



eurex clearing

rundschreiben 037/16

Datum: 22. März 2016
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

CCP Release 12.0: Ankündigung der Einführung

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 177/14, 049/15, 132/15, 146/15

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

Zielgruppe:

➔ Alle Abteilungen

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Aufgrund der geänderten Planung der Europäischen Zentralbank (EZB) sieht das Migrationsszenario zur Zeit vor, dass:

- Clearstream Banking Frankfurt AG (CBF) in T2S Welle 4, am **6. Februar 2017** auf die T2S-Plattform migrieren wird.

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 12.0 am **6. Februar 2017** an, das sich auf die Einführung von T2S Welle 4 bezieht.

CCP Release 12.0 ist für alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing verpflichtend.

Für CCP Release 12.0 / T2S Welle 4 ist ab dem **8. August 2016** eine Mitgliedersimulation geplant.

Informationen zum CCP Release 11.0 im 4. Quartal 2016 werden zu einem späteren Zeitpunkt veröffentlicht.

CCP Release 12.0: Ankündigung der Einführung

Aufgrund der geänderten Planung der Europäischen Zentralbank (EZB) sieht das Migrationsszenario zur Zeit vor, dass:

- Clearstream Banking Frankfurt AG (CBF) in T2S Welle 4, am 6. Februar 2017 auf die T2S-Plattform migrieren wird.

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 12.0 am 6. Februar 2017 an, das sich auf die Einführung von T2S Welle 4 bezieht.

CCP Release 12.0 ist für alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing verpflichtend.

Für CCP Release 12.0 / T2S Welle 4 ist ab dem 8. August 2016 eine Mitgliedersimulation geplant.

Informationen zum CCP Release 11.0 im 4. Quartal 2016 werden zu einem späteren Zeitpunkt veröffentlicht

In der vierten Migrationswelle von T2S am 6. Februar 2017 wird Clearstream Banking Frankfurt AG (CBF) ihr Wertpapierabwicklungsgeschäft auf T2S, dem neuen europäischen Wertpapierabwicklungssystem in Zentralbankgeld, migrieren.

Für die Umsetzung von T2S Welle 4 werden die von Eurex Clearing angebotenen Services angepasst, um die T2S-Anforderungen zu erfüllen. Eurex Clearing wird ihre bestehenden Prozesse und Produkte anpassen, um die Kontinuität der Services für alle betroffenen Kunden in der neuen T2S-Umgebung sicherzustellen.

Außerdem wird Eurex Clearing ihre Systeme und Prozesse anpassen, um von Kunden priorisierte Änderungen umzusetzen, die auf der neuen Funktionalität von T2S basieren.

Die folgenden Änderungen werden mit CCP Release 12.0 eingeführt:

- **Neuer T2S-Geschäftstag:** Anpassung des Eurex Clearing-Geschäftstags an die T2S-Zeiten.
- **Liefermanagement:** Einführung neuer Annahmeschluss-Zeiten für die verschiedenen Instrumente und Einführung von untertägigen Aggregationsläufen; Änderung in der Verarbeitung von verspäteten Lieferungen und Änderungen zur generellen Nutzung der T2S-Funktionen.
- **Cash:** Anpassung von Zahlungsläufen und deren Auswirkung auf das Liefermanagement und Änderung der zeitlichen Beschränkungen in Bezug auf externe Systeme und Unternehmen.
- **Brutto-Liefermanagement (BLM):** Anpassung des BLM entsprechend dem neuen T2S-Geschäftstag.
- **Kapitalmaßnahmen:** Änderungen entsprechend den geplanten Anpassungen der Zentralverwahrer um eine Harmonisierung im Bereich der Kapitalmaßnahmen zu erreichen.
- **Reporting:** Das Batch-Reporting wird auf das fortlaufende Reporting (CORPT) umgestellt, weiterhin werden die Reportbereitstellungszeiten sowie die Reports selber angepasst.

Detaillierte Informationen finden Sie in der vorläufigen, bereits veröffentlichten Dokumentation für T2S Welle 3. Diese Dokumentation bleibt für CCP 12.0/T2S Welle 4 gültig, bis die aktualisierten Versionen zur Verfügung gestellt werden (nur in Englisch). Die vorläufigen Dokumente sind in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Pfad verfügbar:

Technologie > CCP Releases > T2S - wave 4 > Manuals > Functional Manuals/Technical Manuals

Simulation

Ab dem 8. August 2016 ist für CCP Release 12.0/T2S Welle 4 eine Mitgliedersimulation geplant.

Weitere Informationen zur Teilnehmersimulation sind im Dokument „Member Simulation Guide“ enthalten, das in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website am 6. Juni 2016 veröffentlicht wird.

Veröffentlichung von Dokumenten

In der Eurex Clearing Member Section auf der Eurex Clearing-Website haben wir das unten aufgeführte Dokument veröffentlicht (nur in Englisch), um Ihre Vorbereitungen auf die Einführung von CCP Release 12.0 zu unterstützen.

Veröffentlichtes funktionales Dokument	
Update	Member Communication Calendar
Pfad	www.eurexclearing.com > Eurex Clearing Member Section > Technologie > CCP Releases > CCP 12.0 > Manuals > Functional Manuals

Informationen zu einem möglichen CCP Release 11.0 im 4. Quartal 2016 werden zu einem späteren Zeitpunkt zur Verfügung gestellt.

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.

22. März 2016