
:22F::ADDB//CLAI
:16S:CADETL
:16R:CACONF
:13A::CAON//001
:22F::CAOP//CASH
:16R:CASHMOVE
:22H::CRDB//CRED
:97A::CASH//CATEUR09876543210
:19B::PSTA//EUR91,35
:19B::GRSS//EUR126,

SELLER to BUYER (CRED)

:19B::NETT//EUR91,35
 :19B::TAXR//EUR34,65
 :98A::POST//20160330
 :98A::VALU//20160330
 :98A::PAYD//20160324
 :92F::GRSS//EUR0,42
 :92A::TAXR//27,5
 :16S:CASHMOVE
 :16S:CACONF
 :16R:ADDINFO
 :70E::ADTX//Compensation payment for OTC instruction with trade date 17/03/2016.
 :16S:ADDINFO

2.2 Market Claim – Beispiel Ausschüttung in Stücke

Trade Date vor Ex-Tag / offene Settlementstransaktion am Record Date

Die Instruction Owner CSD ermittelt am Record Date EOD die offenen Settlementinstruktionen und generiert für anspruchsberechtigte Transaktionen entsprechende Market Claim Instructions. Am Trade-Date wurde das Geschäft „Cum-Dividende“ abgeschlossen. Offene Ansprüche sind in diesem Fall „vom Verkäufer zum Käufer“ zu übertragen.

Die Market Claim Instructions werden als sese.023 Nachrichten an T2S weitergeleitet.

Die Market Claim Instructions für Stücke, auf die sich die Statusmeldungen beziehen, sind frei von Zahlung (Free of Payment/FOP). Daher werden als Settlement Confirmations SWIFT MT544 oder MT546 Nachrichten erstellt.

Fallbeispiel RHD

Ex-Tag	30.05.2016
Record Date	31.05.2016
Payment Date	01.06.2016

Underlying Settlement Instruction

Trade Date	27.05.2016
Intended Settlement Date	31.05.2016

Market Claim Instruction

Trade Date	27.05.2016
Intended Settlement Date	01.06.2016
Effective Settlement Date	02.06.2016

2.2.1 Underlying Settlement Instruction MT543 Delivery vs. Payment

Die OeKB CSD erhält eine MT543 Settlement Nachricht von einem Kunden.

:16R:GENL
:20C::SEME//266881
:23G:NEWM
:16S:GENL
:16R:TRADDET
:98A::SETT//20160527
:98A::TRAD//20160531
:35B:ISIN AT0000609607
:16S:TRADDET
:16R:FIAC
:36B::SETT//UNIT/300,
:97A::SAFE//OCSD567800
:16S:FIAC
:16R:SETDET
:22F::SETR//TRAD
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::REAG//BKAUATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:AMT
:19A::SETT//EUR7908,
:16S:AMT
:16S:SETDET

2.2.2 MT548 Settlement Status and Processing Advice

Von der OeKB CSD wird eine MT548 Settlement Status Nachricht an die Kunden - über das Erstellen und Versenden jener Market Claim Instructions, die zuvor als sese.023 Nachrichten an das T2S System übermittelt wurden, verschickt.

Im diesem Beispiel der SWIFT MT548 Settlement Status Nachricht sind sowohl PartyHold und CSDHold gesetzt. Nach Aufheben des CSDHold durch die CSD bzw. nach Aufheben des Party Holds durch den CSD Teilnehmer erfolgt jeweils eine nochmalige Information in Form einer weiteren SWIFT MT548 Settlement Status Nachricht über den aktualisierten Status.

Referenzfelder im Linkage Block:

- **RELA:** Dieses Feld enthält „NONREF“, wenn eine Instruktion für ein berechtigtes Depot erstellt wird.
- **PCTI:** Dieses Feld enthält die Referenz des von OeKB CSD generierten Market Claims. Diese ist im Falle einer Stornierung oder einer Änderung der Instruktion zu verwenden.
- **PREV:** Dieses Feld enthält die Kundenreferenz der Underlying Instruction
- **MITI:** Eindeutige T2S Referenz der Market Claim Instruktion

— **CORP**: Referenz der Corporate Action

Beispiel MT548

```

:16R:GENL
:20C::SEME//OCSD101100154711
:23G:INST
:98C::PREP//20160531184500
:16R:LINK
:20C::RELA//NONREF
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PCTI//CS160324777 Referenz des von OeKB CSD erstellten Market Claims
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PREV//272883 Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::MITI//1905171339612456 T2S Referenz der Market Claim Instruktion
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::CORP//RHD100008817 Referenz der Corporate Action
:16S:LINK
:16R:STAT
:25D::IPRC//PACK
:16S:STAT
:16S:GENL
:16R:SETTRAN
:35B:ISIN AT0000A1L6V3
:36B::SETT//UNIT/300,
:97A::SAFE//OCSD567800
:22F::SETR//CLAI
:22F::STCO//NPAR
:22H::REDE//DELI
:22H::PAYM//FREE
:98A::TRAD//20160527
:98A::SETT//20160601
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::REAG//BKAUATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16S:SETTRAN

```

2.2.3 MT544-547 Settlement Confirmation

Von der OeKB CSD wird nach dem Zeitpunkt der Ausführung der Market Claim Instruction eine SWIFT MT544-547 Settlement Confirmation Nachricht an die Kunden verschickt.

Referenzfelder im Linkage Block:

- **RELA**: Dieses Feld enthält „NONREF“, wenn eine Instruktion für ein berechtigtes Depot erstellt wird.
- **PCTI**: Dieses Feld enthält die Referenz des von OeKB CSD generierten Market Claims.
- **PREV**: Dieses Feld enthält die Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction.
- **MITI**: Eindeutige Transaktionsreferenz des Market Claim von T2S
- **CORP**: Referenz der Corporate Action

Market Claims spezifische Daten in der Mandatory Sequence E Settlement Details der Nachricht:

- :22F: - Type of Settlement Transaction
- **CLAI**: Zeigt an, dass die Instruktion aus einem Market Claim oder Reverse Claim resultiert.

Daten in der Mandatory Sequence C Financial Instrument/Account der Nachricht:

- :36B: - Quantity of Financial Instrument Settled
- **ESTT**: Die tatsächlich abgewickelte Wertpapiermenge.
Bei PFD (Payment free of Delivery) Instruktionen ist dieses Feld = 0.

Beispiel MT546

```
:16R:GENL
:20C::SEME//OCSD102028153456
:23G:NEWM
:98C::PREP//20160702151014
:16R:LINK
:20C::RELA//NONREF
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PCTI//CS160324777           Referenz des von OeKB CSD erstellten Market Claims
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PREV//272883               Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::MITI//1905171339612456     T2S Referenz der Market Claim Instruction
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::CORP//RHD100008817         Referenz der Corporate Action
:16S:LINK
:16S:GENL
```

:16R:TRADDET
 :98A::TRAD//20160527
 :98A::SETT//20160601
 :98C::ESET//20160602152141
 :35B:ISIN AT0000A1L6V3
 :22F::PRIR//0004
 :16S:TRADDET
 :16R:FIAC
 :36B::ESTT//UNIT/300,
 :97A::SAFE//OCSD567800
 :16S:FIAC
 :16R:SETDET
 :22F::SETR//CLAI
 :22F::STCO//NPAR
 :22F::SSBT/RT/AWAS
 :16R:SETPRTY
 :95P::PSET//OCSDATWWXXX
 :16S:SETPRTY
 :16R:SETPRTY
 :95P::REAG//BKAUATWWXXX
 :16S:SETPRTY
 :16S:SETDET

2.3 Reverse Claim – Beispiel Cash Dividende

Trade Date am/nach Ex-Tag / Das Settlement erfolgt vor oder am Record Date

Nach dem Trade-Date wurde das Geschäft „Ex-Dividende“ abgeschlossen. Die Ausführung der Settlement Instruktion erfolgt bereits vor oder am Record Date (verkürzte Settlementperiode). Somit befindet sich die Wertpapierposition bereits am Record Date EOD auf dem Depot des Käufers. Die am Record Date festgestellten Ansprüche sind „vom Käufer zum Verkäufer“ zu korrigieren. Die Instructions Owner CSD erstellt einen Reverse Claim. Bereits ausbezahlte Ausschüttungen sind in diesem Fall „vom Käufer zum Verkäufer“ zurück zu übertragen. (Reverse Claim). Diese werden als sese.023 Nachrichten an T2S weitergeleitet.

Fallbeispiel DVCA

Ex-Tag	27.01.2016
Record Date	28.01.2016
Payment Date	29.01.2016

Underlying Settlement Instruction

Trade Date	27.01.2016
Intended Settlement Date	28.01.2016
Effective Settlement Date	28.01.2016

Reverse Claim Instruction

Trade Date	27.01.2016
Intended Settlement Date	29.01.2016
Effective Settlement Date	29.01.2016

2.3.1 Underlying Settlement Instruction MT541 Receive vs. Payment

Die OeKB CSD erhält eine MT541 Settlement Nachricht von einem Kunden.

```
:16R:GENL
:20C::SEME//1912830020160117
:23G:NEWM
:16S:GENL
:16R:TRADDET
:98A::SETT//20160128
:98A::TRAD//20160127
:35B:ISIN AT0000730007
ANDRITZ AKT.O.N.
:16S:TRADDET
:16R:FIAC
:36B::SETT//UNIT/200,
:97A::SAFE//OCSD567800
:16S:FIAC
:16R:SETDET
:22F::SETR//TRAD
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::DEAG//BKAUATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:AMT
:19A::SETT//EUR8900,
:16S:AMT
:16S:SETDET
```

2.3.2 MT548 Settlement Status and Processing Advice

Von der OeKB CSD wird eine MT548 Settlement Status Nachricht an die Kunden - über das Erstellen und Versenden von Reverse Claim Instructions, die zuvor als sese.023 Nachrichten an das T2S System übermittelt wurden - verschickt.

Beispiel MT548

```
:16R:GENL
:20C::SEME//OCSD123100151612
```


:23G:INST
 :98C::PREP//20160128184500
 :16R:LINK
 :20C::RELA//NONREF
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::PCTI//CS165678910 Referenz des von OeKB CSD erstellten Reverse Claims
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::PREV//1912830020160117 Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::MITI//1905171339612457 T2S Referenz der Claim Instruktion
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::CORP//DVCA00011321 Referenz der Corporate Action
 :16S:LINK
 :16R:STAT
 :25D::IPRC//PACK
 :16S:STAT
 :16S:GENL
 :16R:SETTRAN
 :35B:ISIN AT0000730007
 :36B::SETT//UNIT/0,
 :19A::SETT//EUR219,24
 :97A::SAFE//OCSD567800
 :22F::SETR//CLAI
 :22F::STCO//NPAR
 :22H::REDE//RECE
 :22H::PAYM//APMT
 :98A::TRAD//20160127
 :98A::SETT//20160129
 :16R:SETPRTY
 :95P::PSET//OCSDATWWXXX
 :16S:SETPRTY
 :16R:SETPRTY
 :95P::DEAG//BKAUATWWXXX
 :16S:SETPRTY
 :16S:SETTRAN

2.3.3 MT544-547 Settlement Confirmation

Von der OeKB CSD wird nach dem Zeitpunkt der Ausführung der Reverse Claim Instruction eine SWIFT MT544-547 Settlement Confirmation Nachricht an die Kunden verschickt.

Beispiel MT545

:16R:GENL
:20C::SEME//OCSD102557450123
:23G:NEWM
:98C::PREP//20160129185002
:16R:LINK
:20C::RELA//NONREF
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PCTI//CS165678910
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PREV//1912830020160117
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::MITI//1905171339612457
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::CORP//DVCA00011321
:16S:LINK
:16S:GENL
:16R:TRADDET
:98A::TRAD//20160127
:98A::SETT//20160129
:98C::ESET//20160129152141
:35B:ISIN AT0000730007
:22F::PRIR//0004
:16S:TRADDET
:16R:FIAC
:36B::ESTT//UNIT/0,
:97A::SAFE//OCSD567800
:97E::CASH//CATEUR01234567890
:16S:FIAC
:16R:SETDET
:22F::SETR//CLAI
:22F::STCO//NPAR
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::DEAG//BKAUATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:AMT

Referenz des von OeKB CSD erstellten Claims

Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction

T2S Referenz der Claim Instruktion

Referenz der Corporate Action

:22F::ADDB//CLAI
:16S:CADETL
:16R:CACONF
:13A::CAON//001
:22F::CAOP//CASH
:16R:CASHMOVE
:22H::CRDB//DEBT
:97A::CASH//CATEUR01234567890
:19B::PSTA//EUR219,24
:19B::GRSS//EUR302,4
:19B::NETT//EUR219,24
:19B::TAXR//EUR83,16
:98A::POST//20160129
:98A::VALU//20160129
:98A::PAYD//20160129
:92F::GRSS//EUR1,512
:92A::TAXR//27,5
:16S:CASHMOVE
:16S:CACONF
:16R:ADDINFO
:70E::ADTX//Compensation payment for OTC
Instruction with trade date
27/01/2016.
:16S:ADDINFO

BUYER (DEBT) to SELLER

Beispiel MT566 CLAI Seller (Credit)

:16R:GENL
:20C::CORP//DVCA00011321
:20C::SEME//CS3413472
:23G:NEWM
:22F::CAEV//DVCA
:98C::PREP//20160129183036
:16R:LINK
:13A::LINK//564
:20C::PREV//CS2473331
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::RELA//1912830020160222
:16S:LINK
:16S:GENL
:16R:USECU
:97A::SAFE//OCSD567800
:35B:ISIN AT0000741053

Referenz des Underlying MT564 REPE

Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction

EVN AKT O.N.
:93B::CONB//UNIT/N200, SELLER OF TRADE, daher N
:16S:USECU
:16R:CADETL
:98A::XDTE//20160127
:98A::RDTE//20160128
:22F::ADDB//CLAI
:16S:CADETL
:16R:CACONF
:13A::CAON//001
:22F::CAOP//CASH
:16R:CASHMOVE
:22H::CRDB//CRED BUYER to SELLER (CRED)
:97A::CASH//CATEUR01234567890
:19B::PSTA//EUR219,24
:19B::GRSS//EUR302,4
:19B::NETT//EUR219,24
:19B::TAXR//EUR83,16
:98A::POST//20160129
:98A::VALU//20160129
:98A::PAYD//20160129
:92F::GRSS//EUR1,512
:92A::TAXR//27,5
:16S:CASHMOVE
:16S:CACONF
:16R:ADDINFO
:70E::ADTX//Compensation payment for OTC
instruction with trade date
27/01/2016.
:16S:ADDINFO

3. Transformations

3.1 Transformation – Beispiel Exchange Offer (EXOF)

Trade Date vor Ex-Tag / offene Settlementtransaktion am Record Date

Falls nach der Market Deadline noch offene Transaktionen bestehen, so werden diese entsprechend der Default Option am Record Date EOD transformiert.

Fallbeispiel EXOF

Ex-Tag	25.01.2016
Record Date	26.01.2016

Underlying Settlement Instruction

Trade Date	25.01.2016
Intended Settlement Date	27.01.2016

Transformation Instruction

Trade Date	25.01.2016
Intended Settlement Date	27.01.2016
Effective Settlement Date	27.01.2016

3.1.1 Underlying Settlement Instruction MT540 Receive Free

Beispiel MT540

```
:16R:GENL  
:20C::SEME//123456 Referenz der Kundeninstruktion  
:23G:NEWM  
:16S:GENL  
:16R:TRADDET  
:98A::TRAD//20160125  
:98A::SETT//20160127  
:35B:ISIN AT00000FACC2  
FACC  
:16S:TRADDET  
:16R:FIAC  
:36B::SETT//UNIT/1,  
:97A::SAFE//OCSD231700  
:16S:FIAC  
:16R:SETDET  
:22F::SETR//TRAD
```

```
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::DEAG//RZTIAT22XXX
:16S:SETPRTY
:16S:SETDET
```

3.1.2 MT548 Status Nachricht zum Storno der Underlying Settlement Instruction

Beispiel MT548

```
:16R:GENL
:20C::SEME//OCSD101100156701 Referenz der Storno Instruktion der OeKB CSD
:23G:INST
:98C::PREP//20160126183622
:16R:LINK
:20C::RELA//123456 Kundenreferenz der stornierten Underlying Settlement Instruction
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::MITI//1905230274075671 T2S Referenz der stornierten Instruktion
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::CORP//EXOF00001234
:16S:LINK
:16R:STAT
:25D::IPRC//CAND
:16R:REAS
:24B::CAND//CANT
:70D::REAS//Cancelled due to transformation
:16S:REAS
:16S:STAT
:16S:GENL
:16R:SETTRAN
:35B:ISIN AT00000FACC2
:36B::SETT//UNIT/1,
:97A::SAFE//OCSD231700
:22F::SETR//TRAD
:22F::STCO//TRAN
:22H::REDE//RECE
:22H::PAYM//FREE
:98A::TRAD//20160125
:98A::SETT//20160127
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
```

:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::DEAG//RZTIAT22XXX
:16S:SETPRTY
:16S:SETTRAN

3.1.3 MT548 Status Nachricht zur Transformation Instruction

Referenzfelder im Linkage Block:

- **RELA**: Dieses Feld enthält „NONREF“, wenn eine Instruktion für ein berechtigtes Depot erstellt wird.
- **PCTI**: Dieses Feld enthält die Referenz der von OeKB CSD transformierten Instruktion. Diese ist im Falle einer Stornierung oder einer Änderung der Instruktion zu verwenden.
- **PREV**: Dieses Feld enthält die Kundenreferenz der Underlying Instruction
- **MITI**: Eindeutige T2S Referenz der neu erstellten Instruktion
- **CORP**: Referenz der Corporate Action

Beispiel MT548

16R:GENL
:20C::SEME//123456159
:23G:INST
:98C::PREP//20160126193622
:16R:LINK
:20C::RELA//NONREF
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PCTI//OCSD000000000012 Referenz der von OeKB CSD erstellten Transformation
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PREV//123456 Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruction
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::MITI//1905230274075671 Eindeutige Referenz aus T2S zur neu erstellten Instruktion
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::CORP//EXOF00001234 Corporate Action Event Referenz
:16S:LINK
:16R:STAT
:25D::IPRC//PACK
:16S:STAT
:16R:STAT
:25D::SETT//PEND
:16S:STAT


```

:16S:GENL
:16R:SETTRAN
:35B:ISIN ATNEW00FACC3
:36B::SETT//UNIT/2,
:97A::SAFE//OCSD231700
:22F::SETR//TRAD
:22F::STCO//TRAN
:22H::REDE//RECE
:22H::PAYM//FREE
:98A::TRAD//20160125
:98A::SETT//20160127
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::DEAG//RZTIAT22XXX
:16S:SETPRTY
:16S:SETTRAN

```

3.1.4 MT544-547 Settlement Confirmation

Beispiel MT544 Receive Free Confirmation

```

:16R:GENL
:20C::SEME//123456789
:23G:NEWM
:98C::PREP//20160127120123
:16R:LINK
:20C::RELA//NONREF
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PCTI//OCSD000000000012
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::MITI//1905230274075671
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::CORP// EXOF00001234
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PREV//1905230274070498
:16S:LINK
:16S:GENL
:16R:TRADDET
:98A::TRAD//20160125

```

Referenz der von OeKB CSD erstellten Transformation

:98C::ESET//20160127120120
 :98A::SETT//20160127
 :35B::ISIN ATNEW00FACC3
 :22F::PRIR//0004
 :16S::TRADDET
 :16R::FIAC
 :36B::ESTT//UNIT/2,
 :97A::SAFE//OCSD231700
 :16S::FIAC
 :16R::SETDET
 :22F::SETR//TRAD
 :22F::STCO//TRAN
 :22F::SSBT//RT/AWAS
 :16R::SETPRTY
 :95P::PSET//OCSDATWWXXX
 :16S::SETPRTY
 :16R::SETPRTY
 :95P::DEAG//RZTIAT22XXX
 :16S::SETPRTY
 :16S::SETDET

3.2 Transformation – Beispiel Spitzenbehandlung

Reverse Split (SPLR) als Beispiel für Transformation mit Spitzenausgleich

Transformation

Die Instruction Owner CSD ermittelt am Record Date EOD die offenen anspruchsberechtigten Settlementstransaktionen, storniert diese und führt den Transformation Prozess durch.

Fallbeispiel SPLR

Ex-Tag	01.12.2015
Record Date	02.12.2015
Payment Date	03.12.2015

Underlying Settlement Instruction

Trade Date	30.11.2015
Intended Settlement Date	03.12.2015

Transformation Instruction

Trade Date	30.11.2015
Intended Settlement Date	03.12.2015
Effective Settlement Date	03.12.2015

3.2.1 Underlying Settlement Instruction MT541 Receive vs. Payment

Beispiel MT541

```

:16R:GENL
:20C::SEME//456789                                Referenz der Kundeninstruktion
:23G:NEWM
:16S:GENL
:16R:TRADDET
:98A::TRAD//20151130
:98A::SETT//20151202
:35B:ISIN AT00000FACC2
FACC
:16S:TRADDET
:16R:FIAC
:36B::SETT//UNIT/1,
:97A::SAFE//OCSD231700
:16S:FIAC
:16R:SETDET
:22F::SETR//TRAD
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::DEAG//RZTIAT22XXX
:16S:SETPRTY
:16R:AMT
:19A::SETT//EUR10,
:16S:AMT
:16S:SETDET

```

3.2.2 MT548 Status Nachricht zum Storno der Underlying Settlement Instruction

```

:16R:GENL
:20C::SEME//1234567890
:23G:INST
:98C::PREP//20160120083622
:16R:LINK
:20C::RELA//456789                                Kundenreferenz der stornierten Instruction
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::MITI//1905230274075672                    eindeutige Referenz aus T2S der stornierten Instruction
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::CORP//SPLR00001234

```

:16S:LINK
 :16R:STAT
 :25D::IPRC//CAND
 :16R:REAS
 :24B::CAND//CANT
 :70D::REAS//Cancelled due to transformation
 :16S:REAS
 :16S:STAT
 :16S:GENL
 :16R:SETTRAN
 :35B:ISIN AT00000FACC2
 :36B::SETT//UNIT/1,
 :19A::SETT//EUR10,
 :97A::SAFE//OCSD231700
 :22F::SETR//TRAD
 :22F::STCO//TRAN
 :22H::REDE//RECE
 :22H::PAYM//APMT
 :98A::TRAD//20151130
 :98A::SETT//20151203
 :16R:SETPRTY
 :95P::PSET//OCSDATWWXXX
 :16S:SETPRTY
 :16R:SETPRTY
 :95P::DEAG//RZTIAT22XXX
 :16S:SETPRTY
 :16S:SETTRAN

3.2.3 MT548 Status Nachricht zur Transformation Instruction

Referenzfelder im Linkage Block:

- **RELA**: Dieses Feld enthält die Referenz „NONREF“, wenn eine Instruktion für ein berechtigtes Depot erstellt wird.
- **PCTI**: Dieses Feld enthält die Referenz der von OeKB CSD transformierten Instruktion Diese ist im Falle einer Stornierung oder einer Änderung der Instruktion zu verwenden.
- **PREV**: Dieses Feld enthält die Kundenreferenz der Underlying Settlement Instruktion
- **MITI**: Eindeutige T2S Referenz der neu erstellten Instruktion
- **CORP**: Referenz der Corporate Action

Beispiel MT548

:16R:GENL
 :20C::SEME//1011001568
 :23G:INST

:98C::PREP//20160120083622
 :16R:LINK
 :20C::RELA//NONREF
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::PCTI//OCSD000000000001 [Referenz der von OeKB CSD erstellten Transformation Instruction](#)
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::PREV//456789 [Kundenreferenz der transformierten Underlying Settlement Instruction](#)
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::MITI// 1905230274075672 [Eindeutige Referenz aus T2S der Transformation Instruction](#)
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::CORP//SPLR00001234 [Corporate Action Event Referenz](#)
 :16S:LINK
 :16R:STAT
 :25D::SETT//PEND
 :16R:REAS
 :24B::PEND//FUTU
 :16S:REAS
 :16S:STAT
 :16S:GENL
 :16R:SETTRAN
 :35B:ISIN ATNEW00FACC3
 :36B::SETT//UNIT/2,
 :19A::SETT//EUR9,
 :97A::SAFE// OCSD231700
 :22F::SETR//TRAD
 :22F::STCO//TRAN
 :22F::STCO//NPAR
 :22H::REDE//RECE
 :22H::PAYM//APMT
 :98A::TRAD//20151130
 :98A::SETT//20151203
 :16R:SETPRTY
 :95P::PSET//OCSDATWWXXX
 :16S:SETPRTY
 :16R:SETPRTY
 :95P::DEAG//RZTIAT22XXX
 :16S:SETPRTY
 :16S:SETTRAN

Beispiel MT548 Payment Free of Receive Credit Instruction

Im Falle, dass der Emittent einen Spitzenausgleich in Cash vorsieht, wird zusätzlich zur Transformierten Instruction eine Payment Free of delivery Instruction erstellt.

:16R:GENL
:20C::SEME//1018605985
:23G:INST
:98C::PREP//20160518134500
:16R:LINK
:20C::RELA//NONREF
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PCTI//OCSD000000000002 [Referenz der OeKB CSD erstellten Transformation Instruction](#)
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PREV//456789 [Kundenreferenz der transformierten Underlying Instruktion](#)
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::MITI//1905230274071212 [Eindeutige Referenz aus T2S der Transformation Instruction](#)
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::CORP//SPLR00001234 [Corporate Action Event Referenz](#)
:16S:LINK
:16R:STAT
:25D::SETT//PEND
:16R:REAS
:24B::PEND//FUTU
:16S:REAS
:16S:STAT
:16S:GENL
:16R:SETTRAN
:35B:ISIN AT00000FACC2
:36B::SETT//UNIT/0,
:19A::SETT//NEUR1,
:97A::SAFE//OCSD231700
:22F::SETR//TRAD
:22F::STCO//PART
:22H::REDE//RECE
:22H::PAYM//APMT
:98A::TRAD//20151130
:98A::SETT//20150303
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX

:16S:SETPRTY
 :16R:SETPRTY
 :95P::DEAG//RZTIAT22XXX
 :16S:SETPRTY
 :16S:SETTRAN

3.2.4 MT544-547 Settlement Confirmation: MT545 Receive vs. Payment

Beispiel MT545 – Receive against Payment Confirmation

:16R:GENL
 :20C::SEME//123456789
 :23G:NEWM
 :98C::PREP//20160127120123
 :16R:LINK
 :20C::RELA//NONREF
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::PCTI//OCSD000000000001 [Referenz der von OeKB CSD erstellten Transformation Instruction](#)
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::MITI//1905230274075672 [Eindeutige Referenz aus T2S der Transformation Instruction](#)
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::CORP//SPLR00001234
 :16S:LINK
 :16R:LINK
 :20C::PREV//11905230274070499
 :16S:LINK
 :16S:GENL
 :16R:TRADDET
 :98A::TRAD//20151130
 :98C::ESET//20151203120120
 :98A::SETT//20151203
 :35B:ISIN ATNEW00FACC3
 :22F::PRIR//0004
 :16S:TRADDET
 :16R:FIAC
 :36B::ESTT//UNIT/2,
 :97A::SAFE//OCSD231700
 :16S:FIAC
 :16R:SETDET
 :22F::SETR//TRAD
 :22F::STCO//TRAN
 :22F::SSBT/RT/AWAS

:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::DEAG//RZTIAT22XXX
:16S:SETPRTY
:16R:AMT
:19A::ESTT//EUR9,
:16S:AMT
:16S:SETDET

3.2.5 MT544-547 Settlement Confirmation: MT545 Payment Free of Receive Credit

Beispiel MT545 Payment free of Receive Credit Confirmation

:16R:GENL
:20C::SEME//1018614958
:23G:NEWM
:98C::PREP//20160518135746
:16R:LINK
:20C::RELA//NONREF
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PCTI//OCSD0000000000002 [Referenz der von OeKB CSD erstellten Transformation Instruction](#)
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::MITI//1905230274071212 [Eindeutige Referenz aus T2S der Transformation Instruction](#)
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::CORP// SPLR00001234
:16S:LINK
:16R:LINK
:20C::PREV//11905230274070499
:16S:LINK
:16S:GENL
:16R:TRADDET
:98A::TRAD//20151130
:98C::ESET//20151203120120
:98A::SETT//20151203
:35B:ISIN ATNEW00FACC3
:22F::PRIR//0004
:16S:TRADDET
:16R:FIAC
:36B::ESTT//UNIT/0,
:97A::SAFE//OCSD231700

:16S:FIAC
:16R:SETDET
:22F::SETR//TRAD
:22F::STCO//TRAN
:22F::SSBT//RT/AWAS
:16R:SETPRTY
:95P::PSET//OCSDATWWXXX
:16S:SETPRTY
:16R:SETPRTY
:95P::DEAG//RZTIAT22XXX
:16S:SETPRTY
:16R:AMT
:19A::ESTT//NEUR1,
:16S:AMT
:16S:SETDET

