Migrationsplan des Clearing Service zur Release November 2018

Die Produktivnahme der nachstehenden Änderungen erfolgt im Clearing Service (gleichermaßen für die Subsysteme CS.A und CS.I) am Freitag, den 16.11.2018, nach erfolgreicher Durchführung des letzten taggleichen Cut Offs/Settlements um 17:15 Uhr (I0X17). Die Übergabe der technischen Anpassungen sollte bis spätestens 19:00 Uhr abgeschlossen sein. Da jedoch bereits mit Beginn der technischen Übergabe die Einspielung der an das Clearing Service übermittelten Files manuell angehalten werden muss, sind die Adaptierungen für neu eingelieferte Dateien bereits ab ca. 17:15 Uhr schlagend. Die während der technischen Übergabe an das Clearing Service übertragenen Files, werden nach erfolgreicher Produktivnahme gesondert von der IT der OeNB eingespielt. Die Teilnehmer/Rechenzentren erhalten eine Information per Mail über den Abschluss der Migration.

1. Erforderliche Anpassungen gem. EPC Rulebook SCT 2017 V1.1 (CS.A und CS.I)

Inkrafttreten des „Request for Recall by the Originator“ und „Request for Status Update“:

a) *Änderungen im camt.*056:

- zusätzlich erlaubte Reason Codes „CUST“ (Code), „AM09“ und „AC03“ (Proprietary)
- Feld „Originator“ darf nur mit „name“ befüllt sein (bei Angabe eines der o.a. Reason Codes)
- Feld „Additional Information“ kann vorhanden sein (bei Angabe eines der o.a. Reason Codes sowie des Reason Codes „FRAD“)

Die Validierung des camt.056 im Clearing Service wird an die obigen Änderungen angepasst. Um mögliche Ablehnungen aufgrund der vom Recall abweichenden Einlieferungsfrist (13 Monate) zu vermeiden, wird die bisherige Fristenprüfung (D+10B) für den camt.056 generell entfernt (Anpassung an EBA Clearing).

Die weitere Abwicklung im Clearing Service bleibt unverändert:

- keine eigene Geschäftsart (Anzeige im Monitoring Tool je nach Zeitpunkt der Einlieferung als „CN“ bzw. „RC“)
- Einlieferung pre- und post-settlement möglich
- Einlieferung in „valutareinen“ Beständen (d.h. alle Arten des camt.056 - CN, RC, RFRO - können gemeinsam in einem Bestand eingeliefert werden, solange sie sich auf Grundgeschäfte mit gleicher Valuta beziehen)
- Stornierung (Herausnahme) des dazugehörigen pacs.008 bei Einlieferung vor Besicherung und Weiterleitung des Grundgeschäfts

b) Änderungen im pacs.004:

- Befüllung des Pflichtfeldes „Additional Information“: AT51 gefolgt von der „Referenz des Request for Recall by the Originator“

Die Beschreibung der *„Positive Response to the Request for Recall by the Originator*“ unterscheidet sich im Aufbau nicht vom pacs.004 als *„Positive Answer to a Recall of Credit Transfer***“** und zieht daher keine Veränderung im Clearing Service nach sich. Die Prüfung der verpflichtenden Angabe des Feldes

„Additional Information“ ohne Kontrolle des Inhalts findet weiterhin nur im CS.A statt (optionales Feld bei EBA Clearing).
Die Einlieferung kann gemeinsam in einem Bestand mit dem pacs.004 als *„Positive Answer to a Recall of Credit Transfer“* erfolgen.

c) *Änderungen im camt.029:*

- Feld „Additional Information“ muss vorhanden sein (Befüllung: AT51 gefolgt von der „Referenz des Request for Recall by the Originator“)
- bei Angabe des Reason Codes „AC03“ im RFRO darf das Feld „Additional Information“ ein zweites Mal angeführt werden (Befüllung: AT57 gefolgt von *„all information available to file a legal claim to recover the funds in case of reason code AC03*“)

Im Clearing Service wird die bisherige Validierung der „Additional Information“ im camt.029 (optionales Feld ohne Prüfung des angegebenen Reason Codes und Inhalts, max. 2 Angaben) unverändert beibehalten.
Um mögliche Ablehnungen aufgrund der abweichenden Einlieferungsfrist (max. 13 Monate + 10B) zu vermeiden, wird die bisherige Fristenprüfung (D+20B) für den camt.029 generell entfernt (Anpassung an EBA Clearing).
Die Einlieferung kann gemeinsam in einem Bestand mit dem camt.029 als *„Negative Answer to a Recall of Credit Transfer“* erfolgen.

d) *Neue Nachricht pacs.028:*

Für die Verarbeitung im Clearing Service erfolgt der Einbau einer neuen Geschäftsart „Request for Status Update on a Request for Recall by the Originator“ (Anzeige im Monitoring Tool als „RS“). Wie in der TSG vom 10.01.2018 beschlossen, wird nicht geprüft, ob bereits eine Beantwortung des ursprünglichen camt.056 mittels eines pacs.004 bzw. camt.029 stattgefunden hat. Eingehende pacs.028 werden nach der rein syntaktischen Validierung sofort und unabhängig von den Cut Offs in einem eigenen Bestand pro Nachricht an die Teilnehmer weitergeleitet.

2. Zusätzliche Änderung aus EBA Release (CS.I)

Neues EBA Auslieferungsfenster im CORE Service um 07:00 Uhr:

Ab dem 19.11.2018 findet eine zusätzliche Auslieferung von CORE-Aufträgen durch EBA Clearing um 07:00 Uhr statt. Diese werden, wie bisher, mit dem nächstmöglichen Cut Off an die CS.I-Teilnehmer verschickt, die technische Verarbeitung der Aufträge bleibt unverändert.

3. Änderungen bedingt durch die Einstellung der Verwendung einer Wertpapiersperre (CS.A und CS.I)

Die durch die EZB vorgegebene Einstellung der Verwendung des Collateralpools (WP-Sperre) zur Besicherung der Positionen aus dem Clearing Service erfordert keine technischen Änderungen in der Auftragsabwicklung, es erfolgen lediglich nachstehende Anpassungen der Stammdaten sowie des Tagesablaufs:

- Umwandlung der bei direkten Teilnehmern in den Stammdaten des Clearing Service hinterlegten Wertpapierbesicherung in Besicherung durch Betragssperren
- Einstellung des CS.A-Night Cut Offs um 03:00 Uhr (A0N03)
- Einstellung des reinen CS.A-Settlements um 08:00 Uhr (A0S08)
- Implementierung eines neuen CS.A-Cut Offs mit Settlement um 07:30 Uhr (A0X07)