clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 115/16

Datum: 15. September 2016
Empfänger: Alle EurexOTC Clear Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

EurexOTC Clear IRS Release 7.0: Aktualisierte Dokumentation

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 094/16

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 IRS Release 7.0 hat Eurex Clearing verschiedene Dokumente aktualisiert.

Eine Beschreibung der Änderungen, die mit EurexOTC Clear IRS Release 7.0 eingeführt werden, ist Eurex Clearing-Rundschreiben 094/16 sowie dem Dokument „EurexOTC Clear Functional Release Notes“ zu entnehmen.

EurexOTC Clear IRS Release 7.0 wird am **6. Oktober 2016** in der Simulation und am **21. November 2016** in der Produktion eingeführt.

Bitte beachten Sie, dass die Funktionen und Services, die mit diesem Release eingeführt werden, Auswirkungen auf Schnittstellen und Reports der Eurex Clearing haben.

eurex clearing

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

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

EurexOTC Clear IRS Release 7.0: Aktualisierte Dokumentation

Im Zusammenhang mit der Einführung von EurexOTC Clear IRS Release 7.0 hat Eurex Clearing verschiedene Dokumente aktualisiert.

Eine Beschreibung der Änderungen, die mit EurexOTC Clear IRS Release 7.0 eingeführt werden, ist Eurex Clearing-Rundschreiben 094/16 sowie dem Dokument „EurexOTC Clear Functional Release Notes“ zu entnehmen.

EurexOTC Clear IRS Release 7.0 wird am 6. Oktober 2016 in der Simulation und am 21. November 2016 in der Produktion eingeführt.

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 Dokumente	
Aktion	**Dokumentenname/Pfad**
Release Update	• EurexOTC Clear Simulation Guide • EurexOTC Clear Risk Methodology Description **Member Section > Technology > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > IRS Release 7.0 > Overview and Functionality**
Release Update	• FpML Margin Calculator Interface XSD and Samples for Simulation • FpML Margin Calculator Interface Specification • FpML API XSD and Samples for Simulation • FpML API Interface Documents **Member Section > Technology > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > IRS Release 7.0 > Eurex Clearing FpML Interfaces**
Release Update	• EurexOTC Clear IRS GUI User Guide • Margin Calculator Trade Template Field Description • Margin Calculator User Guide + Templates **Member Section > Technology > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > IRS Release 7.0 > EurexOTC Clear GUIs**

Bitte beachten Sie die folgenden Erweiterungen im Release-Umfang, die in der ursprünglichen Release-Ankündigung nicht enthalten waren und die sich auf die Report-Schemas und FpML-XSDs beziehen:

- Eurex Clearing als „Derivatives Clearing Organisation“ (DCO) ist verpflichtet, alle fortlaufenden Daten („continuation data“) für die ursprünglichen Swaps („alpha trades”) einschließlich Beendigungen, an das jeweilige „Swap Data Repository“ (SDR) zu melden, an das der ursprüngliche Swap gemeldet wurde. Um diese neue Anforderung zu unterstützen, werden den Benachrichtigungsmeldungen neue Felder hinzugefügt.

Bitte beachten Sie: Diese Erweiterung ist in allen Dokumenten-Updates enthalten!

Vorbereitungen für die Simulation

Bitte berücksichtigen Sie, dass die Funktionen und Services, die mit diesem Release eingeführt werden (wie Reports und FpML-Meldungen), Auswirkungen auf Schnittstellen der Eurex Clearing haben. Wenn Sie die neuen Währungen testen möchten, senden Sie uns bitte das aktualisierte Formular „EurexOTC Clear Interest Rate Derivative Static Form for Clearing Members / Registered Customer (Simulation)" per E-Mail an otcirs.onboarding@eurexclearing.com.

Bitte beachten Sie die folgenden Punkte:

- 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 bei der „Approved Trade Source" (z. B. für die neuen Währungen) neue Zuordnungen und Set-ups an.
- Die EurexOTC Clear IRS-Simulationsumgebung steht zwischen dem 30. September 2016 (Ende des Geschäftstages) und dem 5. Oktober 2016 (Ende des Geschäftstages) zum Testen nicht zur Verfügung.
- Aktualisieren Sie bitte Ihre Systeme (z. B. zur Verarbeitung von Reports) mit den neuen Schema-Dateien (z. B. Report-XSDs), die für EurexOTC Clear IRS Release 7.0 ab dem 6. Oktober 2016 (Beginn des Geschäftstages) gültig sind.
- Bitte berücksichtigen Sie für Ihre Testaktivitäten die Verfügbarkeit der Simulationsumgebung entsprechend dem Simulationskalender. Ab dem 6. Oktober 2016 ist die Simulation von EurexOTC Clear IRS Release 7.0 vollumfänglich verfügbar.

Neuer Service „EurexOTC Clear simulation newsflash"

Wie bereits für andere Projekte wie C7 angeboten, wird Eurex Clearing den „EurexOTC Clear simulation newsflash" als regulären Informationskanal nutzen, um Ihre Simulationsaktivitäten und Vorbereitungen für EurexOTC Clear Releases zu unterstützen. Mit dem Newsflash wird Eurex Clearing über allgemeine Themen der Simulation, simulationsspezifisches Verhalten sowie bekannte Einschränkungen informieren.

In diesem Zusammenhang bitten wir Sie, einen Projektkoordinatoren zu benennen, der für EurexOTC-Releases verantwortlich ist. Bitte ergänzen Sie die Kontaktdaten in der Member Section der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad:

Member Section > Kontakte > Ihre internen Kontakte > Release-Kontakte

Sollten Sie Fragen haben oder nähere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Group Client Services & Administration unter Tel. +49-69-211-1 17 00 oder memberservices@eurexclearing.com.

15. September 2016