clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 072/17

Datum: 7. August 2017
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

CCP Release 14.0: Ankündigung der Einführung

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

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

Zusammenfassung:

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 14.0 am **20. November 2017** an.

CCP Release 14.0 hat Auswirkungen auf die Lending CCP-Mitglieder sowie auf die CCP-Services. Es ist ein fakultatives Release für alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und enthält die folgenden Änderungen:

- Eurex Clearing's Wertpapierleihe-CCP: Einführung einer „Exposure Netting"-Funktionalität für mit Wertpapieren besicherte Darlehenstransaktionen
- CCP-Services:
  - Verbesserung des „Cash Forecast" von Clearstream Banking Frankfurt (CBF). Report „CD270 - Cash Forecast for STD/NTP" wird um „NCSC Bonds" erweitert.
  - Report „CE250 – Partial Delivery Deviating Cash Amount" wird nach der Bereinigung der Lieferinstruktionen erstellt, um Mitgliedern die Möglichkeit zu geben, die Kontenabstimmung am selben Geschäftstag vorzunehmen.

Eine Mitgliedersimulation für CCP Release 14.0 wird ab dem **9. Oktober 2017** 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: Ankündigung der Einführung

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing die Einführung von CCP Release 14.0 am 20. November 2017 an.

CCP Release 14.0 ist ein fakultatives Release für alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG.

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

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

Das „Collateral Exposure Netting" soll die Abwicklungseffizienz auf der Wertpapiersicherheitenseite 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 Sortierungsreihenfolge im Report „RPTTL750 - Exposure Reference" geändert, sodass die „TPCA Exposure ID" weiter vorn erscheint.

2. Verbesserung des „Cash Forecast" der Clearstream Banking Frankfurt (CBF)

Um den Informationswert des „Cash Forecast" von CBF zu verbessern, fügt Eurex Clearing zusätzliche Anleiheinformationen hinzu.

Bitte beachten Sie, dass in diesem Zusammenhang auch der CCP-Report „CD270 - Cash Forecast for STD/NTP" durch die Aufnahme von „NCSC-Bonds" von CBF erweitert wird.

Weitere Informationen zum „Cash Forecast" von CBF sind der Clearstream Website www.clearstream.com unter dem folgenden Link zu entnehmen:

Products and Services > Settlement

3. Neue Zeitplanung für den Report „CE250 – Partial Delivery Deviating Cash Amount"

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

Weitere Informationen zum Report „CE250 - Partial Delivery Deviating Cash Amount" sind den „CCP 12.0/ T2S wave 4 Release Notes", Description of Reports - RAW Data CCP 12.0" sowie dem Dokument „Description of Reports Formatted layout CCP 12.0" zu entnehmen, welche auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link zum Herunterladen zur Verfügung stehen:

Technology > Eurex Clearing's Securities CCP > System documentation > Release 12.0 / T2S wave 4

4. Simulation

Ab dem 9. Oktober 2017 findet für CCP Release 14.0 eine Mitgliedersimulation statt.

Geplante Szenarien und Instruktionen für die Fokustage für Kapitalmaßnahmen sind im „Member Simulation Guide" enthalten, der am 14. August 2017 in der Member Section der Eurex Clearing Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht wird:

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

5. Nominierung von Release-Kontakten

Bitte benennen Sie mindestens einen Projektkoordinator sowie einen Simulations-„SPOC", der für CCP Release 14.0 verantwortlich ist und registrieren Sie diese über die Member Section auf der Eurex Clearing Website unter dem folgenden Pfad:

Member Section > Contacts > Your internal contacts > Release Contacts

Die weitere Kommunikation wird nur an diese registrierten Release-Kontakte verschickt. Details zur Simulationsumgebung sowie zur aktualisierten Dokumentation werden rechtzeitig über „Newsflash" veröffentlicht.

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@deutsche-boerse.com.

7. August 2017