

## e u r e x *information*

**Date:** Frankfurt, November 15, 2002  
**Recipients:** All Eurex Clearing members and vendors  
**Authorized by:** Jürg Spillmann

### **Central Counterparty – CCP Circulars 48/02, 49/02, 50/02, 51/02, 52/02, 53/02, 54/02, 55/02**

**Contact:** Functional Member Readiness: Tel. +49 (0)69-21 01-17 00

**Content may be most important for:**

➔ Central Counterparty Coordinators

**Attachments:**

CCP Circular 48/02, (English/Deutsch)  
CCP Circular 49/02 (English/Deutsch)  
CCP Circular 50/02 (English/Deutsch)  
CCP Circular 51/02 (English/Deutsch)  
CCP Circular 52/02 (English/Deutsch)  
CCP Circular 53/02 (English/Deutsch)  
CCP Circular 54/02 (English/Deutsch)  
CCP Circular 55/02 (English/Deutsch)

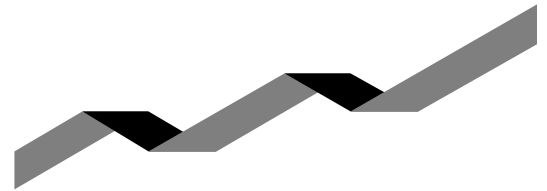
Please find attached a copy of Central Counterparty Circulars 48 – 55 sent to Frankfurter Wertpapierbörse members and vendors recently.

The attachments to the circulars include member manuals and technical documentation, as well as guidelines for the forthcoming simulation. As the attachments are generally larger than many e-mail systems will accept, they are not included with this communication; only the circulars are provided.

All important CCP documents, including those issued recently can be accessed via the CCP web-site under 'Documentation'.

Access to the CCP site from the Eurex web-site is via 'info for members' (Eurex login required) > ccp (login 'ccp' and password 'go').

This section of the CCP web-site also contains the full set of published CCP Circulars.



**An die FWB Teilnehmer, Xetra® Teilnehmer  
und Vendoren**

Empfängerkreis: Projektkoordinatoren, Systemadministratoren

**Central Counterparty – CCP  
Teilnehmersdokumentationen**

30. Oktober 2002

Sehr geehrte Damen und Herren,

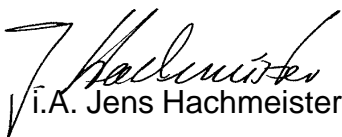
im Rahmen der Einführung des Zentralen Kontrahenten möchten wir Ihnen heute weitere implementierungsrelevante Informationen zur Verfügung stellen. Im Hinblick auf die am 25. November 2002 beginnende Simulation erhalten Sie als Anlage zu diesem Rundschreiben die englische Version der für die geführte Simulation erforderlichen Skripte und Zeitpläne. Der Versand der entsprechenden deutschen Fassung ist für Freitag, den 01. November 02 vorgesehen. In diesem Zusammenhang möchten wir alle Simulationsteilnehmer bitten, im Rahmen der Simulation ausschließlich die in den Skripten aufgeführten Instrumente zu verwenden.

Neben diesen Dokumenten wurde im Kommunikationskalender des vierten Quartals 2002 für den heutigen Tag auch der Versand des finalen FWB-Regelwerks sowie die endgültige Version der Eurex Clearing-Bedingungen angekündigt. Leider verzögert sich der Versand dieser Dokumente, da die für die Verabschiedung dieser Regelwerke notwendigen Gremienbeschlüsse noch ausstehen. Sobald alle involvierten Gremien ihre Zustimmung erteilt haben, werden wir Ihnen die vorgenannten Regelwerke übermitteln.

Des Weiteren erhalten Sie in der Anlage zu diesem Rundschreiben die finale VALUES API Version inklusive Header Files.

Falls Sie Rückfragen haben oder weitere Informationen benötigen, steht Ihnen das CCP Change Management Team gerne zur Verfügung unter Tel. +49(0)69-21 01-16 60 oder Fax +49(0)69-21 01-16 61.

Mit freundlichen Grüßen

  
i.A. Jens Hachmeister

  
i.A. Christian Ochsner

Anlagen



*Noch 26 Tage*

Start der CCP-Simulation  
am 25. November 2002

FWB  
Frankfurter  
Wertpapierbörse

Geschäftsführung

Neue Börsenstraße 1  
60487 Frankfurt am Main

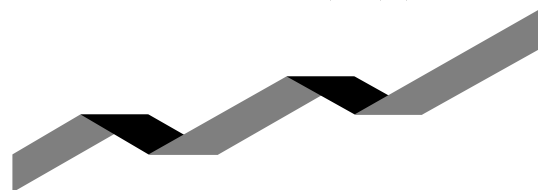
Postanschrift  
60485 Frankfurt am Main

Telefon  
+49(0)69-21 01-16 60  
+49(0)69-97 70-16 60

Telefax  
+49(0)69-21 01-16 61  
+49(0)69-97 70-16 61

Internet  
deutsche-boerse.com

Geschäftsführer:  
Edward Backes  
Dr. Heiko Beck  
Rudolf Ferscha  
Frank Gerstenschläger  
Volker Potthoff



**An die FWB Teilnehmer, Xetra® Teilnehmer und Vendoren**

Empfängerkreis: Projektkoordinatoren

FWB  
Frankfurter  
Wertpapierbörse

Geschäftsführung

Neue Börsenstraße 1  
60487 Frankfurt am Main

Postanschrift  
60485 Frankfurt am Main

Telefon  
+49(0)69-21 01-16 60  
+49(0)69-97 70-16 60

Telefax  
+49(0)69-21 01-16 61  
+49(0)69-97 70-16 61

Internet  
[deutsche-boerse.com](http://deutsche-boerse.com)

**Central Counterparty – CCP  
Entgeltsätze Wertpapierhandel in Xetra®**

1. November 2002

Sehr geehrte Damen und Herren,

wie im CCP-Kommunikationskalender für das vierte Quartal 2002 angekündigt, stellen wir Ihnen heute die Entgeltsätze für den Wertpapierhandel im elektronischen Handelssystem Xetra zur Verfügung.

Diese Information ergänzt die vorhergehenden Rundschreiben, in denen wir Ihnen Details zur zukünftigen Neuordnung der Entgelte für den Kassamarkt der Frankfurter Wertpapierbörse (FWB) vorgestellt haben: CCP Rundschreiben 28/02, das die Grundstruktur des zukünftigen Entgeltkonzepts darlegte, und CCP-Rundschreiben 38/02, das die Entgeltsätze für das Clearing und die Abwicklung von CCP-Geschäften sowie die Abwicklung von Nicht-CCP-Geschäften spezifizierte.

Falls Sie Rückfragen haben oder weitere Informationen benötigen, steht Ihnen das CCP Change Management Team gerne zur Verfügung unter Telefon +49(0)69-21 01-16 60 sowie Fax +49(0)69-21 01-16 61.

Mit freundlichen Grüßen

Volker Potthoff

i.A. Jens Hachmeister

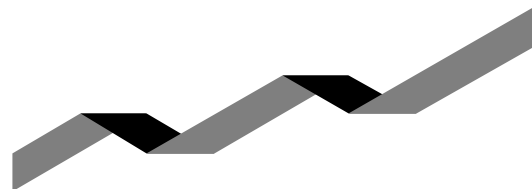
Anlage



*Noch 24 Tage*

Start der CCP-Simulation  
am 25. November 2002

Geschäftsführer:  
Edward Backes  
Dr. Heiko Beck  
Rudolf Ferscha  
Frank Gerstenschläger  
Volker Potthoff



**An die FWB Teilnehmer, Xetra® Teilnehmer  
und Vendoren**

Empfängerkreis: Projektkoordinatoren, Systemadministratoren

FWB  
Frankfurter  
Wertpapierbörse

Geschäftsführung

Neue Börsenstraße 1  
60487 Frankfurt am Main

Postanschrift  
60485 Frankfurt am Main

Telefon  
+49(0)69-21 01-16 60  
+49(0)69-97 70-16 60

Telefax  
+49(0)69-21 01-16 61  
+49(0)69-97 70-16 61

Internet  
deutsche-boerse.com

**Central Counterparty – CCP  
Teilnehmersdokumentationen**

5. November 2002

Sehr geehrte Damen und Herren,

im Rahmen der Einführung des Zentralen Kontrahenten möchten wir Ihnen heute weitere implementierungsrelevante Informationen zur Verfügung stellen. Als Anlage zu diesem Rundschreiben erhalten Sie folgende, bereits im Kommunikationskalender für das vierte Quartal 2002 angekündigte Dokumente:

- **Front End Installation Guide**
- **Front End Operations Guide.**

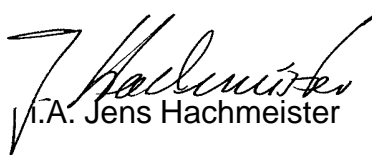
Des Weiteren übersenden wir Ihnen zur Information als Anlage ein bereits veröffentlichtes Rundschreiben der Eurex Clearing AG zur

- **Dynamisierung der Beiträge zum Clearing-Fonds.**

Die im Kommunikationskalender für den heutigen Tag angekündigte "Final Version VALUES API" ist Ihnen bereits mit CCP-Rundschreiben 48/02 am 30.10.2002 zugegangen. Die ebenfalls für heute angekündigte "Final Version file-based Interface" erhalten Sie am 08.11.2002 per CCP-Rundschreiben. Wir bitten um Verständnis für die leichte Verzögerung.

Für Rückfragen und weitere Auskünfte steht Ihnen das CCP Change Management Team unter Tel. +49(0)69-21 01-16 60 oder Fax +49(0)69-21 01-16 61 gerne zur Verfügung.

Mit freundlichen Grüßen

  
i.A. Jens Hachmeister

  
i.A. Christian Ochsner

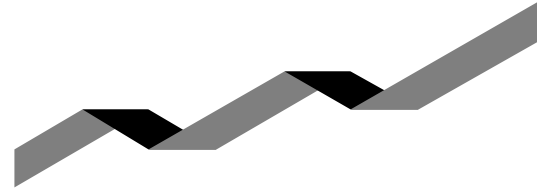
Anlagen



*Noch 20 Tage*

Start der CCP-Simulation  
am 25. November 2002

Geschäftsführer:  
Edward Backes  
Dr. Heiko Beck  
Rudolf Ferscha  
Frank Gerstenschläger  
Volker Potthoff



**An die FWB Teilnehmer, Xetra® Teilnehmer  
und Vendoren**

Empfängerkreis: Projektkoordinatoren, Systemadministratoren

FWB  
Frankfurter  
Wertpapierbörse

Geschäftsführung

Neue Börsenstraße 1  
60487 Frankfurt am Main

Postanschrift  
60485 Frankfurt am Main

Telefon  
+49(0)69-21 01-16 60  
+49(0)69-97 70-16 60

Telefax  
+49(0)69-21 01-16 61  
+49(0)69-97 70-16 61

Internet  
deutsche-boerse.com

**Central Counterparty – CCP  
Simulationsskripte: deutsche Versionen**

5. November 2002


Sehr geehrte Damen und Herren,

im Hinblick auf die am 25. November 2002 beginnende Simulation erhalten Sie als Anlage zu diesem Rundschreiben die deutschen Versionen der für die geführte Simulation erforderlichen Skripte und Zeitpläne.

Die englischen Versionen dieser Dokumente sind Ihnen bereits mit CCP-Rundschreiben 48/02 am 30.10.2002 zugegangen.

Für Rückfragen und weitere Auskünfte steht Ihnen das CCP Change Management Team unter Tel. +49(0)69-21 01-16 60 oder Fax +49(0)69-21 01-16 61 gerne zur Verfügung.

Mit freundlichen Grüßen

  
i.A. Jens Hachmeister

  
i.A. Christian Ochsner

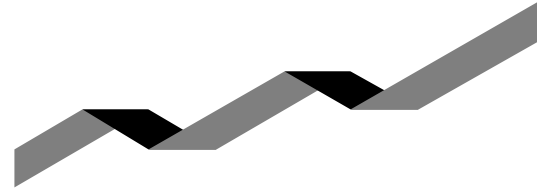
Anlagen



*Noch 20 Tage*

Start der CCP-Simulation  
am 25. November 2002

Geschäftsführer:  
Edward Backes  
Dr. Heiko Beck  
Rudolf Ferscha  
Frank Gerstenschläger  
Volker Potthoff



**An die FWB Teilnehmer, Xetra® Teilnehmer  
und Vendoren**

Empfängerkreis: Projektkoordinatoren, Systemadministratoren

FWB  
Frankfurter  
Wertpapierbörse

Geschäftsführung

Neue Börsenstraße 1  
60487 Frankfurt am Main

Postanschrift  
60485 Frankfurt am Main

Telefon  
+49(0)69-21 01-16 60  
+49(0)69-97 70-16 60

Telefax  
+49(0)69-21 01-16 61  
+49(0)69-97 70-16 61

Internet  
deutsche-boerse.com

## Central Counterparty – CCP Teilnehmerschnittstellen – Member File-based Interface

8. November 2002

Sehr geehrte Damen und Herren,

wie im CCP Rundschreiben 50/02 am 5. November 2002 angekündigt, erhalten Sie heute die finale Version der dateibasierten Teilnehmerschnittstellenbeschreibung. Das Dokument „Member File-based Interface“ beschreibt das Layout und die Formate der CCP Teilnehmerschnittstellen.

Die Schnittstellen werden zwischen dem CCP und den Teilnehmern implementiert, wobei hier zwischen zwei unterschiedlichen SWIFT-Formaten zu unterscheiden ist: Der Lieferinstruktionsdatenträger basiert auf dem MT 523 („Deliver against Payment“), die CCP-Reports auf dem MT 536 („Statement of Transactions“).

Für die leicht verzögerte Bereitstellung bitten wir um Ihr Verständnis.

Für Rückfragen und weitere Auskünfte steht Ihnen das CCP Change Management Team gerne zur Verfügung unter Tel. +49(0)69-21 01-16 60 oder Fax +49(0)69-21 01-16 61.

Mit freundlichen Grüßen

  
i.A. Jens Hachmeister

  
i.A. Christian Ochsner

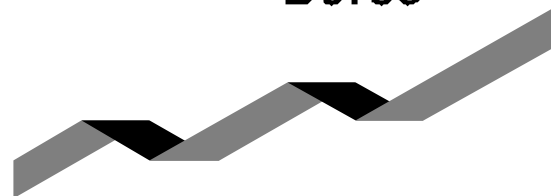
Anlage



*Noch 17 Tage*

Start der CCP-Simulation  
am 25. November 2002

Geschäftsführer:  
Edward Backes  
Dr. Heiko Beck  
Rudolf Ferscha  
Frank Gerstenschläger  
Volker Potthoff



## An die FWB Teilnehmer, Xetra® Teilnehmer und Vendoren

Empfänger: Projektkoordinatoren, Backoffice,  
IT-Mitarbeiter

FWB  
Frankfurter  
Wertpapierbörse

Geschäftsführung

Neue Börsenstraße 1  
60487 Frankfurt am Main

Postanschrift  
60485 Frankfurt am Main

Telefon  
+49(0)69-21 01-16 60  
+49(0)69-97 70-16 60

Telefax  
+49(0)69-21 01-16 61  
+49(0)69-97 70-16 61

Internet  
deutsche-boerse.com

**Zentraler Kontrahent für Aktien - CCP** 12. November 2002  
**Lieferinstruktionsdatenträger: Erweiterte Informationen**

Sehr geehrte Damen und Herren,

mit diesem CCP-Rundschreiben erhalten Sie weitere für die Implementierung des Zentralen Kontrahenten für Aktien relevante Informationen. Im Einzelnen gibt Ihnen dieses Rundschreiben Informationen zu Änderungen im Layout des Lieferinstruktionsdatenträgers sowie zu den, den Lieferinstruktionsdatenträger betreffenden, Nachrichten des CCP.

### Lieferinstruktionsdatenträger – Änderungen im Layout

Wie im Arbeitskreis Equity Clearing am 16. September 2002 beschlossen ist es notwendig, das Feld "Handelsplatz" in das Format MT523 zu integrieren. Die Lösung, die eingeführt werden wird, beinhaltet die folgenden Änderungen:

- Abweichend vom CBF-Layout des Lieferinstruktionsdatenträgers wird Feld 31P auf das allgemeine S.W.I.F.T. Format erweitert.
- Nach S.W.I.F.T. enthält das Feld "Datum und Handelsplatz des Geschäfts" in 6!n(29a) Format.
  - Wie bereits mitgeteilt ist das Geschäftsdatum eine Pflichtangabe, die im Format "JJMMTT" eingegeben werden muss.
  - Zusätzlich zum Geschäftsdatum wird das Feld 31P erweitert, um eine Angabe des Handelsplatzes zu ermöglichen. Der Handelsplatz wird ein Kann-Feld in alphanummerischem Format "3!a" sein. Erlaubte Werte für dieses Feld sind "EDE" für Xetra-Geschäfte und "EDF" für XONTRO Frankfurt Geschäfte. Wenn erforderlich, kann der CCP weitere Feldwerte definieren.



*Noch 13 Tage*

Start der CCP Simulation  
am 25. November 2002

Geschäftsführer:  
Edward Backes  
Dr. Heiko Beck  
Rudolf Ferscha  
Frank Gerstenschläger  
Volker Potthoff

- Zwischen dem Geschäftsdatum und dem Handelsplatz darf kein Leerzeichen stehen.
- CBF wird diese Formatänderungen nicht übernehmen, jedoch garantieren, dass Datenträger verarbeitet werden können, die einen Handelsplatz im Anschluss an das Handelsdatum enthalten.

Folgende Gründe haben zur Entscheidung geführt, das Feld "Handelsplatz" als optionale Angabe in das Feld 31P des MT523 Formats aufzunehmen:

- ✓ Der Handelsplatz ist eines der fünf Schlüsselattribute von CCP-Geschäften.
- ✓ Im ersten Schritt des CCP, der nur Xetra und XONTRO Frankfurt einschließt, kann der Handelsplatz anhand des Felds "Eingebener" (Feld 20) erkannt werden. Daher werden alle Xetra-Geschäfte "7501" als Eingebener erhalten. Andere Feldinhalte werden als XONTRO Frankfurt-Geschäfte interpretiert.
- ✓ Der CCP soll jedoch als System flexibel sein, um die Teilnahme weiterer deutscher Regionalbörsen zu ermöglichen. Da der Nummernkreis für Abwicklungskonten keine absolute Trennung von verschiedenen Regionalbörsen mehr erlaubt, wird eine nachhaltige Lösung im Hinblick auf zukünftige Anforderungen implementiert.
- ✓ Der CCP geht zum allgemeinen S.W.I.F.T. Format über und führt folglich Feld 31P ein, um die Angabe des Handelsplatzes zu ermöglichen.

Für CCP Release 1.0 hat diese Entscheidung nur minimale Auswirkungen auf die Teilnehmer:

- ✓ Feld 31P ist nur Muss-Feld bezüglich des Handelsdatums, die Eingabe des Handelsplatzes ist für den Teilnehmer optional. Wenn das Feld 31P voll ausgefüllt wird, wird der Handelsplatz von Feld 31P bestimmt. Andernfalls bestimmt der CCP den Handelsplatz aufgrund des Wertes im Feld "Eingebener".
- ✓ Zulässige Feldwerte werden in Übereinstimmung mit den CBF-Standards für das MT536 Format (Feld "94B Source of Price") definiert.

## **Lieferinstruktionsdatenträger – Nachrichten des CCP**

Ähnlich wie bei den CBF-Diensten sendet der CCP auf verschiedenen Ebenen Nachrichten an die Teilnehmer in Bezug auf den Lieferinstruktionsdatenträger.

Auf der ersten Ebene meldet der CCP, dass der Datenträger erfolgreich empfangen wurde. Diese Meldung wird an alle Teilnehmer versandt. Diese "technische" Meldung hat die nachfolgend beschriebene funktionale Bedeutung.

Jede "technische" Meldung enthält einen Zeitstempel, der dem Teilnehmer anzeigt, wann der Lieferinstruktionsdatenträger vom CCP-System verarbeitet werden wird:

- ✓ Technische Meldungen, die einen Zeitstempel haben, der vor oder gleich mit der definierten "CCP-Deadline" liegt, werden in jedem Fall sofort, d. h. im nächsten Abwicklungslauf des selben Tages verarbeitet.
- ✓ Technische Meldungen mit einem Zeitstempel, der innerhalb der kommunizierten "best effort" Phase (für SDS1 und SDS2) liegt, zeigen an, dass eine sofortige Verarbeitung des Lieferinstruktionsdatenträgers im nächsten Abwicklungslauf desselben Tages nicht garantiert werden kann. In diesem Fall ist es möglich, dass die Verarbeitung erst in einem späteren Abwicklungslauf erfolgt.
- ✓ Technische Meldungen, die einen Zeitstempel außerhalb der kommunizierten "best effort" Phase haben, werden in jedem Fall erst im darauf folgenden Abwicklungslauf verarbeitet.

Technische Nachrichten werden zu den Teilnehmern über den gleichen Übertragungsweg versandt über den zuvor der Datenträger geliefert wurde – d.h. über SNA-Leitungen.

Der Report mit der technischen Meldung wird das folgende Layout haben (siehe Beispiel auf der nächsten Seite):

```
*****
*
*
*
*           EUREX CLEARING AG
*           -----
*           CCP-EINGANGSBESTÄTIGUNG
*
*****
*
*
* BANKNUMMER: XXXX  ERSTELLUNGSDATUM: 23.10.2002  ERSTE TRANSFERNUMMER: 0011
*
* EMPFANGSDATUM: 23.10.2002
* EMPFANGSUHRZEIT: 16:35:01
*
*
* FOLGENDE TRANSFERBLÖCKE WURDEN GESENDET:
*
* TRANSFERNUMMER: 0012      ANZAHL SÄTZE:      3      ANWENDUNG: C
*
*
* ANZAHL EINGABESÄTZE:      3
* ANZAHL PROD-DATEI:      3
* ANZAHL TEST-DATEI:      0
*
*
* CCP IST BEREIT FÜR DEN EMPFANG DER NÄCHSTEN DATEI
*****
```

### **Die technische Rückmeldung wird mit dem Start der CCP-Simulation am 25. November 2002 verfügbar sein.**

Auf einer zweiten Ebene werden die Teilnehmer Meldungen bezüglich des Inhalts und der Verarbeitung ihrer Instruktionen durch den CCP erhalten. Der CCP führt eine Prüfung von Syntax und Inhalt jedes einzelnen Datensatzes durch. Nach dieser "funktionalen Prüfung" liefert der CCP Meldungen zu nicht akzeptierten Daten mit Informationen bezüglich der Qualität der erhaltenen Daten. Im Gegensatz zu CBF wird der CCP ausschließlich Rückmeldungen zu folgenden Inhalten und Verarbeitungsstatus senden:

- ✓ Es werden nur Meldungen zu nicht akzeptierten Daten versandt, Bestätigungsmeldungen werden nicht gesandt.
- ✓ Die Anzahl von verarbeiteten und zurückgewiesenen Datensätzen wird nicht angegeben.
- ✓ Meldungen über zurückgewiesene Daten werden im Format MT523 bereitgestellt; andere Formate wie z. B. MT598 werden nicht unterstützt. Alle Felder (Muss- und Kann-Felder) des MT523 Formats werden mit den Angaben der Teilnehmer gefüllt.
- ✓ Es wird keine Wahlmöglichkeit in Bezug auf den Umfang und den Übertragungsweg der Meldung angeboten. Meldungen über zurückgewiesene Daten werden standardmäßig an Teilnehmer versandt – der Teilnehmer entscheidet über die Nutzung des Meldungsdatenträgers. Die CCP-Meldungen werden über SNA-Leitungen übertragen.

Das Format der CCP-Meldungen folgt den CBF-Standards, jedoch werden CCP-spezifische Fehlercodes genutzt, die weiter unten aufgeführt sind. Folgende Auswirkungen ergeben sich dabei für die Teilnehmer:

- ✓ Obwohl die Felder "rejection indicator" und "confirmation indicator" (Feld 72, >I11 und >I12) im CCP-Format des Lieferinstruktionsdatenträgers zur Verfügung gestellt werden, können sie vom Teilnehmer nicht gefüllt werden. Dies sind CBF-spezifische Felder, die nicht vom CCP verarbeitet werden.
- ✓ Beim Senden der Ablehnungsmeldung füllt der CCP das Feld "rejection indicator" mit der Konstante "064" und zeigt damit an, dass ein Fehler aufgetreten ist, dass in dieser Meldung alle Felder gefüllt sind und dass diese Meldung nur über Datentransfer versandt wird. Dies entspricht den Beschreibungen im CBF Dokument "CASCADE-LIMA-File-Transfer user manual" (Abschnitt 17.1.27) von Dezember 2001.
- ✓ Die Art des aufgetretenen Fehlers wird im Trailer der Nachricht im Feld "return code" angezeigt. Der "ISO-string" (Hauptteil der Nachricht) enthält keine weitere Information zum aufgetretenen Fehler.
- ✓ Alle anderen Felder des MT523-Satzes werden durch den CCP ohne Änderung an den Teilnehmer zurück geschickt.

Der CCP-Antwortcode ist als siebenstelliger alphanummerischer Code definiert, wobei die ersten zwei Stellen immer "CC" enthalten. Die folgenden fünf Stellen bilden einen fünfstelligen Fehlercode. Dieser fünfstellige Fehlercode zeigt den Grund für die Ablehnung an. Die unten stehende Liste zeigt CCP-Fehlercodes und ihre Bedeutung.

CCP-Fehlercode	Beschreibung	Bedeutung
CC1005F	Nachricht kann nicht verarbeitet werden	Feld 72 (Information Absender an Empfänger), Unterfeld D51 (Aufrechnungsblock) ist weder auf "J" noch auf "N" gesetzt. Es ist nicht angegeben, ob eine Sperre oder eine Freigabe durchgeführt werden soll.
CC1006F	Ungültiger Geschäftsstatus für die geforderte Transaktion	Sperre/Freigabe kann aus den folgenden Gründen nicht durchgeführt werden: <ul style="list-style-type: none"> <li>✓ Das bezeichnete Geschäft ist kein "Verkauf"</li> <li>✓ Es ist "Sperren" angefordert worden, aber das Geschäft ist bereits gesperrt, oder umgekehrt für "Freigabe"</li> <li>✓ "Sperren" ist angefordert worden, aber der Geschäftsstatus ist nicht: schwebend, teilweise geschlossen (&lt;closed&gt;), geschlossen (&lt;closed&gt;), oder teilweise abgewickelt</li> <li>✓ "Freigabe" ist angefordert worden, aber</li> </ul>

		der Geschäftsstatus ist nicht: schwebend, teilweise geschlossen (<closed>), geschlossen (<closed>), oder teilweise abgewickelt.
CC1007F	Käuferkonto ist nicht der CCP	Feld 87D ist nicht mit "85010000" belegt.
CC1008F	Ungültige ISIN	Die in Feld 35B eingetragene ISIN stimmt nicht mit der ISIN des Geschäfts aus der Datenbank überein. Das CCP-System sucht das Geschäft auf Basis der folgenden Felder: Geschäftsnummer (Feld 20), Geschäftsdatum (Feld 31P), Handelsplatz (Feld 31P oder abgeleitet von Feld 20), Ordernummer (Feld 72/K97). Die ISIN des Geschäfts aus der Datenbank muss mit der in Feld 35B angegebenen ISIN übereinstimmen.
CC1010F	Ungültiges Abwicklungskonto	Das angegebene Verkäuferkonto (Feld 83C) stimmt nicht mit dem Abwicklungskonto in den Stammdaten des Geschäfts aus der Datenbank überein.
CC1025I	Transaktion zurückgewiesen, da das Settlement-Netting schon gestartet wurde.	Der Datensatz kann nicht verarbeitet werden und wird bis zum nächsten Abwicklungslauf zurückgestellt.
CC1009F	Angefordertes Geschäft nicht gefunden.	Das CCP-System kann das Geschäft nicht in der Datenbank finden. Das heißt, dass eines der CCP-Schlüsselattribute falsch sein muss: <ul style="list-style-type: none"> <li>✓ Feld 20: Geschäftsnummer</li> <li>✓ Feld 20: Eingabe – zur Bestimmung des Handelsplatzes oder Feld 31P: wo gefüllt – Handelsplatz</li> <li>✓ Feld 31P: Geschäftsdatum</li> <li>✓ Feld 72/K97: Ordernummer</li> <li>✓ Feld 35B: ISIN</li> </ul>
CC1082F	Volumen der Transaktion nicht ausreichend	Das in Feld 35A spezifizierte Volumen (Sperrung oder Freigabe) ist für die angeforderte Aktion nicht mehr verfügbar.
CC1083F	Ungültige Transaktionsstückzahl	Die angeforderte Nominale in Feld 35A ist kleiner als die kleinste Abwicklungseinheit (MSU)

Für den Teilnehmer ist es wichtig zu beachten, dass die CCP-Rückmeldungen keinen Hinweis mehr auf seinen Lieferinstruktionsdatenträger enthalten werden.

Durch die Verarbeitungsweise des CCP ergibt sich, dass die Anzahl der vom Teilnehmer gesandten Lieferinstruktionsdatenträger unabhängig von der Anzahl der Rückmelde-Dateien ist. Der CCP wird Rückmeldungen bezüglich abgelehnter Daten innerhalb eines konfigurierbaren Zeitintervalls senden. Die Konfigurierung des Zeitintervalls wird durchgängig für alle am System angeschlossenen Teilnehmer gleich sein.

Beim Versand der Rückmelde-Datei wird der CCP eine neue Datei erstellen, in die alle ab diesem Zeitpunkt abgelehnten Datensätze hineinfließen. Für die neue Datei erstellt der CCP einen neuen Vorsatz und einen neuen Nachsatz (in MT598-Format). Detaillierte Schnittstellenbeschreibungen der versandten Datei werden in einer weiteren Teilnehmerdokumentation zu einem späteren Zeitpunkt geliefert.

**Detaillierte Rückmeldungen auf Datensatz-Ebene werden noch nicht mit Beginn der CCP-Simulationsphase zur Verfügung stehen. Die Bereitstellung dieser Rückmeldungen wird für Januar 2003 erwartet.** Die Teilnehmer werden über den genauen Einführungstermin in einem gesonderten Rundschreiben informiert.

Für Fragen zu den in diesem Rundschreiben angesprochenen Themen oder für weitere Informationen steht Ihnen das CCP Change Management Team unter

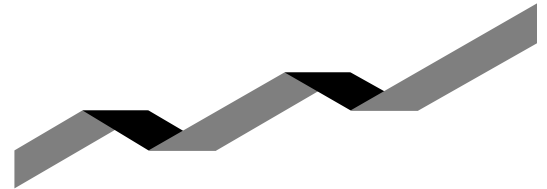
Telefon: +49(0)69-21 01-16 60  
Fax: +49(0)69-21 01-16 61

gerne zur Verfügung.

Mit freundlichen Grüßen

  
i.A. Jens Hachmeister

  
i.A. Christian Ochsner



**An die FWB Teilnehmer, Xetra® Teilnehmer  
und Vendoren**

Empfängerkreis: Projektkoordinatoren, Systemadministratoren

FWB  
Frankfurter  
Wertpapierbörse

Geschäftsführung

Neue Börsenstraße 1  
60487 Frankfurt am Main

Postanschrift  
60485 Frankfurt am Main

Telefon  
+49(0)69-21 01-16 60  
+49(0)69-97 70-16 60

Telefax  
+49(0)69-21 01-16 61  
+49(0)69-97 70-16 61

Internet  
deutsche-boerse.com

**Central Counterparty – CCP  
Teilnehmersdokumentationen – Skripte Offene Simulation**

12. November 2002

Sehr geehrte Damen und Herren,

wie angekündigt erhalten Sie heute als Anlage zu diesem Rundschreiben die englische Version der für die offene Simulation erforderlichen Skripte.

Die für den Zeitraum vom 23. Dezember 2002 bis 28. Februar 2003 geplante offene Simulation schließt sich unmittelbar an die geführte Simulation an und behandelt komplexere Szenarien, die Sie in den angehängten Skripten dargestellt finden.

Der Versand der entsprechenden deutschen Fassungen ist noch für diese Woche vorgesehen.

Für Rückfragen und weitere Auskünfte steht Ihnen das CCP Change Management Team gerne zur Verfügung unter Telefon: +49(0)69-21 01-16 60 oder Fax: +49(0)69-21 01-16 61.

Mit freundlichen Grüßen

i.A. Jens Hachmeister

i.A. Christian Ochsner

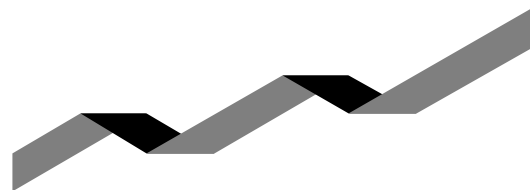
Anlagen



*Noch 13 Tage*

Start der CCP-Simulation  
am 25. November 2002

Geschäftsführer:  
Edward Backes  
Dr. Heiko Beck  
Rudolf Ferscha  
Frank Gerstenschläger  
Volker Potthoff



**An die FWB Teilnehmer, Xetra® Teilnehmer  
und Vendoren**

Empfängerkreis: Projektkoordinatoren, Systemadministratoren

FWB  
Frankfurter  
Wertpapierbörse

Geschäftsführung

Neue Börsenstraße 1  
60487 Frankfurt am Main

Postanschrift  
60485 Frankfurt am Main

**Central Counterparty – CCP** 13. November 2002  
**Instrumentenliste/Deutsche Skripte Offene Simulation/Liste SPOCs**

Telefon  
+49(0)69-21 01-16 60  
+49(0)69-97 70-16 60

Telefax  
+49(0)69-21 01-16 61  
+49(0)69-97 70-16 61

Sehr geehrte Damen und Herren,

als Anlage zu diesem Rundschreiben erhalten Sie

- die deutschen Versionen der Skripte für die offene Simulation
- eine finale Instrumentenliste für die Simulation sowie
- eine Liste der „Single Points of Contact“ (SPOC) für die Simulation in den Häusern der Clearing-Teilnehmer/Abwicklungsinstitute.

Internet  
deutsche-boerse.com

In Zusammenhang mit der Instrumentenliste für die Simulation bitten wir zu beachten, dass die Anzahl der Instrumente mit Liquidität in Xetra von 5 auf 10 verdoppelt wurde.

Da die *Instrumente für die Szenarien* der geführten und der offenen Simulation auch in der *Gesamtliste* enthalten sind, weisen wir ausdrücklich darauf hin, dass diese **ausschließlich** für die Szenarien zu verwenden sind.

Alle anderen Instrumente - insbesondere diejenigen mit Liquidität - stehen für teilnehmerinterne Tests zur Verfügung.

Für Rückfragen und weitere Auskünfte steht Ihnen das CCP Change Management Team gerne zur Verfügung unter  
Telefon: +49(0)69-21 01-16 60 oder Fax: +49(0)69-21 01-16 61.

Mit freundlichen Grüßen

i.A. Jens Hachmeister  
Anlagen

i.A. Christian Ochsner



*Noch 12 Tage*

Start der CCP-Simulation  
am 25. November 2002

Geschäftsführer:  
Edward Backes  
Dr. Heiko Beck  
Rudolf Ferscha  
Frank Gerstenschläger  
Volker Potthoff