clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 054/16

Datum: 20. April 2016
Empfänger: Alle EurexOTC Clear Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

EurexOTC Clear IRS Release 6.1: Aktualisierte Dokumentation und Vorbereitungen für die Simulation

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 019/16

Kontakt: Group Client Services & Administration, T +49-69-211-1 17 00, memberservices@eurexclearing.com

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

Zusammenfassung:

Im Zusammenhang mit der Einführung von EurexOTC Clear für IRS Release 6.1 hat Eurex Clearing verschiedene Dokumente aktualisiert und stellt weitere Informationen zur Simulation von EurexOTC Clear IRS Release 6.1 zur Verfügung, die am **9. Mai 2016** beginnt. Die Einführung von EurexOTC Clear IRS Release 6.1 in Produktion findet am **13. Juni 2016** statt.

Eine Beschreibung der mit EurexOTC Clear IRS Release 6.1 eingeführten Änderungen können Sie Eurex Clearing-Rundschreiben 019/16 sowie den „EurexOTC Clear Functional Release Notes“ entnehmen. Bitte beachten Sie einige Erweiterungen im Release-Umfang, die in der Release-Ankündigung noch nicht genannt wurden.

Bitte berücksichtigen Sie auch, dass die Funktionen und Services, die mit diesem Release eingeführt werden, Auswirkungen auf Schnittstellen (wie z. B. Reports) der Eurex Clearing haben.

Eurex Clearing AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
memberservices@
eurexclearing.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Dr. Hugo Bänziger

Vorstand:
Heike Eckert (stv. Vorsitzende),
Matthias Graulich,
Thomas Laux,
Erik Tim Müller

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
USt-IdNr. DE194821553
Amtsgericht Frankfurt/Main

EurexOTC Clear IRS Release 6.1: Aktualisierte Dokumentation und Vorbereitungen für die Simulation

Im Zusammenhang mit der Einführung von EurexOTC Clear für IRS Release 6.1 hat Eurex Clearing verschiedene Dokumente aktualisiert und stellt weitere Informationen zur Simulation von EurexOTC Clear IRS Release 6.1 zur Verfügung, die am 9. Mai 2016 beginnt. Die Einführung von EurexOTC Clear IRS Release 6.1 in Produktion findet am 13. Juni 2016 statt.

Eine Beschreibung der mit EurexOTC Clear IRS Release 6.1 eingeführten Änderungen können Sie Eurex Clearing-Rundschreiben 019/16 sowie den „EurexOTC Clear Functional Release Notes“ entnehmen.

Der folgende Überblick zeigt die wesentlichen Informationen zu den Dokumenten, die in der Member Section der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com veröffentlicht wurden:

Veröffentlichte funktionale Dokumente	
Aktion	**Dokumentname/Pfad**
Release-Update	EurexOTC Clear Risk Methodology Description
Release-Update	EurexOTC Clear Simulation Guide
Eurex Clearing Member Section > Technology > Interest Rate Swaps > IRS Release 6.1 > Overview and Functionality	
Release-Update	EurexOTC Clear IRS GUI User Guide
Release-Update	Margin Calculator User Guide + Templates
Eurex Clearing Member Section > Technology > Interest Rate Swaps > IRS Release 6.1 > EurexOTC Clear GUI	

An der „Margin Calculator Trade Template Field Description“, der „FpML Margin Calculator Interface Specification“, dem „FpML Margin Calculator XSD“, den „FpML API Interface Documents“ und dem „FpML API XSD“ wurden keine Änderungen vorgenommen, sodass die aktuellen Versionen weiterhin genutzt werden können. Die Dateien können unter diesem Pfad heruntergeladen werden:

Eurex Clearing Member Section > Technology > Interest Rate Swaps > IRS Release 6.1 > Eurex Clearing FpML Interface

Bitte beachten Sie, dass einige kleine Anpassungen an den folgenden, bereits veröffentlichten Report-XSDs und Beispiel-Reports erforderlich waren:

- Static Data Report (CD298): neue XSDs
- Settlement Adjustment Report (CD211): neue XSDs
- Variation Margin Report (CC203/CC222): neue XSDs und Beispiel-Reports

Die aktualisierten Versionen sind bereits in der Member Section veröffentlicht worden.

Vorbereitungen für die Simulation

Bitte berücksichtigen Sie, dass die Funktionen und Services, die mit diesem Release eingeführt werden, Auswirkungen auf Schnittstellen (wie z. B. Reports) der Eurex Clearing haben.

Zur Vorbereitung auf die Simulation

- prüfen Sie bitte Ihre Rollen und Zuordnungen bei der „Approved Trade Source“ (z. B. MarkitWire, UAT, Bloomberg) und bei Eurex Clearing. Falls erforderlich, fordern Sie bitte neue Zuordnungen und Set-ups an.
- aktualisieren Sie bitte Ihre Systeme (z. B. zur Verarbeitung von Reports) mit den neuen Schema-Dateien (Report-XSDs), die ab dem 9. Mai 2016 gültig sind.

Bitte berücksichtigen Sie für Ihre Testaktivitäten die Verfügbarkeit der Simulationsumgebung entsprechend dem Simulationskalender. Ab dem 11. Mai 2016 ist die Simulation von EurexOTC Clear IRS Release 6.1 vollumfänglich verfügbar.

Wie bereits mitgeteilt plant Eurex Clearing, ein neues Kundenzugangs-Modell („ISA-Direkt“) einzuführen, bei dem die Kunden direkte Kontrahenten der verrechneten Geschäfte werden und dabei ein Clearing-Mitglied für den Kunden als „Clearing Agent“ fungiert. Um diese neue Funktion in der Simulation zu testen sowie für weiteren Support kontaktieren Sie bitte das EurexOTC Clear Onboarding Team unter der E-Mail: otcirs.onboarding@eurexclearing.com.

Wir bitten Sie, die Simulation zu nutzen und die neuen Funktionen zu testen. Bitte bestätigen Sie Ihre Bereitschaft zur Aufnahme der Produktion, indem Sie das „Readiness Statement for EurexOTC Clear Release 6.1“ bis spätestens **10. Juni 2016** zurücksenden.

Bei allgemeinen Fragen mit funktionalem Hintergrund zu EurexOTC Clear IRS und spezielle Fragen während der Simulation kontaktieren Sie bitte die EurexOTC Clear Simulation Hotline unter Tel. +49-69-211-1 25 25 oder E-Mail: otcclear.simulation@eurexclearing.com.

20. April 2016