clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 067/11

Datum: 5. September 2011
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

CCP Release 7.0: Vorbereitungen für den Simulationsstart, Veröffentlichung von Dokumenten für die Simulation

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 009/11, 034/11, 045/11, 063/11

Kontakt: Member Services & Admission, Tel. +49-69-2 11-1 17 00

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhänge:

(nur in englischer Sprache, nur auf der Eurex Clearing-Website)

1. Member Simulation Guide
2. Setup-Formular Net Clearing Service

Zusammenfassung:

Mit diesem Rundschreiben stellt Eurex Clearing weitere Informationen für das Testen der CCP-System-funktionalitäten zur Verfügung, die mit Eurex Clearing-Rundschreiben 034/11 am 11. April 2011 angekündigt wurden. Die neuen funktionalen und technischen Verbesserungen werden zum Testen in der CCP Release 7.0-Simulationsumgebung ab dem **4. Oktober 2011** beziehungsweise dem **11. Oktober 2011** an verfügbar sein.

Die Testmöglichkeiten für den Eurex Clearing Securities Lending Service werden ab dem **11. Oktober 2011** zur Verfügung stehen.

Bitte leiten Sie dieses Rundschreiben an alle in Ihrem Hause involvierten Abteilungen weiter.

Eurex Clearing AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
customer.support@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Prof. Dr. Peter Gomez

Vorstand:
Andreas Preuß (Vorsitzender), Jürg Spillmann, Thomas Book, Gary Katz, Michael Peters, Peter Reitz

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
Amtsgericht Frankfurt/Main

CCP Release 7.0: Vorbereitungen für den Simulationsstart, Veröffentlichung von Dokumenten für die Simulation

CCP Release 7.0: Vorbereitungen für den Simulationsstart

Mit diesem Rundschreiben stellt Eurex Clearing weitere Informationen für das Testen der angekündigten Weiterentwicklungen in der CCP Release 7.0-Simulationsumgebung zur Verfügung, sowie weitere Dokumente für die Simulation.

Da die neuen Funktionalitäten im CCP-System nicht das CCP-Frontend betreffen, wird kein neues Simulations-Frontend-Kit verschickt. Die neuen Feldwerte werden im Frontend automatisch zur Verfügung gestellt. Den CCP-Teilnehmern wird eine nicht geführte Simulation mit Fokustagen angeboten. Bitte entnehmen Sie den Zeitplan für die Simulation und die Fokustage dem Member Simulation Guide, der zeitgleich mit diesem Rundschreiben veröffentlicht wird, sowie dem Simulationskalender und dem Simulation Guide CCP auf der Website der Eurex Clearing AG unter dem folgenden Pfad:

www.eurexclearing.com > Member Section > Simulation > CCP Standard Simulation

Zum direkten Zugang klicken Sie bitte auf den folgenden Link:
https://www.eurexchange.com/members/simulation/ccp_simulation_de.html

Die neuen Funktionalitäten für das CCP Release 7.0-System werden in der Simulationsumgebung schrittweise eingeführt. Der folgende Zeitplan gibt einen Überblick über die Verfügbarkeit der entsprechenden Module:

Modul	**Einführungsdatum**
Simulationsstart CCP Release 7.0	am 4. Oktober 2011
Testen der neuen MSIF (Lieferinstruktions-Datenträger)-Funktionalitäten	ab dem 4. Oktober 2011
Zugang zur Common Report Engine	ab dem 10. Oktober 2011
Start der Eurex Clearing Securities Lending Service-Simulation	am 11. Oktober 2011
Verfügbarkeit der Entgelt-Reports	ab dem 17. Oktober 2011
Änderungen der Reports im Zusammenhang mit dem November 2011-Release der Clearstream Banking Frankfurt (CBF)	ab dem 20. Oktober 2011
Deutsche Fixed Income-Instrumente in Girosammelverwahrung (CSC)	ab dem 20. Oktober 2011

Eurex Clearing hat beschlossen, parallel zu den bestehenden und über VALUES verfügbaren Funktionen des Brutto-Liefermanagement neue Funktionen einzuführen. Dafür wird das derzeitige Member Settlement-Format um Nachrichtentyp MT541 (Receive against Payment) erweitert und nun auch in MSIF-Format zur Verfügung gestellt.

Im ersten Teil der Simulation ab dem 4. Oktober 2011 können die Mitglieder die geplanten Änderungen am MSIF-Format testen.

Die Änderungen für den Eurex Clearing Securities Lending Service werden in der Simulation ab dem 11. Oktober 2011 angeboten. Die zusätzliche Möglichkeit, die ausgewählten CCP-Reports über die Common Report Engine zu empfangen, gilt ab dem 10. Oktober 2011.

CCP-Teilnehmer, die den Eurex Clearing Securities Lending-Service nutzen möchten, müssen in der Simulationsumgebung mit ihren CBF- und SIX-SIS-Konten aufgesetzt sein. Bitte wenden Sie sich an Ihren Key Account Manager für weitere Informationen.

Änderungen im Nachrichtentyp MT536 für das CCP-Reporting werden in der CCP-Simulation ab dem 20. Oktober 2011 zusammen mit den CCP-fähigen deutschen Fixed Income-Instrumenten in Girosammelverwahrung wirksam.

Veröffentlichung der Dokumente für die Simulation

Um die Vorbereitungen für den Simulationsstart für CCP Release 7.0 zu unterstützen, stellt Eurex Clearing den Member Simulation Guide zur Verfügung, der die Eckdaten der notwendigen Aktivitäten für eine erfolgreiche Simulationsteilnahme sowie alle erforderlichen Details für die Simulation enthält.

Der Member Simulation Guide wurde auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexclearing.com > Member Section > Releases > CCP 7.0 > Manuals > Functional Manuals

Zum direkten Zugang klicken Sie bitte auf den folgenden Link:
https://www.eurexchange.com/members/releases/ccp70/manuals_functional_en.html

Setup-Formulare

Durch die Einführung der CCP-fähigen Fixed-Income-Instrumente in Xetra®/Xetra® Frankfurt Spezialist wird eine weitere Unterscheidung im Clearing-Service zwischen Aktieninstrumenten und Fixed Income-Instrumenten angeboten. Das Aufsetzen des Clearing Service für die Fixed Income-Instrumente erfolgt standardmäßig für den Full Service.

Das angepasste Formular wurde unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexclearing.com > Documents > Formulare > Clearing-Aktien FWB > Einzelformulare > Rechtlich & Regulatorisch > Net Clearing Service

Zum direkten Zugang klicken Sie bitte auf den folgenden Link:
http://www.eurexclearing.com/documents/forms/clearing_equities_fse/single/legal_en.html

Die Formulare für den Eurex Clearing Securities Lending Service-Setup werden rechtzeitig vor dem Start des entsprechenden Simulationsabschnitts veröffentlicht.

Um Informationen während der Vorbereitungsphase für CCP Release 7.0 zielorientiert verteilen zu können, bittet Eurex Clearing alle Mitglieder, die elektronische Eingabemöglichkeit in der Eurex Member Section für ihre Release-Kontakte zu nutzen. Dort finden Sie gespeicherte Daten von früheren Releases neben der Möglichkeit, neue Release-spezifische Kontakte einzugeben (Projektkoordinatoren und Simulation SPOCs). Diese Funktion ist in dem Hauptnavigationsmenü „Kontakte und Kommunikation“ zu finden und für alle Benutzer standardmäßig eingestellt.

Zum direkten Zugang zur Eurex Clearing Member Section klicken Sie bitte auf den folgenden Link:
https://business.deutsche-boerse.com/irj/portal

Sollten Sie Fragen zur Eurex Clearing Member Section haben, wenden Sie sich bitte an das Service Point-Team unter der Telefonnummer +49-69-2 11-1 78 88 oder senden Sie eine E-Mail an servicepoint@deutsche-boerse.com.

Wenn Sie andere Fragen haben oder zusätzliche Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte unser Member Services & Admission Team unter der Telefonnummer +49-69-2 11-1 17 00.

5. September 2011