clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 017/17

Datum: 21. Februar 2017
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

CCP Release 13.0: Ankündigung der Einführung

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 018/15, 072/15

Kontakt: Ihr Group Client Key Account Manager Clearing

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

Zusammenfassung:

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 13.0 am **19. Juni 2017** an.

Es enthält die folgenden Änderungen:

- Neue Clearing-Lösung für den Wertpapierleihe- und Anleihemarkt im Vereinigten Königreich:
  - Anbindung an das CREST-System der Abwicklungslokation Euroclear UK & Ireland ('EUI')
  - Abwicklungslokation CREST wird in den Reports hinzugefügt
- Xetra®, der vollelektronische Handelsplatz der Gruppe Deutsche Börse, wird den Kassamarkthandel auf die moderne Handelsarchitektur T7 migrieren. CCP Release 13.0 ermöglicht, Kassamarkt-geschäfte aus T7 zu verrechnen.

Eine Mitgliedersimulation mit den Weiterentwicklungen im Rahmen des CCP Release 13.0 wird ab dem **11. Mai 2017** angeboten.

Clearing-Mitglieder für Securities Lending und Clearing-Mitglieder der Frankfurter Wertpapierbörse werden gebeten, ihre registrierten CCP Release-Kontakte in der Eurex Clearing Member Section zu überprüfen.

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 13.0: Ankündigung der Einführung

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 13.0 am 19. Juni 2017 an.

Es enthält die folgenden Änderungen:

- Neue Clearing-Lösung für den Wertpapierleihe- und Anleihemarkt im Vereinigten Königreich:
  - Anbindung an das CREST-System der Abwicklungslokation Euroclear UK & Ireland ('EUI')
  - Abwicklungslokation CREST wird in den Reports hinzugefügt
- Xetra®, der vollelektronische Handelsplatz der Gruppe Deutsche Börse, wird den Kassamarkthandel auf die moderne Handelsarchitektur T7 migrieren. CCP Release 13.0 ermöglicht, Kassamarktgeschäfte aus T7 zu verrechnen.

Eine Mitgliedersimulation mit den Weiterentwicklungen im Rahmen des CCP Release 13.0 wird ab dem 11. Mai 2017 angeboten.

Clearing-Mitglieder für Securities Lending und Clearing-Mitglieder der Frankfurter Wertpapierbörse werden gebeten, ihre registrierten CCP Release-Kontakte in der Eurex Clearing Member Section zu überprüfen.

Eurex Clearing's Service-Erweiterung für CCP-Leihe

Eurex Clearing's CCP-Service für Wertpapierleihe wird an EUI angebunden. Eurex Clearing wird die zugehörigen Transaktionstypen 'SLO' ('stock loan opening') / 'SLR' ('stock loan return') verwenden, die von EUI/CREST für die Abwicklung von Leihen angeboten werden. Die SLO-Verarbeitung wird eine automatische Rücklieferung (SLR) durch das CREST-System verursachen.

Weitere Informationen zu den Erweiterungen für die CCP-Leihe sind in dem Dokument „Release Notes CCP 13.0" enthalten, das auf der Website der Eurex Clearing www.eurexclearing.com ab dem 20. März 2017 unter dem folgenden Link veröffentlicht ist:

Technologie > Eurex Clearing's Securities CCP > Systemdokumentation > Release 13.0 > CCP Release 13.0 Release Notes

Der CCP erhält Xetra®-Geschäfte über die Handelsarchitektur T7

Der Handelsplatz Xetra® wird auf T7 migriert und als Teil dieser Migration wird der CCP ab der Einführung von CCP Release 13.0 Geschäfte von T7 erhalten.

Im Gegensatz zum Xetra®-System ist die Geschäftsnummer im T7-System pro Handelsplatz (MIC) und ISIN pro Geschäftstag eindeutig. Daher wird mit der Einführung von CCP Release 13.0 die eindeutige Geschäftsidentifikation aus einer Kombination von Handelsplatz (MIC) und ISIN pro Geschäftstag garantiert. Es wird sichergestellt, dass dies keine Prozesse im CCP-System beeinträchtigt.

Die 20-Stellen der System-Order-ID des T7-Systems werden automatisch umgewandelt, da die Feldlänge im CCP-System auf 13 alphanumerische Stellen beschränkt ist. Die Umstellung erfolgt über das Horner-Schema, um die System-Order-ID neu zu berechnen, die als Dezimalzahl (Basis 10), zur Basis 36 angegeben wird.

Detaillierte Informationen zur Xetra®-Migration auf die T7-Handelsarchitektur sind in Xetra-Rundschreiben 029/16 oder in der Eurex T7-Veröffentlichung „Cash Market Migration - Customer Slides" auf der Xetra-Website www.xetra.com unter dem folgenden Link verfügbar:

Technologie > T7 Handelarchitektur

Simulation

Ab dem 11. Mai 2017 ist für CCP Release 13.0 eine Mitgliedersimulation geplant.

Registrierung der Release-Kontakte

Clearing-Mitglieder für Securities Lending und Clearing-Mitglieder der Frankfurter Wertpapierbörse werden gebeten, ihre registrierten CCP Release-Kontakte in der Eurex Clearing Member Section zu überprüfen. Weitere Kommunikation über CCP Release 13.0 wird nur an diese registrierten Release-Kontakte verschickt.

Sollten Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Ihren Group Client Key Account Manager Clearing.

21. Februar 2017