



eurex clearing

rundschreiben 064/15

Datum: 16. Juni 2015
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendors
Autorisiert von: Heike Eckert

CCP Release 9.2: Funktionen, die am 22. Juni 2015 in Produktion eingeführt werden

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 177/14, 187/14, 037/15, 056/15

Kontakt: Trading & Clearing Services, T +49-69-211-1 17 00, memberservices@eurexclearing.com

Zielgruppe:

☞ Alle Abteilungen

Anhänge:

keine

Wie bereits mit Eurex Clearing-Rundschreiben 187/14, 037/15 und 056/15 angekündigt, ist die Produktions-einführung von CCP Release 9.2 für den **22. Juni 2015** geplant.

Eurex Clearing bestätigt hiermit, dass die folgenden Funktionen am 22. Juni 2015 in die Produktion eingeführt werden:

1. T2S: Änderung der Verarbeitung von Kapitalmaßnahmen in der Abwicklungslokation SIX SIS

T2S Welle 1 hat keine Auswirkungen auf das Abwicklungskonzept von Eurex Clearing. Bitte beachten Sie Eurex Clearing-Rundschreiben 177/14, in dem erste Informationen zu den Auswirkungen von T2S auf der Kundenseite gegeben wurden.

SIX SIS hat angekündigt, dass die Standards, die von der „Corporate Actions Sub-Group“ (CASG) und der „Corporate Actions Joint Working Group“ (CAJWG) definiert wurden, auf dem Schweizer Markt für alle Abwicklungstransaktionen mit T2S Welle 1 umgesetzt werden. Zum gegenwärtigen Zeitpunkt bedeutet dies u. a., dass SIX SIS nicht ganzzahlige Stückzahlen von Wertpapieren („Bruchteile“) abrunden wird.

Daraus resultierend wird Eurex Clearing Bruchteile von Wertpapieren, die von SIX SIS begeben wurden, die nicht der kleinsten und/oder dem Vielfachen der Abwicklungseinheit entsprechen, abtrennen und per Barausgleich abwickeln.

2. GC Pooling Select: Neues Format für die Reports

Die folgenden Reports werden den Clearing-Mitgliedern in der Common Report Engine (CRE) in CSV- und XML-Format zur Verfügung gestellt:

- RS810 - GCPSEL SRLH Pending Delivery
- RS815 - GCPSEL SRLH Settled Delivery
- RS820 - GCPSEL SRLH Repo Contracts

Diese Reports werden automatisch erzeugt und in der CRE allen Clearing-Mitgliedern bereitgestellt, die das Text-Format abonniert haben.

