clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 022/12

Datum: 27. März 2012
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ Hohe Priorität

EurexOTC Clear: Eurex Clearing FpML Account, Erweiterungen in Simulation, weitere funktionale und technische Dokumente

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 006/12, 011/12

Kontakt: Matthias Rohe, Tel. +49-69-211-1 78 86, E-Mail: OTCClear.simulation@eurexclearing.com

Zielgruppe:

Ü Alle Abteilungen

Anhänge:

Nur auf der Eurex Clearing-Website, nur in Englisch verfügbar:

1. Eurex Clearing FpML Interface Specification – Volume 2-B: AMQP Programming Guide
2. EurexOTC Clear Preliminary Network Access Information
3. EurexOTC Clear Preliminary Clearing Procedures
4. EurexOTC Clear Simulation Guide (aktualisierte Version)
5. Static Data Form (aktualisierte Version)
6. EurexOTC Clear GUI Screencast

Zusammenfassung:

Eurex Clearing hat die Netting-Funktionalität für Interest Rate Swaps in der EurexOTC Clear-Simulation erweitert und stellt mit diesem Rundschreiben weitere Dokumente zur Eurex Clearing FpML-Schnittstelle sowie weitere neue und aktualisierte funktionale Dokumente zur Verfügung.

Seit dem **26. März 2012** ist die Funktion zum Hochladen eines Zertifikats für die Eurex Clearing FpML-Schnittstelle der Member Section der Eurex Clearing verfügbar. Insbesondere im Hinblick auf die Eurex Clearing FpML-Schnittstelle empfehlen wir interessierten Teilnehmern, rechtzeitig ihre ISVs (Independent Software Vendors) mit entsprechenden Anpassungen der genutzten Vendor-Applikationen zu beauftragen.

Die in diesem Rundschreiben beschriebenen Dokumente sind in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Pfad zum Herunterladen verfügbar:

Current CCP/OTC Releases > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps

Sollten Sie Fragen haben oder zusätzliche Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte Matthias Rohe unter Tel. +49-69-211-1 78 86 oder der E-Mail-Adresse: OTCClear.simulation@eurexclearing.com.

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:
Prof. Dr. Peter Gomez

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

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

EurexOTC Clear: Eurex Clearing FpML Account, Erweiterungen in Simulation, weitere funktionale und technische Dokumente

Eurex Clearing hat die Netting-Funktionalität für Interest Rate Swaps in der EurexOTC Clear-Simulation erweitert und stellt mit diesem Rundschreiben weitere Dokumente zur Eurex Clearing FpML-Schnittstelle sowie weitere neue und aktualisierte funktionale Dokumente zur Verfügung.

Insbesondere im Hinblick auf die Eurex Clearing FpML-Schnittstelle empfehlen wir interessierten Teilnehmern, rechtzeitig ihre ISVs (Independent Software Vendors) mit entsprechenden Anpassungen der genutzten Vendor-Applikationen zu beauftragen.

Erweiterung in der Member Section im Bereich „EurexOTC Clear FpML Account“ zum Hochladen eines Zertifikats

Für die Eurex Clearing FpML-Schnittstelle ist es erforderlich, ein Zertifikat zu generieren und in der Member Section der Eurex Clearing hochzuladen. Die Funktion zum Hochladen des Zertifikats ist im Dokument „Eurex Clearing FpML Interface Specification – Volume 2: Connectivity” beschrieben. Seit dem 26. März 2012 ist diese Funktion in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad verfügbar:

Technische Anbindung > Technische Benutzeradministration > EurexOTC Clear FpML Account

bzw. für Zentrale Koordinatoren und deren Vertreter:

Benutzerverwaltung & Zentraler Koordinator > Anlegen > EurexOTC Clear FpML Account

Das genannte Dokument steht in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad zum Herunterladen zur Verfügung:

Current CCP/OTC Releases > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > Interfaces

Sollten Sie Fragen haben oder zusätzliche Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte das Member Section Team unter Tel. +49-69-211-1 78 88 oder der E-Mail-Adresse: member.section@eurexclearing.com.

Bitte beachten Sie, dass die Nutzung der neuen Eurex Clearing FpML-Schnittstelle über die Transportschicht AMQP ab Anfang April 2012 möglich ist.

Erweiterung der EurexOTC Clear Netting/Accumulation-Funktionalität für IRS in Simulation

Eurex Clearing erweitert die EurexOTC IRS Clear Netting-Funktionalität in Simulation und stellt damit einen integrierten Netting-Prozess zur Verfügung.

Zur Erhöhung der Flexibilität können Clearing-Teilnehmer Verrechnung (Netting) durchführen, indem sie die folgenden Netting-Parameter pro Positionskonto (A1-A9, P) und Netting Strings pro Teilnehmer (Clearing Member, Registered Customer) setzen:

- Netting-Parameter
  - O – Die Standardeinstellung. Geeignete Transaktionen, die mit dem gleichen Netting String markiert wurden, werden miteinander verrechnet.
  - Y – Geeignete Transaktionen, die mit dem gleichen Netting String markiert wurden, werden miteinander verrechnet. Auch geeignete Transaktionen ohne Netting String werden miteinander verrechnet.
  - N – Es findet keine Verrechnung auf diesem Konto statt.

  Netting-Parameter können auf Wunsch des Teilnehmers über das „Static Data Form“ aufgesetzt und verändert werden.

- Netting String

  Clearing-Mitglieder können alle Netting Strings (oder Stichworte), die für das Netting genutzt werden sollen, der Eurex Clearing mitteilen. Mittels der Netting Strings können Verrechnungsgruppen anhand von vorhandenen Handelsinformationen definiert werden, wodurch eine höhere Granularität innerhalb eines Positionskontos geschaffen wird.

  Erlaubte Netting Strings sind eine Liste von alphanumerischen Zeichenketten. Nur diese vordefinierten, erlaubten Netting Strings können auf Geschäftsebene einem bestimmten Mitglied (Clearing Member, Registered Customer) zugeordnet werden. Erlaubte Netting Strings müssen über das Static Data Form mitgeteilt werden. Für zukünftige Releases ist vorgesehen, die Definition und Änderung erlaubter Netting Strings in das EurexOTC Clear GUI zu integrieren.

Eurex Clearing FpML Interface-Dokumentationen

Die nachfolgenden Dokumente richten sich an System-Designer und Programmierer, die ihre Client-Anwendung entwickeln/anpassen wollen, um mit der Eurex Clearing FpML-Schnittstelle interagieren zu können.

Eurex Clearing FpML Interface Specification – Volume 2-B: AMQP Programming Guide

Das Dokument „Volume 2-B: AMQP Programming Guide" enthält Code-Beispiele zur Unterstützung von Entwicklern, die ihre Anwendungen an die AMQP-Server der Eurex Clearing anbinden möchten.

EurexOTC Clear Preliminary Network Access Information

Das Dokument „Network Access Information" enthält IP-Adressen und Port-Informationen, die für die erfolgreiche Anbindung an die FpML Clearing-Schnittstelle in der Simulationsumgebung notwendig sind.

Die Dokumente sind in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad zum Herunterladen verfügbar:

Current CCP/OTC Releases > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > Interfaces

Neue und aktualisierte funktionale Dokumente

EurexOTC Clear Preliminary Clearing Procedures

Der Zweck dieses Dokuments ist es, den Nutzern des EurexOTC Clear-Service einen breiten Überblick über den Service mit Schwerpunkt auf funktionale Aspekte zu geben. Es enthält Informationen über das Clearinghaus selbst, unterstützte Produkte, Teilnehmer- und Kontenstruktur, Zulassungskriterien, Geschäftsabschluss und -verarbeitung, Verfahren im Zusammenhang mit Margin, Sicherheiten- und Cash-Management, Verfahren bei Ausfall eines Geschäftskontrahenten (Default Management), Reporting und Entgelte.

Bitte beachten Sie: Dieses Dokument ist nicht rechtsverbindlich.

EurexOTC Clear Static Data Form (aktualisierte Version)

Um eine frühestmögliche Teilnahme an der Simulation zu ermöglichen, werden interessierte Mitglieder gebeten, das ausgefüllte „EurexOTC Clear Static Data Form" für Clearing-Mitglieder bzw. für Registered Customers einzureichen. Das Static Data Form wurde aktualisiert, um das Aufsetzen der erweiterten Netting-Parameter und Netting Strings zu ermöglichen.

EurexOTC Clear Simulation Guide (aktualisierte Version)

Der Simulation Guide beschreibt den Registrierungsprozess für die Teilnahme an der Simulation Weiterhin ist eine Beschreibung der Geschäftseingabe über das MarkitWire UAT-System sowie die über das neue EurexOTC Clear GUI angebotenen Post-Trade Clearing-Services enthalten. Der Simulation Guide wurde mit Informationen zu der erweiterten Netting-Funktionalität aktualisiert.

Die Dokumente sind in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad zum Herunterladen verfügbar:

Current CCP/OTC Releases > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > Functional Manuals

EurexOTC Clear GUI Screencast

Das EurexOTC Clear GUI bietet Clearing-Mitgliedern einen Echtzeit-Zugang zu ihren eigenen IRS-Geschäften und zu denen ihrer Kunden, unterstützt die Geschäftseingabe sowie eine Vielzahl von Post-Trade-Events auf verrechnete Geschäfte.

Dieses Screencast stellt Ihnen alle relevanten Informationen zur Verfügung, um das EurexOTC Clear GUI technisch einzurichten und sich anzumelden. Unser Experte führt Sie durch den notwendigen Zwei-Faktor-Authentifizierungsprozess einschließlich einer einfachen Schritt-für-Schritt-Beschreibung beispielhaft für ein Clearing-Mitglied.

Das Screencast ist in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad verfügbar:

Current CCP/OTC Releases > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > Interfaces

Sollten Sie Fragen haben oder zusätzliche Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte Matthias Rohe unter der Telefonnummer +49-69-211-1 78 86 oder E-Mail-Adresse: OTCClear.simulation@eurexclearing.com.

27. März 2012