



eurex clearing

rundschreiben 132/15

Datum: 16. November 2015
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

CCP Release 11.0: Ankündigung der Einführung

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

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

Zielgruppe:

☞ Alle Abteilungen

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

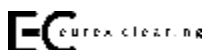
Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 11.0 am **12. September 2016** an.

Bitte beachten Sie: Euroclear hat die Europäische Zentralbank (EZB) informiert, dass die Zentralverwahrer (CSDs) der ESES-Märkte (Frankreich, Belgien und die Niederlande) nicht im März 2016 zu T2S migrieren werden. Daher können sich, abhängig von der neuen EZB-Planung für T2S, die Projektdaten noch ändern.

CCP Release 11.0 ist für alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing verpflichtend und bezieht sich auf die Einführung von T2S Welle 3.

Die von Eurex Clearing angebotenen Services werden für T2S, dem neuen europäischen Wertpapierabwicklungssystem des Eurosystems, angepasst. Eurex Clearing wird ihre bestehenden Prozesse und Produkte anpassen, um fortlaufende Services für alle betroffenen Kunden in der neuen T2S-Umgebung sicherzustellen. Außerdem wird Eurex Clearing ihre Systeme und Prozesse anpassen, um von Kunden bevorzugte Änderungen zu berücksichtigen, die auf der neuen Funktionalität von T2S basieren.

Für CCP Release 11.0 / T2S Welle 3 ist ab dem **21. März 2016** eine Teilnehmersimulation geplant.



CCP Release 11.0: Ankündigung der Einführung

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 11.0 am 12. September 2016 an.

Bitte beachten Sie: Euroclear hat die Europäische Zentralbank (EZB) informiert, dass die Zentralverwahrer (CSDs) der ESES-Märkte (Frankreich, Belgien und die Niederlande) nicht im März 2016 zu T2S migrieren werden. Daher können sich, abhängig von der neuen EZB-Planung für T2S, die Projekt-Migrationsdaten noch ändern.

CCP Release 11.0 ist für alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing verpflichtend.

In der dritten Migrationswelle von T2S am 12. September 2016 wird Clearstream Banking Frankfurt (CBF) ihr Wertpapierabwicklungsgeschäft auf T2S, dem neuen europäischen Wertpapierabwicklungssystem in Zentralbankgeld, migrieren.

Die Umsetzung von T2S Welle 3 betrifft die von Eurex Clearing angebotenen Services, die angepasst werden, um die T2S-Anforderungen zu erfüllen. Eurex Clearing wird ihre bestehenden Prozesse und Produkte anpassen, um fortlaufende Services für alle betroffenen Kunden in der neuen T2S-Umgebung sicherzustellen. Außerdem wird Eurex Clearing ihre Systeme und Prozesse anpassen, um von Kunden bevorzugte Änderungen zu berücksichtigen, die auf der neuen Funktionalität von T2S basieren.

Die folgenden Änderungen werden mit CCP Release 11.0 eingeführt:

- **Neuer T2S-Geschäftstag:** Anpassung des Eurex Clearing-Geschäftstags an T2S-Zeitpläne.
- **Liefermanagement:** Einführung neuer Annahmeschluss-Zeiten für die verschiedenen Instrumente und Einführung von untertägigen Aggregationsläufen; Änderungen in der Säumnisbearbeitung und in der generellen Nutzung der T2S-Funktionen.
- **Cash:** Angemessene Bearbeitung von Zahlungsläufen und deren Auswirkungen auf das Liefermanagement und auf Einschränkungen wegen Zeitbegrenzungen von externen Systemen und Entitäten.
- **Brutto-Liefermanagement (BLM):** Anpassung von BLM entsprechend des neuen T2S-Geschäftstags.
- **Kapitalmaßnahmen:** Änderungen, die nach den geplanten Anpassungen der Zentralverwahrer vorgenommen werden, um eine Harmonisierung im Bereich der Kapitalmaßnahmen zu erreichen.
- **Reporting:** Batch-Reporting wird auf das fortlaufende Reporting umgestellt, und es gibt Änderungen im Reporting-Ablauf und Anpassungen in den Reports.

Detaillierte Informationen finden Sie im Dokument „T2S wave 3 - Preliminary Functional Notes - Update“, das in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com am 14. September 2015 unter dem folgenden Pfad veröffentlicht wurde:

Technology > CCP Releases > T2S - wave 3 > Manuals > Functional Manuals

Simulation

Ab dem 21. März 2016 ist für CCP Release 11.0 / T2S Welle 3 eine Teilnehmersimulation geplant.

Weitere Informationen zur Teilnehmersimulation sind im Dokument „Member Simulation Guide“ enthalten, das in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website am 18. Dezember 2015 veröffentlicht wird.

Veröffentlichung von Dokumenten

In der Eurex Clearing Member Section auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com haben wir das unten aufgeführte Dokument veröffentlicht, um Ihre Vorbereitungen auf die Einführung von CCP Release 11.0 zu unterstützen.

Veröffentlichtes funktionales Dokument	
Update	Member Communication Calendar
Pfad	www.eurexclearing.com > Eurex Clearing <u>Member Section</u> > Technology > CCP Releases > CCP 11.0 > Functional Manuals

Sollten Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Trading & Clearing Services unter der Tel. +49-69-2 11-1 17 00 oder der E-Mail: memberservices@eurexclearing.com.

16. November 2015