X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 028/05*

Datum: Frankfurt, 28. Februar 2005
Empfänger: Alle Eurex-Mitglieder und Vendoren, CCP-Teilnehmer
Autorisiert von: Daniel Gisler

⚠ **Hohe Priorität**

CCP 3.0 – Finale funktionale und technische Dokumentation

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 149/04, 157/04

Kontakt: FI CCP Change Management Team, Tel. +49-69-211-1 16 60,
E-Mail: ccp.fi@eurexchange.com

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ Alle Abteilungen	Nur in englischer Sprache und auf der Eurex-Webseite

Zusammenfassung:

Zur Vervollständigung der verfügbaren funktionalen und technischen Dokumentation für CCP Release 3.0 (Fixed Income CCP) hat Eurex Clearing AG nun nachstehend aufgeführte Dokumente veröffentlicht:

Finalfassungen:

- Member File-based and SWIFT Interface - Update
- Description Report Raw Data - Update
- Final VALUES API Member Front End Development Guide

Neue Dokumente:

- Description Report Layouts
- User Guide CCP 3.0

In diesem Rundschreiben werden diese Dokumente beschrieben. Für die finalen Versionen bereits veröffentlichter Dokumente, werden die wichtigsten Änderungen erläutert.

Die vorgenannten Dokumente wurden in der Member Section der Eurex-Website veröffentlicht. Zum Herunterladen Ihres persönlichen Exemplars besuchen Sie bitte

www.eurexchange.com > Member Section > Documentation/Manuals CCP > CCP 3.0 bzw.

www.eurexchange.com > Member Section > Software Releases CCP > VALUES API Release 3.0.

für den VALUES API Member Front End Development Guide.

CCP 3.0 – Finale funktionale und technische Dokumentation

- **Member File-based and SWIFT Interface - Update**

Dieses bereits mit Rundschreiben 149/04 am 22. Oktober 2004 publizierte Dokument steht nun in seiner Endfassung zur Verfügung. Diese enthält folgende Änderungen:

– 3.1.4.2 Textblock (MT523): Feld 31 P – Trade Date and Location

  Der Wert „XEUR“ wurde in „EDT“ geändert

– 5.4.2 MT536 für CE280:

  Das Dokument wurde um den Report CE280 „Pending Delivery Instructions“ für Nutzer des „Single Instruction Netting“ (SIN) ergänzt.

– 5.4.3 Feldbeschreibung (MT536): Feld 70E –Transaction Details Narrative: Delivery ID.

  Die Syntax “/D 7!x” bleibt für den ECCP unverändert. Für den FI CCP lautet die Syntax“/D 14!x”.

– 5.4.3 Feldbeschreibung (MT536): Feld 94B – Source of Price

  Für den Equity CCP wurden der Ausweis der Werte „XEDF“ und „XEDE“ auf „EDF“ für XONTRO-Geschäfte und „EDE“ für Xetra-Geschäfte korrigiert. Dies entspricht der bislang gültigen Logik für den Ausweis der Handelslokationen.

  Für den FI CCP gelten „EUB“ für Eurex Bonds-Geschäfte, „ERE“ für Eurex Repo-Geschäfte und „EDT“ für Eurex-Geschäfte anstelle der vormals aufgeführten „XEUB“, „XERE“ und „XEUR“.

- **Description Report Raw Data - Aktualisisierung**

Das mit Rundschreiben 149/04 am 22. Oktober 2004 veröffentlichte Dokument wurde überarbeitet und enthält nun den neuen Report RPTCE280 „Pending Delivery Instructions“ für die Nutzer des „Single Instruction Netting“ (SIN). Der Report ist in Kapitel 3 „Overview of Reports, Raw Data and Risk Margin Calculation Files“ aufgeführt und wird in weiteren Einzelheiten in dem Dokument „Member File-based and SWIFT Interface“ (siehe oben) beschrieben.

- **Final VALUES API Member Front End Development Guide**

Das mit Rundschreiben 157/04 vom 10. November 2004 veröffentlichte Dokument wurde überarbeitet und ist nun in seiner Finalfassung verfügbar. Diese Fassung dient als Entwickler-Leitfaden für Entwurf und Implementierung von Applikationen, welche über das VALUES API Standard Interface mit den Börsen-systemen kommunizieren.
Folgende Anpassungen wurden vorgenommen:

– 7.12 – ctryCod:

  Beschreibung: Länder-Code des Wertpapiers. Hierbei handelt es sich um die ersten zwei Buch-staben der Wertpapierkennnummer (ISIN).

– 7.84 – stlRunCod:

  Die gültigen Werte für CCP_STL_RUN_COD_001_VV bis CCP_STL_RUN_COD_010_VV enthalten die Kennzahlen “001” Bis “010”, von denen jede theoretisch einem Settlement Delivery Report mit derselben Nummer entspricht.

  Bitte beachten Sie: Ungeachtet der oben genannten Kennzahlen wird es nur acht untertägige Liefer-Reports geben (Kennzahlen „001“ bis „008“), die entsprechend dem Konzept von CCP Release 3.0 bereitgestellt werden.

Eurex Clearing AG
D-60485 Frankfurt am Main
www.eurexchange.com

Customer Support
Tel. +49-69-211-1 17 00
Fax +49-69-211-1 17 01

Vorstand:
Rudolf Ferscha (Vorsitzender),
Daniel Gisler, Thomas Lenz,
Peter Reitz, Jürg Spillmann

- **Description Report Layouts**

Das Dokument beschreibt den Inhalt der Reports, der Rohdaten-Dateien sowie der vom CCP erzeugten Dateien für die Berechnung der Risiko-Marge.

- **User Guide**

Dieses Dokument enthält die Beschreibung der Browser-basierten grafischen Benutzeroberfläche (GUI) für CCP Release 3.0. Diese umfasst die Funktionalität für Aktien, wie sie bereits mit CCP Release 2.0 zur Verfügung steht gleichermaßen wie die Funktionalität für den Fixed Income-Markt, die mit Produktionsstart von CCP Release 3.0 zum Einsatz kommen wird. Das GUI bietet Zugriff auf die Trade Management-Funktionalität des Zentralen Kontrahenten (CCP).

Frankfurt, 28. Februar 2005

Eurex Clearing AG
D-60485 Frankfurt am Main
www.eurexchange.com

Customer Support
Tel. +49-69-211-1 17 00
Fax +49-69-211-1 17 01

Vorstand:
Rudolf Ferscha (Vorsitzender),
Daniel Gisler, Thomas Lenz,
Peter Reitz, Jürg Spillmann