clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 037/12

Datum: 14. Mai 2012
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

CCP: Release 7.1: Vorbereitungen für den Simulationsstart, Änderung in der geplanten Veröffentlichung von Dokumenten

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 005/12, 009/12, 021/12

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
➲ Alle Abteilungen	Aktualisierter CCP Release 7.1 Kommunikationskalender (nur in englischer Sprache)

Zusammenfassung:

Mit diesem Rundschreiben stellt Eurex Clearing weitere Informationen zum Testen der CCP-System-funktionalitäten zur Verfügung.

Die neuen funktionalen und technischen Erweiterungen stehen ab dem **21. Mai 2012** zum Testen in der CCP Release 7.1-Simulationsumgebung zur Verfügung. Wir bitten die Mitglieder zu beachten, dass die vollunterstützte Simulation inklusive eines vollumfänglichen funktionalen und technischen Support ab dem **29. Mai 2012** zur Verfügung steht.

Außerdem beachten Sie bitte, dass die für den 21. Mai 2012 angekündigte Veröffentlichung der Dokumente zur Wertpapierleihe „Buy-In User Guide" und „Buy-In Tool Guide" entfällt, weil die Dokumente aufgrund der Erweiterungen des CCP-Service für die Wertpapierleihe nicht angepasst wurden. Die aktualisierten Abschnitte der „Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG" und die die Wertpapierleihe betreffenden Abschnitte des Dokuments „Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG", die für den 21. Mai 2012 geplant waren, werden zu einem späteren Zeitpunkt veröffentlicht und in einem gesonderten Rundschreiben angekündigt.

Bitte leiten Sie dieses Rundschreiben an alle beteiligten Abteilungen in Ihrem Unternehmen 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
memberservices@
eurexclearing.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 7.1: Vorbereitungen für den Simulationsstart, Änderung in der geplanten Veröffentlichung von Dokumenten

Die neuen funktionalen und technischen Erweiterungen stehen ab dem 21. Mai 2012 zum Testen in der CCP Release 7.1-Simulationsumgebung zur Verfügung. Wir bitten die Mitglieder zu beachten, dass die voll-unterstützte Simulation inklusive eines vollumfänglichen funktionalen und technischen Support ab dem 29. Mai 2012 zur Verfügung steht.

Simulation

Mit CCP Release 7.1 werden die bestehenden, von Eurex Clearing bereitgestellten Central Counterparty (CCP) Services für die Wertpapierleihe um die folgenden Funktionen erweitert:

- Nutzung von Wertpapieren als Sicherheiten unter Einbeziehung eines „Tri-Party Collateral Agenten“
- „Specific Lender”-Lizenz und „Agent Lender” als Agent und Kontobetreiber innerhalb des CCP-Service für die Wertpapierleihe
- Entgelte für Geldleihe gegen Wertpapiere als Sicherheiten
- Übertrag bereits bestehender bilateraler Leihen in den CCP-Service für die Wertpapierleihe („back-loading“)

Außerdem wird das neue Abwicklungskonto (7530) bei der Clearstream Banking Frankfurt (CBF) für die Abwicklung von Bonds-Lieferungen von „Notifications/Allocations“ der Eurex Clearing resultierend aus offenen Positionen in Fixed-Income-Futures genutzt. Die Nutzung kann mittels Reports geprüft werden. Teilnehmer müssen vor dem letzten Handelstag am 6. Juni 2012 eine Position in Eurex Fixed-Income-Futures (FBND) eröffnen. Daraus resultiert die Lieferung von Bonds am Verfalltag. Das Abwicklungsdatum ist der 12. Juni 2012.

Mitglieder, die das neue Konto (7530) testen wollen, müssen sicherstellen, dass die „CORPT“-Version des entsprechenden Reports über das @x-pert GUI im CCP-System ausgewählt wurde.

Dokumentation

Die Dokumente zur Wertpapierleihe „Buy-In User Guide” und „Buy-In Tool Guide” wurden nicht geändert. Aus diesem Grund entfällt die für den 21. Mai 2012 angekündigte Veröffentlichung der Dokumente. Die aktualisierten Abschnitte der „Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG” und die die Wertpapierleihe betreffenden Abschnitte des Dokuments „Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG”, die für den 21. Mai 2012 geplant waren, werden zu einem späteren Zeitpunkt veröffentlicht und in einem gesonderten Rundschreiben angekündigt.

Der aktualisierte Kommunikationskalender wird in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website eurexclearing.com unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Member Section > Releases > Current CCP/OTC Releases > CCP 7.1 > Manuals > Functional Manuals

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an das Member Services & Admission Team unter Tel. +49-69-211-1 17 00.

14. Mai 2012

Member Communication Calendar
Introduction of CCP Release 7.1

	Year	2012				
	Month	Jan	Feb	Mar	May	Jun
	Day	30	20	26	21	25
Member Communication Calendar	30.01.12	√				
Release Notes - Preliminary Version	30.01.12	√				
Description Reports - Formatted Layout	30.01.12	√				
Member File Based & SWIFT Interface *	n/a	n/a				
Description of Reports Raw Data	30.01.12	√				
Development Guide Field Values Overview *	n/a	n/a				
Customer Roadmap	20.02.12		√			
Release Notes - Final Version	26.03.12			√		
Description Reports - Formatted Layout - Update	26.03.12			√		
Customer Handbook	26.03.12			√		
Member File Based & SWIFT Interface - Update	26.03.12			√		
Description of Reports Raw Data - Update	26.03.12			√		
Development Guide Field Values Overview - Update	26.03.12			√		
Member Simulation Guide-Final Version	26.03.12			√		
Forms (Setups)	26.03.12			√		
Preisverzeichnis / Price List	open					
Clearing Conditions	open					
Production Launch	25.06.12					X

* No changes at the time of publication