X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 099/05*

Datum: Frankfurt, 21. Juni 2005
Empfänger: Alle Eurex-Mitglieder und Vendoren, Eurex Repo- und Eurex Bonds-Teilnehmer, CCP-Teilnehmer
Autorisiert von: Daniel Gisler

CCP 3.0 – Zusätzliche funktionale Informationen

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 033/05

Kontakt: Funktionales Helpdesk Clearing, Tel. +49-69-211-1 12 50

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

Zusammenfassung:

Nach der erfolgreichen Migration des Fixed-Income Clearing auf die Central Counterparty-Plattform (CCP) am 6. Juni 2005 versenden wir mit dem heutigen Rundschreiben zusätzliche Informationen zur Unterstützung der Marktteilnehmer von Eurex Bonds und Eurex Repo.

Folgende Themen werden abgedeckt:

- Gültiger Wert für Feld 98C *Effective Settlement Date* in den Pending Delivery Reports CE26x/28x
- Angabe von Eurex Repo-Transaktionen im Zusammenhang mit CCP Release 3.0 and Verwendung des MT523 Settlement Instruction Data Carrier**/**MT543 Delivery against Payment Message
- Einzelheiten zur Shaping-Quantität für Euro GC Pooling Trades
- Allgemeine Information:
  - Erklärungen zu den über SWIFTNet, SNA oder MISS übermittelten Reports
  - Einzelheiten zur Nummerierung des Report CE270
  - Angabe der *Trading Location* im CBF *Clearing and Settlement Statement* für Fixed Income Trades

CCP 3.0 – Zusätzliche funktionale Informationen

Pending Delivery Reports CE26x/28x – Feld 98C *Effective Settlement Date*

Zurzeit enthält das Feld 98C *Effective Settlement Date* für die Pending Delivery Reports CE26x/28x die Angabe „00000000“, da die hier enthaltenen Transaktionen noch nicht abgewickelt sind.

Um eine reibungslose Abwicklung über SWIFTNet, das von CCP Release 3.0 unterstützt wird, sicherzustellen, wird dieses Feld ein Datenformat enthalten. Daher wird mit CCP Release 3.0 ab 20. Juni 2005 das Feld 98C *Effective Settlement Date* das beabsichtigte Abwicklungsdatum (JJJJMMTT) enthalten.

Angabe von Eurex Repo-Transaktionen im Zusammenhang mit CCP Release 3.0

Teilnehmern, die die Eurex Repo OTX-Datei (Own Trade File Interface) für die Angabe von Transaktionen verwenden, wird in Zusammenhang mit CCP Release 3.0 empfohlen, sich auf die *CCP Order Number* zu beziehen, wenn sie das *Contractual Settlement Date* angeben. Die *CCP Order Number* gibt die *Repo Trade Reference* der OTX-Datei wieder.

Diese Referenzierung ermöglicht den Abgleich von Transaktionen ohne *External Trade ID* der OTX-Datei (das heißt die *CCP Trade Number*), da dieses Feld mit Produktionsstart von CCP Release 3.0 für Abstimmungszwecke gegenstandslos wird.

Im Gegensatz hierzu können Teilnehmer, die für Eurex Repo-Geschäfte Xetra Trade Confirmations erhalten, weiterhin sowohl die *CCP Trade Number* angeben und/oder die *CCP Order Number*, wenn sie auf eine Transaktion Bezug nehmen.

Verwendung des MT523 Settlement Instruction Data Carrier/MT543 Delivery against Payment Message

Zur eindeutigen Identifizierung eines CCP Trade gibt das technische Handbuch „Member File-based and SWIFT Interface“ in Kapitel 3 „MT523 Settlement Instruction Data Carrier“ folgenden Schlüssel an:

- *Trading Location* (Feld 31P)
- *Trade Date* (Feld 72)
- *Instrument ISIN Code* (Feld 35B)
- *Trade Number* (Feld 20)
- *Order Number* (optional: wenn keine Angabe, wird die Transaktion mit den vier übrigen Attributen verarbeitet (Feld 30).

Um die Identifizierung von Eurex Repo-Geschäften zu verbessern, muss bei der Freigabe/beim Sperren von Eurex Repo-Geschäften über MT523 nachstehende Ergänzung berücksichtigt werden:

- *Trading Location* (Feld 31P)
- *Trade Date* (Feld 72)
- *Instrument ISIN Code* (Feld 35B)
- *Trade Number* (nicht erforderlich, wenn *Order Number* und *Contractual Settlement Date* angegeben sind; andernfalls zwingend erforderlich) ==> CHANGE (Feld 20)
- *Order Number* (optional, wenn *Trade Number* angegeben ist; andernfalls zwingend erforderlich) ==> CHANGE (Feld 30)

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

- *Contractual Settlement Date* (optional, wenn *Trade Number* angegeben ist; andernfalls zwingend erforderlich) ==> NEU (Feld 30)

Bitte beachten Sie, dass das Versenden der *CCP Trade Number* nicht erforderlich ist, wenn die *CCP Order Number* und das *Contractual Settlement Date* für die Angabe benutzt werden, wie oben für Eurex Repo-Transaktionen empfohlen.

Shaping-Quantität für Euro GC Pooling Trades

Wir weisen darauf hin, dass sich der Shaping-Quantität für Euro GC Pooling Trades auf EUR 250 Millionen beläuft, um so die Verarbeitungeffizienz im Zusammenhang mit der Geldabwicklung von Euro GC Pooling Basket ISIN Trades zu verbessern.

Allgemeine Information

Report-Versand über SWIFTNet und MISS

Bitte beachten Sie, dass nachstehende Reports für den FI CCP über SWIFTNet, SNA oder MISS versandt werden, wie in der technischen Dokumentation „Description Report Raw Data“, Kapitel 3.1, Seiten 9 und 10, beschrieben:

- CE260/261/262 “Pending Delivery”
- CE265/266/267 “Pending Delivery before NTP”
- CE270/271/272 “Settled Delivery”
- CE280/281 “Pending Delivery Instructions” (for users of Single Instructions Netting only)

Alle anderen Reports für FI CCP stehen nur über Eurex beziehungsweise CCP MISS[1] zur Verfügung:

CA160, CB230, CB300, CB310, CC011, CC031, CC040, CC045, CC050, CC055, CC060, CC080, CD150, CD250, TC750.

Report-Nummerierung CE270

In der Produktionsumgebung von CCP Release 3.0 werden acht Reports CE270 pro Abwicklungstag versandt.

Die untertägigen Reports werden von „001“ bis „007“ nummeriert, der Tagesend-Report mit „010“.

Für weitere Informationen siehe:

- "Member File-based and SWIFT Interface", Kapitel 5.4.3 "Field Description", Seite 61, Feld 13A - *Statement Number*
- "Description Report Raw Data", Kapitel 3.2.3 "Both Equity and Fixed Income Raw Data files", Seite 14, RPTCE270
- "Description Report Layouts", Kapitel 3.2.3 "Both Equity and Fixed Income Raw Data files", Seite 13, RPTCE270.

Angabe der Handelslokation im CBF „Clearing und Settlement Statement“ für Fixed Income-Transaktionen

Gemäß dem Konzept von CCP Release 3.0 führt Eurex Clearing AG das Settlement Netting sowohl über die Eurex Bonds- als auch die Eurex Repo-Plattform durch.

Somit gibt Eurex Clearing AG nach dem Settlement Netting dem Zentralverwahrer keinen *Place of Trade* für die nachfolgenden Verarbeitungsschritte an.

Beachten Sie daher bitte, dass für Eurex Bonds-/Eurex Repo-Geschäfte, die folglich keine Angabe von Eurex für *Place of Trade* führen, Clearstream Banking Frankfurt (CBF) in ihrem Clearing and Settlement Statement allgemein „EUB“ (das heißt, Eurex Bonds, Eurex Repo) als Handelslokation angibt.

Frankfurt, 21. Juni 2005

[1] Für weitere Informationen siehe das Dokument „Description Report Raw Data“, Kapitel 3.1, Seite 7.

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