

clear to trade



eurex clearing

rundschreiben 117/17

Datum: 16. November 2017
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendors
Autorisiert von: Heike Eckert

CCP Release 14.0: Funktionen zur Produktionseinführung am 20. November 2017

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 072/17

Kontakt: Ihr Clearing Key Account Manager oder clearing.services-admission@eurexclearing.com

Zielgruppe:

➔ Alle Abteilungen

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Wie bereits mit Eurex Clearing-Rundschreiben 072/17 angekündigt, wird CCP Release 14.0 am **20. November 2017** eingeführt.

Die folgenden Funktionen werden am **20. November 2017** in Produktion eingeführt:

- 1. Verbesserung des „Cash Forecast“ der Clearstream Banking Frankfurt (CBF)**
- 2. Neue Zeitplanung für den Report „CE250 - Partial Delivery Deviating Cash Amount“**

Weiterhin erfolgt zum selben Zeitpunkt die technische Einführung der folgenden Funktionalität in Produktion:

- 3. Einführung einer „Exposure Netting“-Funktionalität für mit Wertpapieren besicherte Darlehenstransaktionen für den Wertpapierleihe-CCP-Service der Eurex Clearing**

Die funktionale Einführung ist für den **11. Dezember 2017** geplant.



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: Funktionen zur Produktionseinführung am 20. November 2017

Wie bereits mit Eurex Clearing-Rundschreiben 072/17 angekündigt, wird CCP Release 14.0 am 20. November 2017 eingeführt.

Die folgenden Funktionen werden am 20. November 2017 in Produktion eingeführt:

- 1. Verbesserung des „Cash Forecast“ der Clearstream Banking Frankfurt (CBF)**
- 2. Neue Zeitplanung für den Report „CE250 - Partial Delivery Deviating Cash Amount“**

Weiterhin erfolgt zum selben Zeitpunkt die technische Einführung der folgenden Funktionalität in Produktion:

- 3. Einführung einer „Exposure Netting“-Funktionalität für mit Wertpapieren besicherte Darlehenstransaktionen für den Wertpapierleihe-CCP-Service der Eurex Clearing**

Die funktionale Einführung ist für den 11. Dezember 2017 geplant.

- 1. Verbesserung des „Cash Forecast“ der Clearstream Banking Frankfurt (CBF)**

Um den Informationswert des CCP-Reports „CD270 - Cash Forecast for STD/NTP“ zu verbessern, wird der Report durch die Aufnahme von „NCSC-Bonds“, die von Eurex Clearing abgerechnet werden, erweitert.

- 2. Neue Zeitplanung für den Report „CE250 - Partial Delivery Deviating Cash Amount“**

Auf T2-Konten gebuchte Anpassungszahlungen (Teilabwicklungen) in Euro werden im Geld-Lauf DTP6 nach der Bereinigung der Lieferinstruktionen instruiert. Der Report „CE250 - Partial Delivery Deviating Cash Amount“, der speziell zum Reporting dieser Zahlungen aufgesetzt wurde, wird derzeit mit dem Tagesend-Reporting generiert. Mit der Einführung von CCP Release 14.0 wird die Generierung des Reports „CE250“ auf einen Zeitrahmen nach der Bereinigung der Lieferinstruktionen verschoben, zwischen 16:30 Uhr MEZ und der Nachtverarbeitung um 18:00 Uhr MEZ. Somit wird den Mitgliedern ermöglicht, die Zahlungen am selben Geschäftstag abzustimmen.

- 3. Einführung einer „Exposure Netting“-Funktionalität für mit Wertpapieren besicherte Darlehenstransaktionen für den Wertpapierleihe-CCP-Service der Eurex Clearing**

Die funktionale Einführung ist für den 11. Dezember 2017 geplant.

Mit CCP Release 14.0 führt der Wertpapierleihe-CCP von Eurex Clearing die Funktionalität für die Aufrechnung von Positionen bei mit Wertpapieren besicherten Darlehenstransaktionen ein.

Das „Collateral Exposure Netting“ wird die Abwicklungseffizienz auf der Wertpapiersicherheitsseite erhöhen sowie die Transaktionskosten und das Volumen der Lieferungen für die Marktteilnehmer reduzieren, die mit Wertpapieren besichert sind (NCC).

Zur Verbesserung der Sichtbarkeit der „Tri Party Collateral Agent (TPCA) Exposure ID“ wird die Sortierreihenfolge im Report „RPTTL750 - Exposure Reference“ geändert, sodass die „TPCA Exposure ID“ nun an dritter Stelle anstatt an 15. Stelle steht.

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

16. November 2017