clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 049/12

Datum: 18. Juni 2012
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

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

CCP Release 7.1: Wichtige Informationen zum Produktionsstart

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 005/12, 009/12, 021/12, 037/12, 042/12

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

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

Zusammenfassung:

Dieses Rundschreiben enthält Informationen bezüglich der Produktionseinführung von CCP Release 7.1 am **25. Juni 2012.**

Bitte beachten Sie, dass CCP Release 7.1 ein Pflicht-Release für alle Mitglieder ist, die Eurex-Derivate abwickeln sowie für Mitglieder, die den CCP-Service für die Wertpapierleihe nutzen. Da die CCP-Frontend-Software jedoch unverändert bleibt, besteht keine Notwendigkeit, die teilnehmerspezifische Software erneut zu installieren. Ein Konnektierungstest wird für CCP Release 7.1 nicht angeboten.

Das vorliegende Rundschreiben beschreibt die Funktionalitäten, die am 25. Juni 2012 eingeführt werden.

Bitte leiten Sie das Rundschreiben an die zuständigen Abteilungen Ihres Hauses 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:
Dr. Reto Francioni

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: Wichtige Informationen zum Produktionsstart

Die folgenden Systemerweiterungen werden zum Produktionsstart am 25. Juni 2012 im CCP-System freigeschaltet:

CCP-Service für die Wertpapierleihe

Die Erweiterung des Service erfolgt durch die folgenden Maßnahmen:

- Einführung von Sicherheiten in Form von Wertpapieren im Zusammenhang mit „Tri-Party Collateral Agents“
- Einführung von Entgelten für die Leihe gegen Wertpapiere
- Einführung einer „Specific Lender License” und Implementierung des „Agent Lender” als Agent und Kontobetreiber im CCP-Service für die Wertpapierleihe
- Einführung eines „Back-Loading” von bestehenden bilateralen Leihen in den CCP-Service für die Wertpapierleihe

Erweiterungen der Kontenstruktur von Eurex Clearing

Eurex Clearing bietet eine erweiterte Lösung für die Abwicklung von Fixed Income-Produkten (Bonds). Mit Einführung des neuen Abwicklungskontos 7530 wird die Abwicklung von Bonds resultierend aus Eurex-„Notifications/Allocations“ segregiert von Lieferverpflichtungen in Bonds, die aus anderen Handelspätzen wie Eurex Bonds und Eurex Repo resultieren.

Im Rahmen der Änderungen wird Eurex Clearing zukünftig zwei CCP-Abwicklungskonten bei CBF nutzen, d.h. Konto 7530 für aus Eurex „Notifications/Allocations“ resultierende Bonds-Lieferungen und Konto 7525 für Abwicklungen von Geschäften von den Eurex Bonds- und Eurex Repo-Handelsplätzen.

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

18. Juni 2012