



eurex clearing

rundschreiben 107/16

Datum: 22. August 2016
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

**CCP Release 10.0/T2S Welle 3: Produktionseinführung von T2S Welle 3
am 12. September 2016**

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 107/15, 142/15, 146/15

Kontakt: Group Client Services & Administration, T +49-69-211-1 17 00,
T2S_EurexClearing_MemberReadiness@eurexclearing.com

Zielgruppe:

☞ Alle Abteilungen

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Dieses Eurex Clearing-Rundschreiben enthält Informationen zur Einführung von T2S Welle 3 in die produktive Umgebung von CCP Release 10.0.

In der dritten Migrationswelle von T2S migrieren die ESES-Märkte Euroclear Belgien, Euroclear Frankreich und Euroclear Niederlande ihr Wertpapierabwicklungsgeschäft nach T2S, dem neuen europäischen Wertpapierabwicklungssystem in Zentralbankgeld.

Die Einführung von T2S Welle 3 hat lediglich Auswirkungen auf Eurex Clearing's Lending CCP-Service für die ESES-Märkte. Alle anderen, von Eurex Clearing angebotenen CCP-Services sind nicht betroffen.

Die Änderungen treten am **12. September 2016** in Kraft.

Bitte leiten Sie diese Information an alle betroffenen Abteilungen Ihres Unternehmens 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. Hugo Bänziger

Vorstand:
Erik Tim Müller (Vorsitzender),
Heike Eckert (stv. Vorsitzende),
Matthias Graulich,
Thomas Laux,
Manfred Matusza

Aktiengesellschaft mit
Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
UST-IdNr. DE194821553
Amtsgericht
Frankfurt/Main

**CCP Release 10.0/T2S Welle 3: Produktionseinführung von T2S Welle 3
am 12. September 2016**

Dieses Eurex Clearing-Rundschreiben enthält Informationen zur Einführung von T2S Welle 3 in die produktive Umgebung von CCP Release 10.0.

In der dritten Migrationswelle von T2S migrieren die ESES-Märkte Euroclear Belgien, Euroclear Frankreich und Euroclear Niederlande ihr Wertpapierabwicklungsgeschäft nach T2S, dem neuen europäischen Wertpapierabwicklungssystem in Zentralbankgeld.

Die Einführung von T2S Welle 3 hat lediglich Auswirkungen auf Eurex Clearing's Lending CCP-Service für die ESES-Märkte. Alle anderen, von Eurex Clearing angebotenen CCP-Services sind nicht betroffen.

Die Änderungen treten am 12. September 2016 in Kraft.

Eurex Clearing bestätigt hiermit, dass die folgenden Neuerungen am 12. September 2016 in die Produktivumgebung von CCP Release 10.0 eingeführt werden:

1. Der Annahmeschluss für Instruktionen für die Wertpapierleihe ohne Zahlung („FoP“) mit Abwicklung bei einem Zentralverwahrer der ESES-Märkte wird auf 18:00 Uhr MEZ verlängert. Dadurch ändern sich die Fristen für die Geschäftseingabe für T+0-Leihe in ESES-Wertpapiersicherheiten gegen Sicherheiten in Wertpapieren oder Sicherheiten in Bar wie folgt:
 - 15:00 Uhr (MEZ) für Leihe gegen Bar USD & EUR
 - 15:00 Uhr (MEZ) für Leihe gegen Wertpapiere mit TPCA CBL
 - 15:10 Uhr (MEZ) für Leihe gegen Wertpapiere mit TPCA EB
2. Vom Lending CCP-Service versandte FoP-Instruktionen für die Wertpapierleihe mit Abwicklung bei einem Zentralverwahrer der ESES-Märkte werden als „already matched“ an den entsprechenden Zentralverwahrer weitergeleitet.

Weitere Details sind dem Dokument „CCP 10.0 Release Notes T2S wave 3“ zu entnehmen, welches auf der Eurex Clearing Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link zur Verfügung steht:

**[Technologie > Eurex Clearing's Securities CCP > System documentation >
Release 10.0/T2S wave 3 > CCP 10.0 Release Notes T2S wave 3](#)**

Wir möchten außerdem noch einmal darauf hinweisen, dass die Allgemeinen Geschäftsbedingungen zum Vertrag über die technische Anbindung an die Clearing-EDV der Eurex Clearing AG (Eurex Clearing) (Anschlussvertrag) zum 11. Januar 2016 angepasst wurden. Gemäß dem Vertrag muss die Vertragspartei nun ihre „Readiness“ für jedes neue Release bestätigen.

Für die Migration der ESES-Zentralverwahrer nach T2S sind nur Eurex Clearing-Mitglieder, die an Eurex Clearing's Lending CCP-Service für die ESES-Märkte teilnehmen, verpflichtet, das „Readiness Statement“ einzureichen.

Das Dokument kann auf der Eurex Clearing Website unter dem folgenden Link heruntergeladen werden:

**[Technologie > Eurex Clearing's Securities CCP > System documentation >
Release 10.0/T2S wave 3 > Readiness Statement CCP 10.0 T2S wave 3](#)**

Bitte stellen Sie sicher, dass das unterzeichnete „Readiness Statement“ bis spätestens zum **29. August 2016** vorliegt.

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Group Client Services & Administration unter Tel. +49-69-211-1 17 00.

22. August 2016