clear to trade

e u r e x c l e a r i n g
rundschreiben 045/13

Datum: 17. April 2013
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Dr. Thomas Book

Eurex Clearings CCP: Einführung ausgewählter Aktien in AKV-Verwahrung, die auf Xetra/Xetra Frankfurt Spezialist gehandelt werden

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

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
Ü Alle Abteilungen	Vorläufige Liste der Instrumente in Produktion

Zusammenfassung:

Eurex Clearing wird die Anzahl der vom CCP unterstützten Instrumente durch Einführung von ausgewählten Aktien aus Großbritannien, Schweden und Spanien sowie einer Aktie aus den USA in AKV-Verwahrung erweitern, die über CBF(I)-Konten bei Clearstream Banking Frankfurt (CBF) abgewickelt werden. Alle hinzukommenden Aktien werden auf Xetra/Xetra Frankfurt Spezialist in Euro gehandelt.

Zu diesem Zweck wird ab dem **29. April 2013** eine Auswahl von CCP-fähigen Instrumenten in AKV-Verwahrung in der Simulationsumgebung verfügbar sein.

Das Datum für die Einführung in Produktion der neuen Instrumente geben wir rechtzeitig bekannt. In der Anlage erhalten Sie eine vorläufige Liste der AKV-verwahrten Instrumente, die in die Produktion eingeführt werden.

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:
Dr. Thomas Book (Vorsitzender),
Jürg Spillmann (stv. Vorsitzender),
Heike Eckert, Thomas Laux,
Erik Tim Müller, Andreas Preuß

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
Amtsgericht Frankfurt/Main

Eurex Clearings CCP: Einführung ausgewählter Aktien in AKV-Verwahrung, die auf Xetra/Xetra Frankfurt Spezialist gehandelt werden

Eurex Clearing wird die Anzahl der vom CCP unterstützten Instrumente durch Einführung von ausgewählten Aktien aus Großbritannien, Schweden und Spanien sowie einer Aktie aus den USA in AKV-Verwahrung erweitern. Diese Aktien werden über CBF(I)-Konten bei Clearstream Banking abgewickelt und auf Xetra/Xetra Frankfurt Spezialist in Euro gehandelt. Die technischen Voraussetzungen für die Erweiterung wurden mit CCP Release 7.0 geschaffen.

Das Datum für die Einführung in Produktion der neuen Instrumente geben wir rechtzeitig bekannt. In der Anlage erhalten Sie eine vorläufige Liste der AKV-verwahrten Instrumente, die in die Produktion eingeführt werden.

Alle Services der Eurex Clearing für die neuen CCP-fähigen Instrumente entsprechen denen für Aktien-instrumente in Girosammelverwahrung („Collective Safe Custody“, CSC), die auf Xetra/Xetra Frankfurt Spezialist gehandelt werden.

Es werden die aktuellen Einstellungen für das Clearingmodell (Full Service, Extended Service und Basic Service) angewendet, entsprechend dem derzeitigen Mitglied/Konto-Setup für Xetra/Xetra Frankfurt Spezialist.

Wenn der Basic Service oder der Extended Net Service ausgewählt wurde, wird Netting auf Ebene des Geschäftsdatums (Trade Date Netting) inklusive Netting zwischen den Handelslokationen Xetra und Xetra Frankfurt Spezialist durchgeführt, bei Wahl des Full Service wird Netting auf Ebene des tatsächlichen Abwicklungstags (Actual Settlement Date Netting) durchgeführt.

Das Abwicklungskonto von Eurex Clearing ist Konto 67525.

Aufgrund der verschiedenen Netting-Modelle müssen die CBF(I)-Konten mit allen Parametern aufgesetzt sein, die im Formular „Antrag auf Einrichtung/Löschung/Änderung von CCP-Settlement-Konten (CBF, SIS, Euro-clear, CBL, EUI)“, II. 6-Series Account (CBF-Creation-Konto), Seite 6, abgefragt werden.

Reporting

Geschäfte in Aktien in AKV-Verwahrung werden in den derzeit genutzten Reports

- CE260 Pending Delivery
- CE270 Settled Delivery

ausgewiesen. Es sind keine Änderungen/Anpassungen an den aktuellen Reports erforderlich. Die Geschäfte in Aktien in AKV-Verwahrung können anhand der Kombination Settlement Location = CBL und Trading Location = XETR/XFRA erkannt werden.

Geschäfte in Aktien in AKV-Verwahrung aus Xetra/Xetra Frankfurt Spezialist werden über das CBF(I)-6er-Konto des Mitglieds abgewickelt. Für diese Geschäfte werden alle CCP-Reports das CBF(I)-6er-Konto und Clearstream Banking Luxembourg (CBL) als Abwicklungslokation ausweisen. Die Schlussnote der Handels-lokation wird weiterhin die vierstellige CBF-Kontonummer als Abwicklungslokation ausweisen.

Mitglieder, die den Freigabedatenträger MT543/MT541 für ihre Brutto-Liefermanagement-Requests nutzen, können entweder das CBF-Konto oder das CBF-Auslandskonto an den CCP liefern. Bei der Abfrage der Geschäfte über das @X-pert GUI werden nur das CBF-Auslandskonto und „CBL“ als Abwicklungslokation unterstützt.

Die folgenden CCP-fähigen Instrumente werden ab dem 29. April 2013 in der Simulationsumgebung verfügbar sein:

ISIN	**Instrument**
GB00B16GWD56	VODAFONE GRP DL-,11428571
GB00B03MM408	ROYAL DUTCH SHELL B EO-07
GB0008847096	TESCO PLC LS-,05
ES0178430E18	TELEFONICA INH. EO 1
ES0173516115	REPSOL S.A. INH. EO 1
SE0000108656	ERICSSON B (FRIA)
SE0000106270	HENNES + MAURITZ B SK-125
US4509391037	IBS GRP HLDGS REGS LS-,01

Für Rückfragen und weitere Auskünfte steht Ihnen das Member Services & Admission Team unter der Telefonnummer +49-69-211-1 17 00 gerne zur Verfügung.

17 April 2013

Vorläufige Liste der Instrumente für die Produktion

ISIN	Instrument
GB00B7T77214	ROYAL BK SCOTLD GRP LS 1
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN DL-,54945
GB00B1VYCH82	THOMAS COOK GROUP LS-,10
GB00B16GWD56	VODAFONE GRP DL-,11428571
GB00B03MM408	ROYAL DUTCH SHELL B EO-07
GB0031411001	XSTRATA PLC DL-,50
GB0031348658	BARCLAYS PLC LS 0,25
GB0030913577	BT GROUP PLC LS 0.05
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC DL-,25
GB0009252882	GLAXOSMITHKLINE LS-,25
GB0008847096	TESCO PLC LS-,05
GB0008706128	LLOYDS BKG GRP LS-,10
GB0007980591	BP PLC DL-,25
GB0007188757	RIO TINTO PLC LS-,10
GB0002875804	BRIT.AMER.TOBACCO LS-,25
GB0000595859	ARM HLDGS PLC LS-,0005
GB0000566504	BHP BILLITON DL-,50
ES0178430E18	TELEFONICA INH. EO 1
ES0173516115	REPSOL S.A. INH. EO 1
ES0148396015	INDITEX INH. EO 0,15
ES0144580Y14	IBERDROLA INH. EO -,75
ES0143416115	GAMESA CORP.TEC.I.EO-,17
ES0113900J37	BCO SANTANDER N.EO0,5
ES0113211835	BCO BIL.VIZ.ARG.NOM.EO-49
SE0000869646	BOLIDEN AB SK 2
SE0000108656	ERICSSON B (FRIA)
SE0000106270	HENNES + MAURITZ B SK-125
US4509391037	IBS GRP HLDGS REGS LS-,01