Eurex Clearing-Rundschreiben 031/18

CCP Release 14.5: Produktionseinführung am 26. März 2018

Wie bereits in Eurex Clearing-Rundschreiben 134/17 angekündigt, erfolgt die Einführung von CCP Release 14.5 am **26. März 2018**.

Mit CCP Release 14.5 wird das CCP besicherte Verpfändungsmodell für mit Wertpapieren besicherte Darlehenstransaktionen im Lending CCP-Service von Eurex Clearing am **26. März 2018** in Produktion eingeführt.

Das durch den CCP besicherte Verpfändungsmodell ersetzt das derzeitige Verpfändungsmodell.

Ab dem 26. März 2018 werden in dem neuen Modell alle neuen Darlehenstransaktionen als durch den CCP besicherte Darlehenstransaktionen eröffnet. Darlehenstransaktionen, die vor diesem Zeitpunkt unter dem derzeitigen Verpfändungsmodell eröffnet wurden, werden nicht auf das neue, durch den CCP besicherte Verpfändungsmodell migriert.

Innerhalb des durch den CCP besicherten Verpfändungsmodells stellt die Bewegung von Sicherheiten zwischen dem Konto des Clearing Member (CM)-Leihers und dem Eurex Clearing-Konto beim jeweiligen „Tri-party Collateral Agent“ eine vollständige Eigentumsübertragung dar. Auf dem Eurex Clearing-Konto eingegangene Vermögenswerte werden zugunsten des CM-Verleihers verpfändet. Während des gesamten „Lebenszyklus“ der Darlehenstransaktion bleiben die Sicherheitenwerte auf diesem Konto. Beim entsprechenden „Tri-party Collateral Agent“ wird pro CM-Verleiher und „Eligibility Profile“ ein dediziertes Eurex Clearing-Konto eröffnet.

CM-Verleihern wird beim „Tri-party Collateral Agent“ eine Bevollmächtigung eingeräumt. Den bestehenden Prozessen entsprechend liefert der „Tri-party Collateral Agent“ die neue „Exposure ID“ im Report „RPTTL750 Exposure Reference“.

Das neue durch den CCP besicherte Verpfändungsmodell kann auch für die Saldierung von Risikopositionen von mit Wertpapieren besicherten Darlehenstransaktionen genutzt werden.

Sollten Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Ihren Group Client Key Account Manager Clearing per E-Mail an clearing.services-admission@eurexclearing.com.

Datum: 12. März 2018

Empfänger:
Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren

Autorisiert von:
Heike Eckert

Zielgruppe:
Alle Abteilungen

Verweis auf Eurex Clearing Rundschreiben:
134/17

Kontakt:
Ihr Group Client Key Account Manager Clearing,
clearing.services-admisssion@eurexclearing.com