

clear to trade



## eurex clearing rundschriften 267/08

**Datum:** Frankfurt, 31. Oktober 2008  
**Empfänger:** Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren  
**Autorisiert von:** Thomas Lenz

 Hohe Priorität

### Migration auf das TARGET2-Zahlungssystem: Erneute Simulation

**Verweis auf Eurex-Rundschriften:** 171/07, 121/08, 229/08

**Kontakt:** Ernst Karbe, Tel. +49-69-211-1 54 88, E-Mail: [ernst.karbe@eurexchange.com](mailto:ernst.karbe@eurexchange.com)

**Zielgruppe:**

Ü Alle Abteilungen

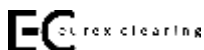
**Anhänge:**

keine

**Zusammenfassung:**

Mit Eurex-Rundschriften 171/07, 121/08 und 229/08 haben wir Sie über die Migration auf das TARGET2-Zahlungssystem am **1. Dezember 2008** informiert. Wie bereits mitgeteilt, war eine Simulation und Übertragung der Zahlungsdateien auf die SSP-Plattform vorgesehen.

Mit diesem Rundschreiben wollen wir Ihnen die Daten für eine erneute Teilnehmersimulation bzw. Prüfung von Zahlungsdateien auf der SSP-Plattform bekannt geben.



Eurex Clearing AG  
Neue Börsenstraße 1  
60487 Frankfurt/Main  
Postanschrift:  
60485 Frankfurt/Main  
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00  
F +49-69-211-1 17 01  
[customer.support@eurexchange.com](mailto:customer.support@eurexchange.com)  
Internet:  
[www.eurexclearing.com](http://www.eurexclearing.com)

Vorsitzender des  
Aufsichtsrats:  
Prof. Dr. Peter Gomez

Vorstand:  
Andreas Preuß (Vorsitzender),  
Jürg Spillmann, Thomas Book,  
Gary Katz, Thomas Lenz,  
Michael Peters, Peter Reitz

Aktiengesellschaft mit  
Sitz in Frankfurt/Main  
HRB Nr. 44828  
Amtsgericht  
Frankfurt/Main

## **Migration auf das TARGET2-Zahlungssystem: Erneute Simulation**

Mit Eurex-Rundschreiben 171/07, 121/08 und 229/08 haben wir Sie über die Migration auf das TARGET2-Zahlungssystem am 1. Dezember 2008 informiert. Wie im letzten Rundschreiben mitgeteilt, war eine Simulation bzw. Übertragung der Zahlungsdateien auf die SSP Plattform vorgesehen.

Im ersten Schritt sollten die Zahlungsdateien mit Batch-Lauf vom 21. Oktober 2008 aus CCP wie auch aus Eurex-Derivate erstellt werden. Aufgrund anderer Valutastellung wurden aber die Zahlungen aus Eurex-Derivate nicht eingelesen und auch nicht in den Reports CD010 und CD011 aufgelistet. Einzig die CCP-Zahlungen wurden in den beiden genannten Reports angezeigt. Aufgrund technischer Probleme am 23. Oktober 2008 zwischen der ASI-Ancillary-Systemschnittstelle und der SSP-Plattform konnte die Übertragung der Zahlungsdateien nicht vorgenommen werden. Dadurch war es allen Clearing-Mitgliedern nicht möglich, ihre Zahlungsdateien auf der SSP-Plattform zu überprüfen.

Mit diesem Rundschreiben wollen wir Ihnen die Daten für eine erneute Teilnehmersimulation bzw. Prüfung von Zahlungsdateien auf der SSP-Plattform bekannt geben.

### **Teilnehmer-Simulation – Prüfung von Zahlungsdateien auf der SSP-Plattform (TARGET2)**

Damit Euro-Zahlungsdateien auf die SSP-Simulation übermittelt werden können, sind von den Teilnehmern notwendigerweise Geschäfte über Xetra oder Eurex-Derivate in der Simulation durchzuführen. Die abgeschlossenen Xetra-Kassamarktgeschäfte laufen dabei über den Eurex-CCP unter Berücksichtigung eines ggf. eingestellten Netting der Offset-Blöcke. Somit werden Euro-Zahlungen sowohl aus Eurex-Derivaten als auch aus Kassamarktgeschäften in Xetra erzeugt, die über den CCP abgewickelt werden.

#### **1. Xetra-Geschäfte**

Zur Erzeugung von Zahlungsinstruktionen müssen Xetra<sup>®</sup>-Geschäfte am 6. November 2008 eingegeben worden sein. Die Ausführung der Lieferungen bzw. die Zahlungen aus dem Aufrechnungsblock (CCP) werden mit Valuta T+2 durchgeführt. Die entsprechenden Zahlungen werden im Batch-Lauf vom 11. November 2008 erstellt.

#### **2. Eurex-Derivate**

Zur Erzeugung von Zahlungsinstruktionen müssen Eurex-Derivate-Geschäfte am 11. November 2008 vorgenommen werden, damit EUR-Zahlungen im Batch-Lauf vom 11. November 2008 erstellt werden können.

#### **3. Batch-Lauf am 11. November 2008**

Mit Batch-Lauf am 11. November 2008 werden die EUR-Zahlungen für die eingegebenen Xetra<sup>®</sup>-Geschäfte (T+2) fällig. Ebenfalls sind die angefallenen Prämien und Variation Margins in Euro zu leisten, welche durch Handel von Optionen und Futures am 11. November 2008 auf Eurex-Derivate anfallen.

#### **4. SSP-Test am 12. /13. November 2008 – Übertragung der Buchungsdateien**

Die EUR-Buchungsdateien werden am 12. November 2008 mit Valuta 12. November 2008 sowie am 13. November 2008 mit Valuta 13. November 2008 via Ancillary-Systemschnittstelle (ASI) an die SSP-Plattform übermittelt. Jeder TARGET2-Direct Participant kann die übermittelten Buchungen einsehen. Darüber hinaus werden nach Buchungsausführung die Buchungsbestätigungen in den Formaten MT900 und MT910 von der SSP-Plattform an die Teilnehmer übertragen.

**5. Kontrolle der Zahlungsdateien mit Eurex-Reports**

Eurex erstellt die Reports RPTCD010 Daily Cash Account – CM (für Clearing-Mitglieder) und RPTCD011 Daily Cash Account – AH (Kontoinhaber), aus denen die einzelnen Buchungen pro Clearing-Mitglied ersichtlich sind. Mit Batch-Lauf vom 11. November 2008 werden diese Reports mit den Zahlungsdaten für Valuta 12. November 2008 erzeugt. Wir bitten Sie zu beachten, dass die Übertragung der Zahlungsdateien mit Valuta 12. November 2008 erfolgen wird (SSP-Clearing-Tag) und nicht mit dem in den Reports angegebenen Valuta-Tag.

Frankfurt, 31. Oktober 2008