



# eurex clearing

## rundschreiben 098/16

**Datum:** 25. Juli 2016  
**Empfänger:** Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren  
**Autorisiert von:** Thomas Laux

### Eurex Clearing's CCP Release 12.0/T2S Welle 4: Ankündigung der Simulation

**Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben:** 177/14, 049/15, 132/15, 146/15, 037/16, 086/16

**Kontakt:** Group Client Services & Administration, T +49-69-211-1 17 00,  
[memberservices@eurexclearing.com](mailto:memberservices@eurexclearing.com)

**Zielgruppe:**

➔ Alle Abteilungen

**Anhänge:**

keine

**Zusammenfassung:**

Mit Eurex Clearing-Rundschreiben 037/16 hat Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 12.0/T2S Welle 4 angekündigt. In der vierten Migrationswelle von T2S am **6. Februar 2017** wird Clearstream Banking Frankfurt AG (CBF) ihr Wertpapierabwicklungsgeschäft nach T2S, dem neuen europäischen Wertpapierabwicklungssystem in Zentralbankgeld, migrieren.

Die Details für das neue Release sind wie folgt:

Release	CCP Release 12.0/T2S Welle 4
<b>CCP Release 12.0/T2S Welle 4 Software in der Simulation</b>	11. Juli 2016
<b>Start der Mitgliedersimulation</b>	8. August 2016
<b>Datum der Einführung in Produktion</b>	6. Februar 2017

Die Software für CCP Release 12.0/T2S Welle 4 steht seit dem 11. Juli 2016 in der Simulation zur Verfügung. Die unterstützte Mitgliedersimulation findet vom 8. August 2016 bis zum 3. Februar 2017 statt. In der Simulation werden die Mitglieder die Möglichkeit haben, die Anpassungen zu testen und sicherzustellen, dass sie am Einführungstermin den produktiven Handel problemlos aufnehmen können. Zur Unterstützung wurden die Dokumente „Member Simulation Guide CCP 12.0 / T2S wave 4“ und „Attachment to Member Simulation Guide CCP 12.0 / T2S wave 4“ auf der Eurex Clearing-Website zum Herunterladen zur Verfügung gestellt.



**Eurex Clearing's CCP Release 12.0/T2S Welle 4: Ankündigung der Simulation**

Mit Eurex Clearing-Rundschreiben 037/16 hat Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 12.0/T2S Welle 4 angekündigt. In der vierten Migrationswelle von T2S am 6. Februar 2017 wird Clearstream Banking Frankfurt AG (CBF) ihr Wertpapierabwicklungsgeschäft nach T2S, dem neuen europäischen Wertpapierabwicklungssystem in Zentralbankgeld, migrieren.

Die Details für das neue Release sind wie folgt:

Release	CCP Release 12.0/T2S Welle 4
<b>CCP Release 12.0/T2S Welle 4 Software in der Simulation</b>	11. Juli 2016
<b>Start der Mitgliedersimulation</b>	8. August 2016
<b>Datum der Einführung in Produktion</b>	6. Februar 2017

Die Software für CCP Release 12.0/T2S Welle 4 steht seit dem 11. Juli 2016 in der Simulation zur Verfügung. Die unterstützte Mitgliedersimulation findet vom 8. August 2016 bis zum 3. Februar 2017 statt. In der Simulation werden die Mitglieder die Möglichkeit haben, die Anpassungen zu testen und sicherzustellen, dass sie am Einführungsstermin den produktiven Handel problemlos aufnehmen können.

Zur Unterstützung wurden die Dokumente „Member Simulation Guide CCP 12.0 / T2S wave 4“ und „Attachment to Member Simulation Guide CCP 12.0 / T2S wave 4“ auf der Eurex Clearing-Website zum Herunterladen zur Verfügung gestellt.

Vom 11. Juli bis zum 7. August 2016 werden in der CCP-Simulation interne Tests durchgeführt. Die Mitgliedersimulation bleibt zugänglich, wird jedoch nicht unterstützt. Es besteht dabei die Möglichkeit, dass von Mitgliedern in der CCP-Simulation begonnene Tests abbrechen oder dass sie unerwartete Ergebnisse liefern. Es wird daher dringend empfohlen, vor dem 8. August 2016 Tests in der CCP-Simulation zu vermeiden.

Mit der Einführung von CCP Release 12.0/T2S Welle 4, wird das „Batch“-orientierte Reporting (BRP) von Eurex Clearing größtenteils durch das bereits existierende „Continuous Reporting“ (CORPT) ersetzt.

Die BRP-Version der Reports „CE260 Pending Delivery“ und „CE270 Settled Delivery“ wird abgeschafft. Mitglieder, die aktuell in Simulation ausschließlich die BRP-Versionen dieser Reports empfangen, werden gebeten, zum Testen der Verarbeitung die „CORPT“-Version auszuwählen, da die Dateinamen leicht variieren.

Der Report „CE265 Pending Delivery before NTP“ wurde um das Reporting von aktienähnlichen Produkten in Euro erweitert. Auch dieser Report sollte - falls erforderlich - als „CORPT“-Version selektiert werden.

Weitere Details sind den Report-Dokumenten „Description of Reports Formatted Layout CCP 12.0“, „Description of Reports - RAW Data CCP 12.0“ und „Member File Based and SWIFT Interface CCP 12.0“ zu entnehmen, die in der Member Section der Eurex Clearing-Website [www.eurexclearing.com](http://www.eurexclearing.com) unter dem folgenden Pfad zum Herunterladen zur Verfügung stehen:

**Eurex Clearing Member Section > Technology > CCP Releases > CCP 12.0 / T2S wave 4 > Manuals > Technical Manuals**

Die Simulation von CCP Release 12.0/T2S Welle 4 ist eine offene bzw. „free-style“-Simulation, d.h. Simulationsteilnehmer können ihre eigenen internen Simulationsszenarien definieren und die neue bzw. angepasste Funktionalität testen.

Eurex Clearing unterstützt die von CBF geplanten Fokustage. Zusätzlich bietet Eurex Clearing weitere Fokustage für Kapitalmaßnahmen an, um die Handhabung von Wertpapierbruchteilen, die mit CCP Release 10.0/T2S Welle 2 eingeführt wurde, zu illustrieren.

Für weitere Details siehe die Dokumente „Member Simulation Guide CCP 12.0 / T2S wave 4“ und „Attachment to Member Simulation Guide CCP 12.0 / T2S wave 4“, welche in der Member Section der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad zum Herunterladen zur Verfügung stehen:

**Eurex Clearing Member Section > Technology > CCP Releases > CCP 12.0 / T2S wave 4 > Manuals > Functional Manuals**

Bitte beachten Sie: CBF hat die Zahl der ISINs begrenzt, für die Bestände auf den T2S-Wertpapierkonten in Simulation aufgesetzt werden. Entgegen der Beschreibung im „Member Simulation Guide CCP 12.0 / T2S wave 4“ bezüglich Wertpapierbestände pro CBF-Hauptkonto, hat CBF die Liste von ISINs und angepasste Bestände veröffentlicht, die pro CBF-Hauptkonto aufgesetzt werden. Die Liste unterstützter ISINs für die T2S-Abwicklung, für welche CBF Bestände eingerichtet hat, ist dem Dokument „Member Simulation Guide ISIN Attachment CCP 12.0“ zu entnehmen, welches ebenfalls in der Eurex Clearing Member Section zur Verfügung steht.

Im Vorfeld der Einführung von T2S Welle 4 (vom 9. Januar bis zum 20. Januar 2017) unterstützt die CCP Release 12.0-Simulation das Testen des neuen, an T2S ausgerichteten Geschäftstages. Ziel ist es, die neuen Funktionalitäten für T2S und den neuen Geschäftstag in einem den Produktionsbedingungen möglichst ähnlichem Umfeld zu testen.

In dieser Phase wird der CCP fünf Verarbeitungsläufe pro Woche (von Montag bis Freitag) durchführen, um so den Abläufen der T2S-Geschäftstage so weit wie möglich zu entsprechen.

Da CCP Release 12.0/T2S Welle 4 sich auf die Einführung von T2S Welle 4 fokussiert, ist die Simulationsumgebung von Eurex Clearing stark auf die zeitlichen Abläufe und Vorgänge der Europäischen Zentralbank (EZB)/CBF ausgerichtet.

Es ist daher vorgesehen, dass Eurex Clearing an den „Migration Weekend Dress Rehearsals“ (MWDRs) der EZB teilnimmt. Dies erfordert die Einrichtung von „Frozen Zones“ für Änderungen von statischen Daten der Mitglieder sowie Unterbrechungen der CCP 12.0-Simulation<sup>1</sup>. Die „Frozen Zones“ und Simulationsunterbrechungen von CCP Release 12.0/T2S Welle 4, in denen Änderungen statischer Mitgliederdaten nicht möglich sind, sind wie folgt:

„Frozen Zone“	Unterbrechung der CCP-Simulation	Datenänderungen können beauftragt werden ab
29. Aug – 4. Sep 2016 3. Okt 2016	5. Sep – 18. Sep 2016 23. Sep – 30. Sep 2016	4. Okt 2016
28. Nov – 4. Dez 2016 19. Dez 2016	5. Dez – 12. Dez 2016	20. Dez 2016

Um eine termingerechte Verarbeitung seitens Eurex Clearing zu gewährleisten, sollten Mitglieder Änderungen oder Neueinrichtungen rechtzeitig vor bzw. nach einer der „Frozen Zones“ oder Simulationsunterbrechungen beauftragen.

Bitte beachten Sie: Eurex Clearing fordert die Clearing-Mitglieder auf, vor Produktionsbeginn, d.h. bis spätestens zum **16. Januar 2017** ein Member Readiness Statement einzureichen. Um den Mitgliedern zu ermöglichen, sich hinreichend mit den angepassten Prozessen vertraut zu machen, wird die aktive Teilnahme an der CCP Release 12.0/T2S Welle 4-Simulation dringend empfohlen.

<sup>1</sup> Siehe hierzu Eurex Clearing-Rundschreiben 086/16

## e u r e x c l e a r i n g r u n d s c h r e i b e n 0 9 8 / 1 6

Das Dokument „Member Readiness Statement for CCP Release 12.0“ wurde unter dem folgenden Pfad in der Member Section der Eurex Clearing-Website zum Herunterladen zur Verfügung gestellt:

**[www.eurexclearing.com](http://www.eurexclearing.com) > [Eurex Clearing Member Section](#) > [Technology](#) > [CCP Releases](#) > [CCP 12.0 / T2S wave 4](#) > [Manuals](#) > [Functional Manuals](#)**

Sollten Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Group Client Services & Administration unter der Tel. +49-69-211-1 17 00 oder per E-Mail an: [memberservices@eurexclearing.com](mailto:memberservices@eurexclearing.com).

25. Juli 2016