clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 134/17

Datum: 18. Dezember 2017
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

CCP Release 14.0: Update; CCP Release 14.5: Ankündigung der Einführung

Kontakt: Ihr Group Client Key Account Manager Clearing, clearing.services-admission@eurexchange.com

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ Alle Abteilungen	keine

Zusammenfassung:

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing ein Update von CCP Release 14.0 am **19. Februar 2018** sowie die Einführung von CCP Release 14.5 am **26. März 2018** an.

Das Update von CCP Release 14.0 ist ein Pflicht-Release für alle Clearing-Mitglieder. Für die folgenden Reports erweitert Eurex Clearing die Verfügbarkeit von Informationen auf Ebene der C7-Kontennamen:

- RPTCA130 COMPENSATION PARTNER
- RPTCA160 CUSTODY PAYMENT STATEMENT
- RPTCD250 SETTLED CASH TRANSACTIONS

Eine Mitgliedersimulation für das Update von CCP Release 14.0 wird ab dem **12. Januar 2018** angeboten.

CCP Release 14.5 ist ein Pflicht-Release für alle Lending CCP Clearing-Mitglieder, die das Verpfändungsmodell für mit Wertpapieren besicherte Darlehenstransaktionen nutzen. Es enthält die folgende Änderung:

- Lending CCP von Eurex Clearing: Einführung eines durch den CCP besicherten Verpfändungsmodells

Eine Mitgliedersimulation für CCP Release 14.5 wird ab dem **1. März 2018** angeboten.

eurex clearing

Eurex Clearing AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Dr. Hugo Bänziger

Vorstand:
Erik Tim Müller (Vorsitzender),
Heike Eckert (stv. Vorsitzende),
Matthias Graulich,
Thomas Laux,
Manfred Matusza

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
USt-IdNr. DE194821553
Amtsgericht Frankfurt/Main

CCP Release 14.0: Update; CCP Release 14.5: Ankündigung der Einführung

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing ein Update von CCP Release 14.0 am 19. Februar 2018 sowie die Einführung von CCP Release 14.5 am 26. März 2018 an.

Das Update von CCP Release 14.0 ist ein Pflicht-Release für alle Clearing-Mitglieder.

CCP Release 14.5 ist ein Pflicht-Release für alle Lending CCP Clearing-Mitglieder, die das Verpfändungsmodell für mit Wertpapieren besicherte Darlehenstransaktionen nutzen.

1. Update von CCP Release 14.0 für ausgewählte Reports

Mit dem Update von CCP Release 14.0 erweitert Eurex Clearing die Verfügbarkeit von Informationen auf Ebene von C7-Kontonamen für die folgenden Reports:

- RPTCA130 COMPENSATION PARTNER
- RPTCA160 CUSTODY PAYMENT STATEMENT
- RPTCD250 SETTLED CASH TRANSACTIONS

Für jeden Report wird das Feld „C7 ACCT. NAME" zur Verfügung gestellt.

Weitere Details sind den Dokumenten „CCP Release 14.0 Update – Description of Reports – Formatted Layout" und „CCP Release 14.0 Update – Description of Reports – RAW Data" zu entnehmen, die ab dem 22. Dezember 2017 auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link zur Verfügung stehen:

Technology > Eurex Clearing's Securities CCP > System documentation > Release 14.0

2. Einführung eines durch den CCP besicherten Verpfändungsmodells für mit Wertpapieren besicherte Darlehenstransaktionen für den Lending CCP-Service von Eurex Clearing

Mit CCP Release 14.5 führt Eurex Clearing für seinen Lending CCP ein besichertes Verpfändungsmodell für mit Wertpapieren besicherte Darlehenstransaktionen ein. Das durch den CCP besicherte Verpfändungsmodell ersetzt das derzeitige Verpfändungsmodell.

Ab dem 26. März 2018 werden in dem neuen Modell alle neuen Darlehenstransaktionen als durch den CCP besicherte Darlehenstransaktionen eröffnet. Darlehenstransaktionen, die vor diesem Zeitpunkt an unter dem derzeitigen Verpfändungsmodell eröffnet wurden, werden nicht auf das neue durch den CCP besicherte Verpfändungsmodell migriert.

Innerhalb des durch den CCP besicherten Verpfändungsmodells stellt die Bewegung von Sicherheiten zwischen dem Konto des CM-Leihers und dem Eurex Clearing-Konto beim jeweiligen „Tri-party Collateral Agent" eine vollständige Eigentumsübertragung dar. Auf dem Eurex Clearing-Konto eingegangene Vermögenswerte werden zugunsten des CM-Verleihers verpfändet. Während des gesamten „Lebenszyklus" der Darlehenstransaktion bleiben die Sicherheitenwerte auf diesem Konto. Beim entsprechenden „Tri-party Collateral Agent" wird pro CM-Verleiher und „Eligibility Profile" ein dediziertes Eurex Clearing-Konto eröffnet.

CM-Verleihern wird beim „Tri-party Collateral Agent" eine Berichtsvollmacht eingeräumt. Dem bestehenden Verhalten entsprechend, liefert der „Tri-party Collateral Agent" die neue „Exposure ID" im Report „RPTTL750 Exposure Reference".

Das neue durch den CCP besicherte Verpfändungsmodell kann auch für die Saldierung von Risikopositionen von mit Wertpapieren besicherten Darlehenstransaktionen genutzt werden.

3. Nominierung von Release-Kontakten

Bitte benennen Sie mindestens einen Projektkoordinator sowie einen Simulations-„SPOC", der für CCP Release 14.5 verantwortlich ist und registrieren Sie diese über die Member Section auf der Eurex Clearing Website unter dem folgenden Pfad:

Member Section > Kontakte > Ihre internen Kontakte > Release-Kontakte

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Ihren Group Client Key Account Manager Clearing oder senden Sie eine E-Mail an: clearing.services-admission@eurexclearing.com.

18. Dezember 2017