clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 087/11

Datum: 14. November 2011
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ **Aktion erforderlich** ⚠ **Hohe Priorität**

CCP Release 7.0: Wichtige Information zum Produktionsstart

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 009/11, 034/11, 045/11, 063/11, 067/11, 076/11

Kontakt: Member Services & Admission, Tel. +49-69-211-1 17 00,
E-Mail: customer.support@eurexchange.com

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ Alle Abteilungen	keine

Zusammenfassung:

Dieses Eurex Clearing-Rundschreiben enthält Informationen bezüglich der Produktionseinführung von CCP Release 7.0 am **21. November 2011**.

Bitte beachten Sie, dass CCP Release 7.0 ein Pflicht-Release für alle CCP-Mitglieder ist. Da die CCP-Frontend-Software jedoch unverändert bleibt, besteht keine Notwendigkeit, die teilnehmerspezifische Software erneut zu installieren. Ein Konnektierungstest für CCP Release 7.0 wird nicht angeboten.

Das vorliegende Rundschreiben beschreibt die Funktionalitäten, die am 21. November 2011 eingeführt werden und gibt einen Überblick über den Zeitrahmen zur Einführung weiterer Services.

Bitte leiten Sie das Rundschreiben an die zuständigen Abteilungen Ihres Hauses weiter.

CCP Release 7.0: Wichtige Information zum Produktionsstart

Im Zusammenhang mit der Produktionseinführung von CCP Release 7.0 am Montag, dem 21. November 2011 enthält dieses Eurex Clearing-Rundschreiben Informationen für Ihre Vorbereitungen.

Bitte beachten Sie, dass CCP Release 7.0 ein Pflicht-Release für alle CCP-Mitglieder ist. Da die CCP-Frontend-Software jedoch unverändert bleibt, besteht keine Notwendigkeit, die teilnehmerspezifische Software erneut zu installieren. Ein Konnektierungstest für CCP Release 7.0 wird nicht angeboten.

Das vorliegende Rundschreiben beschreibt die Funktionalitäten, die am 21. November 2011 eingeführt werden und gibt einen Überblick über den Zeitrahmen zur Einführung weiterer Services.

Die folgenden Systemerweiterungen werden zum Produktionsstart im CCP-System freigeschaltet:

MSIF-Erweiterung

Zusätzlich zur SWIFT-Nachricht MT543 steht als Erweiterung der Auswahl an Requests für nachrichtenbasierte Abwicklungsinstruktionen der neue Nachrichtentyp MT541 für die Kommunikation mit dem CCP-Backend zur Verfügung.

Clearstream Banking SWIFT Release 2011

Im Zusammenhang mit den technischen Änderungen an der SWIFT-Nachricht MT536, die von Clearstream am 21. November 2011 in die produktiven Systeme eingeführt werden, passt Eurex Clearing den nachrichtenbasierten Report MT536 an. Bitte beachten Sie, dass diese Änderung einen Einfluss auf die Report-Struktur hat. Die entsprechenden Backoffice-Systeme müssen für die geänderten Reports angepasst werden.

Eurex Repo: Verlängerung der Handelszeit

Eurex Repo beabsichtigt, die Handelszeiten für Overnight-Abwicklungsprodukte in Zukunft zu ändern. Das Einführungsdatum der Handelszeitverlängerung wird separat von Eurex Repo bekannt gegeben. Als Vorbereitung für dieses Projekt muss das CCP-System interne Verarbeitungszeiten sowie die Verteilungszeit für NTP-Reports ändern, die in Übernachtverarbeitung erzeugt werden. Die Verteilungszeit für NTP-Reports wird von 18:00 Uhr MEZ auf 18:35 Uhr verlängert.

Common Report Engine

Es besteht zusätzlich die Möglichkeit, CCP-Reports parallel zu bestehenden Member-MISS und SWIFT/SNA-Verteilungskanälen zu empfangen. Die Börsen-Reports werden auf einem SFTP-Server gespeichert. Registrierte Benutzer können die Reports über die bestehende Anbindung oder über das Intenet herunterladen.

Neuer CCP-Service für Securities Lending

Der neue CCP-Service der Eurex Clearing für Securities Lending wird technisch implementiert. Die funktionale Einführung des Service wird zu gegebener Zeit kommuniziert.

CCP-fähige Bonds auf Xetra®/Xetra Frankfurt Specialist

Es ist vorgesehen, die erste Gruppe von Anleihen am 1. Februar 2012 auf „CCP-fähig“ zu setzen. Die genaue Zahl der Instrumente wird entsprechend bekannt gegeben. Vor der Einführung wird eine zusätzliche Simulation mit Fokustagen zum Testen der Verarbeitung von Kapitalmaßnahmen angeboten. Die derzeitige Verarbeitung nicht-CCP-fähiger Anleiheninstrumente bleibt unverändert. Das „Xetra Order Level Netting” wird nicht auf CCP-fähige Anleihen angewandt, sodass das CCP-System Teilausführungen aus dem Xetra®-System als einzelne Geschäfte verarbeitet. CCP-Teilnehmer können für aktienähnliche- und Anleiheninstrumente verschiedene Clearing Services nutzen. Der voreingestellte Clearing Service für

Anleihen wird, unabhängig von den Einstellungen des Clearing Service für aktienähnliche Produkte, der Full Clearing Service sein.

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Information benötigen, kontaktieren Sie Member Services & Admission unter Tel. +49-69-211-1 17 00.

14. November 2011