clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 052/10

Datum: Frankfurt, 26. Juli 2010
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

1. CCP 6.0: Dokumente, 2. Änderungen in den CCP Fee Reports, 3. Client Asset Protection (CAP)

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 014/10, 021/10, 034/10

Kontakt: Member Services & Admission, Tel. +49-69-211-1 17 00, Fax +49-69-211-1 17 01

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhänge:

Nur auf der Eurex Clearing Website, nur in englischer Sprache:

1. Funktionale und Technische Handbücher
2. Final VALUES API Member Front End Development Guide
3. VALUES API Header File (Unix und Windows)
4. Antragsformulare für Xetra International Market

Zusammenfassung:

Im Rahmen der Einführung von CCP 6.0 stellen wir Ihnen heute zur Vorbereitung auf den Release-Start am **8. November 2010** weitere Dokumente zur Verfügung. Die Dokumente stehen auf der Eurex Clearing Website zum Herunterladen bereit.

Im Zusammenhang mit der Einführung von neuen Märkten im Rahmen von Xetra International Market wurden die Antragsformulare angepasst und zum Herunterladen veröffentlicht.

Bitte beachten Sie, dass das Angebot des neuen Service für Xetra International Market ab dem 22. November 2010 zur Verfügung steht.

Das vorliegende Rundschreiben enthält außerdem eine Beschreibung der mit CCP 6.0 in Kraft tretenden Änderungen in den CCP Fee Reports.

Sollten Sie Fragen haben oder zusätzliche Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte unser Team Member Services & Admission unter Tel. +49-69-211-1 17 00 oder Fax +49-69-211-1 17 01.

Eurex Clearing AG
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
customer.support@eurexchange.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Prof. Dr. Peter Gomez

Vorstand:
Andreas Preuß (Vorsitzender), Jürg Spillmann, Thomas Book, Gary Katz, Michael Peters, Peter Reitz

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

1. CCP 6.0: Dokumente, 2. Änderungen in den CCP Fee Reports, 3. Client Asset Protection (CAP)

1. CCP 6.0: Dokumente

Im Rahmen der Einführung von CCP 6.0 stellen wir Ihnen heute zur Vorbereitung auf den Start des neuen CCP-Release weitere Dokumente zur Verfügung:

- Release Notes
- CCP User Guide
- Member Simulation Guide
- Description of Report Layouts
- Description of Reports - Raw Data
- Member File Based & SWIFT Interface
- Final VALUES API Member Front End Development Guide
- VALUES API Header File (Unix und Windows)
- MT512 based CCP Reports – Format Selection

Wie in früheren Releases stehen die Dokumente ausschließlich in englischer Sprache zur Verfügung.

Release Notes

Das Dokument beschreibt die funktionalen Änderungen am CCP-System in Zusammenhang mit CCP Release 6.0, das am 8. November 2010 eingeführt wird. Es enthält die Spezifikation der Weiterentwicklungen im CCP (Änderungen der Reports, Erweiterung des Abwicklungskontos und CCP-Password Ageing-Funktionalität) sowie Informationen zur Einführung von weiteren Märkten auf der Handelsplattform Xetra International Market (Erweiterung des Eurex Clearing-Abwicklungsnetzwerks) sowie eine Beschreibung der aus der Client Asset Protection (CAP) resultierenden Änderungen am CCP-System.

CCP User Guide

Das Dokument beschreibt das Browser-basierte Graphical User Interface (GUI) des CCP (@X-PERT), das von Teilnehmern für die Abwicklung von aktienähnlichen und anleihenähnlichen Instrumenten benutzt wird.

Member Simulation Guide

Das Dokument erläutert den Simulationsansatz für CCP Release 6.0 und liefert Eckdaten zu Aktivitäten auf Teilnehmerseite, die für eine erfolgreiche Teilnahme an der Simulation erforderlich sind. Zusätzlich enthält der Member Simulation Guide den detaillierten Simulationskalender und eine Liste der verfügbaren Instrumente.

Description of Report Layouts

Das Dokument beschreibt den Inhalt und das Format der mit CCP Release 6.0 zur Verfügung gestellten Reports.

Description of Report Raw Data

Dieses Dokument legt den Inhalt der Reports, Rohdatenträger und Dateien dar, die vom CCP generiert werden.

Member File Based & SWIFT Interface

Das Dokument enthält Detailinformationen zum technischen Aufbau der SWIFT-basierten Reporting-Schnittstellen zwischen CCP, Handelsteilnehmern, Clearing-Teilnehmern und Abwicklungsinstituten.

Die genannten Dokumente stehen unter dem folgenden Pfad zur Verfügung:

www.eurexclearing.com > Member Section > Releases > CCP 6.0 > Manuals > Functional & Technical Manuals

VALUES API Member Front End Development Guide – Final Version including Header Files for Unix and Windows

Dieses Dokument dient als Leitfaden für die Entwicklung und Implementierung von Applikationen. Es kann unter folgendem Pfad herunter geladen werden:

www.eurexclearing.com > Member Section > Releases > CCP 6.0 > VALUES API

MT512 based CCP Reports – Format Selection

Mit der Einführung der Erweiterung der Länge der Abwicklungskonten auf 35 Zeichen können CCP-Mitglieder, die Eurex Clearing - International Services nutzen, das Format der Reports auswählen, die auf dem SWIFT-ähnlichen Format „MT512 - Trade confirmation“ basieren. Dabei werden zwei Formate des MT512 unterstützt: das derzeitige „klassische“ Format und das neue „erweiterte“ Format. Die Nutzung des jeweiligen Formats richtet sich nach der Länge des genutzten Abwicklungskontos, d.h. als Standardeinstellung gilt das klassische Format, bei Nutzung der erweiterten Länge ist das erweiterte Format auszuwählen.

Das zur Auswahl des erweiterten Formats erforderliche Formular kann unter dem folgenden Pfad herunter geladen werden:

www.eurexclearing.com > Dokumente > Formulare > Xetra International Market (XIM) > Einzelformulare > Technisch

Antragsformulare für Xetra International Market

Im Zusammenhang mit der Einführung von zusätzlichen Märkten im Rahmen von Xetra International Market am 22. November 2010, wurden die Formulare für die Länder Dänemark, Norwegen, Österreich, Portugal und Schweden angepasst und zum Herunterladen veröffentlicht.

- Antrag auf Einrichtung/Löschung/Änderung von CCP-Settlement-Konten in Dänemark (VP Securities A/S)
- Antrag auf Einrichtung/Löschung/Änderung von CCP-Settlement-Konten in Norwegen (Verdipapirsentralen ASA)
- Antrag auf Einrichtung/Löschung/Änderung von CCP-Settlement-Konten in Österreich (Österreichische Kontrollbank AG)
- Antrag auf Einrichtung/Löschung/Änderung von CCP-Settlement-Konten in Portugal (Interbolsa S.A.)
- Antrag auf Einrichtung/Löschung/Änderung von CCP-Settlement-Konten in Schweden (Euroclear Sweden AB)
- Antrag auf Einrichtung/Löschung/Änderung von Clearer-Konten

Aufgrund von noch andauernden Prüfungen im regulatorischen Umfeld werden die Antragsformulare für Griechenland und Polen zu einem späteren Zeitpunkt veröffentlicht.

Wenn ein Teilnehmer seine Handelsaktivitäten im Segment Xetra International Market um neue Märkte erweitern möchte, ist es erforderlich, ein Antragsformular für die entsprechenden Länder einzureichen.

Die Formulare stehen auf der Eurex Clearing Website unter dem folgenden Pfad zur Verfügung:

www.eurexclearing.com > Dokumente > Formulare > Xetra International Market (XIM) > Einzelformulare > Rechtlich & Regulatorisch

2. Änderungen in den CCP Fee Reports

Aufgrund der Erweiterung des bestehenden Felds „Settlement Account" und der Einführung des neuen Felds „Settlement Currency" in den CCP Fee Reports, wird am 9. August 2010 als Teil der Eurex Release 13.0-Dokumentation im Eurex XML Report Reference Manual eine aktualisierte Beschreibung der Reports veröffentlicht. Das Dokument kann unter dem folgenden Pfad herunter geladen werden:

www.eurexchange.com > Member Section > Releases > Eurex 13.0 > Manuals > Technical Manuals.

3. Client Asset Protection (CAP)

Die neue CAP-Funktionalität, die auch das Pool ID-Konzept beinhaltet, wird technisch mit der Einführung von Eurex Release 13.0 und CCP Release 6.0 am 8. November 2010 zur Verfügung stehen.

In Angleichung an die derzeitigen regulatorischen Entwicklungen ist es geplant, den Clearing-Mitgliedern und ihren Kunden den neuen CAP-Service in der ersten Jahreshälfte 2011 bereitzustellen.

Um den Teilnehmern ausreichend Vorbereitungszeit zu bieten, ist das Testen des neuen Service in der Simulationsumgebung schon ab September 2010 möglich.

Der produktive Start von CCP Release 6.0 ist für den 8. November 2010 vorgesehen. Die Erweiterung von Xetra International Market ist für den 22. November 2010 geplant.

Sollten Sie Fragen haben oder zusätzliche Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte unser Team Member Services & Admission unter Tel. +49-69-211-1 17 00 oder Fax +49-69-211-1 17 01.

Frankfurt, 26. Juli 2010