



eurex clearing

rundschreiben 187/14

Datum: 19. Dezember 2014
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

CCP Release 9.2: Ankündigung der Einführung

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 177/14

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

Zielgruppe:

➔ Alle Abteilungen

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 9.2 am **22. Juni 2015** und den damit verbundenen ersten Migrationsschritt (Welle 1) von TARGET2-Securities (T2S) an.

CCP Release 9.2 umfasst die folgenden Änderungen:

- Abschaffung der MISS-Infrastruktur
- T2S: Änderung der Verarbeitung von Wertpapier-Bruchteilen bei Kapitalmaßnahmen in der Abwicklungslokation SIX SIS
- Erweiterung der Services des Wertpapierleihe-CCP der Eurex Clearing

Für CCP Release 9.2 wird ab April 2015 eine Teilnehmersimulation angeboten. Die Simulation für die Funktionalität des Wertpapierleihe-CCP wird ab Mai 2015 angeboten.



CCP Release 9.2: Ankündigung der Einführung

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 9.2 am 22. Juni 2015 und den damit verbundenen ersten Migrationsschritt (Welle 1) von TARGET2-Securities (T2S) an.

Abschaffung der MISS-Infrastruktur

Es ist geplant, mit der Einführung von CCP Release 9.2 die bestehenden CCP VALUES API- und MISS-Infrastruktur abzuschaffen.

Damit einher geht auch die Abschaffung von:

- @X-pert Clearing GUI einschließlich dem Zugang über Webtrading
 - alternativ steht das Securities Clearing GUI zur Verfügung
- VALUES API
 - alternativ kann das Member File Based and SWIFT Interface genutzt werden
- Reportversand über die MISS-Infrastruktur
 - alternativ können die Reports über die Common Report Engine bezogen werden.

T2S: Änderung der Verarbeitung von Wertpapier-Bruchteilen bei Kapitalmaßnahmen in der Abwicklungslokation SIX SIS

T2S Welle 1 hat keine Auswirkungen auf das Abwicklungskonzept von Eurex Clearing. Bitte beachten Sie Eurex Clearing-Rundschreiben 177/14, in dem erste Informationen zu den Auswirkungen von T2S auf der Kundenseite gegeben wurden.

SIX SIS hat angekündigt, dass die Standards der Corporate Action Sub-Group (CASG) und der Corporate Actions Joint Working Group (CAJWG) im Schweizer Markt für alle Abwicklungstransaktionen (einschließlich der Abwicklungen in Schweizer Franken) umgesetzt werden.

Das bedeutet, dass alle Wertpapier-Bruchteile auf die nächste ganze Zahl abgerundet werden. Eurex Clearing wird ihre Prozesse für die Verarbeitung von Bruchteilen entsprechend anpassen.

Erweiterung der Services des Wertpapierleihe-CCP der Eurex Clearing

Eurex Clearing wird ihre bestehenden CCP-Services für die Wertpapierleihe (Securities Lending) um das Angebot von „Hard Fixed Term Loans“ und „Equity Financing Loans“ erweitern.

„Hard Fixed Term Loans“

„Hard Fixed Term Loans“ sind Darlehen mit einer Rückliefervereinbarung zu einem im Voraus festgelegten Fälligkeitstag, die selbst bei Ausfall eines Clearing-Mitglieds (CM) bis zum Fälligkeitstag offen bleiben.

„Hard Fixed Term Loans“ können optional nur dann vor dem Fälligkeitstag geschlossen werden, wenn eine bilaterale Schließvereinbarung zwischen dem Darlehensgeber-CM und dem Darlehensnehmer-CM in Form eines „Matched Return“ auf der Plattform des Third-Party-Flow-Provider existiert. Diese Art Darlehen wird gegen Nominalsicherheiten in Form von Geld oder Wertpapieren angeboten.

Bei dem Angebot von „Hard Fixed Term Loans“ handelt es sich um einen zusätzlichen optionalen Service, für den sich die Clearing-Mitglieder freischalten lassen müssen. Für „Hard Fixed Term Loans“ gegen Nominalsicherheiten in Form von Wertpapieren müssen Clearing-Mitglieder das „Standard Collateral Eligibility Set“ der Eurex Clearing bei den jeweiligen Dritt-Sicherheitenverwaltern (d. h. Clearstream Banking Luxemburg und Euroclear Bank) für diese Darlehensart anerkennen.

„Equity Financing Loans“

Bei „Equity Financing Loans“ handelt es sich um einen neuen Darlehentyp, bei dem das Darlehensgeber-CM dem Darlehensnehmer-CM Geld gegen Nominalsicherheiten in Form von Wertpapieren liefert. Diese Sicherheiten werden an das Darlehensgeber-CM verpfändet oder durch Eigentumsübertragung überstellt. Bei „Equity Financing Loans“ kann die Darlehenswährung Euro oder U.S.-Dollar sein. „Equity Financing Loans“ werden „Hard Fixed Term Loans“ sein.

Weitere Informationen

Für CCP Release 9.2 wird ab April 2015 eine Teilnehmersimulation angeboten. Die Simulation für die Funktionalität des Wertpapierleihe-CCP wird ab Mai 2015 angeboten.

Der Kommunikationskalender mit dem Überblick über die geplanten Veröffentlichungen für CCP Release 9.2 wird im Januar 2015 veröffentlicht.

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte das Trading & Clearing Services Team unter Tel. +49-69-211-1 17 00 oder E-Mail: memberservices@eurexclearing.com.

19. Dezember 2014