clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 095/11

Datum: 28. November 2011
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ **Hohe Priorität**

EurexOTC Clear: Funktionale und technische Dokumente

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 084/11

Kontakt: Matthias Rohe, Tel. +49-69-211-1 78 86, E-Mail: matthias.rohe@deutsche-boerse.com

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- Revision/Security Coordination

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

1. EurexOTC Clear Customer Roadmap
2. EurexOTC Clear Preliminary Risk Methodology Description
3. EurexOTC Clear Preliminary GUI User Guide
4. EurexOTC Clear Preliminary Report Manual
5. Common Report Engine (CRE) User Guide
6. Eurex @X-tract Clearing GUI User Guide

Zusammenfassung:

Wie mit Eurex Clearing-Rundschreiben 084/11 vom 10. November 2011 angekündigt, stellt Eurex Clearing mit diesem Rundschreiben weitere Dokumente zur Vorbereitung auf die Simulation und Einführung des EurexOTC Clear-Service für Interest Rate Swaps zur Verfügung. Der Start der EurexOTC Clear Simulation ist für den **29. November 2011** geplant.

Die in diesem Rundschreiben beschriebenen funktionalen Dokumente sind auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexclearing.com > Member Section > Releases > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > Functional Manuals

Die in diesem Rundschreiben beschriebenen technischen Dokumente sind auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexclearing.com > Member Section > Releases > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > Technical Manuals

Unter der Überschrift „EurexOTC Clear" stellt Eurex Clearing ihren neuen Service für das Clearing von OTC-Produkten vor. Für weitergehende Informationen (z.B. Produktübersicht, funktionale Modellbeschreibung) zum EurexOTC Clear Service wurde auf der Eurex Clearing-Website die neue Rubrik „EurexOTC Clear" eingerichtet. Die neue Rubrik finden Sie unter dem Pfad:

www.eurexclearing.com > EurexOTC > EurexOTC Clear

Sollten Sie Fragen haben oder zusätzliche Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte Matthias Rohe unter Tel. +49-69-211-1 78 86.

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
customer.support@
eurexchange.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: Funktionale und technische Dokumente

Wie mit Eurex Clearing-Rundschreiben 084/11 vom 10. November 2011 angekündigt, stellt Eurex Clearing mit diesem Rundschreiben weitere Dokumente zur Vorbereitung auf die Simulation und Einführung des EurexOTC Clear-Service für Interest Rate Swaps zur Verfügung.

Der Start der EurexOTC Clear Simulation ist für den 29. November 2011 geplant.

Die in diesem Rundschreiben beschriebenen funktionalen Dokumente wurden auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexclearing.com > Member Section > Releases > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > Functional Manuals

Zum direkten Zugang zu den Dokumenten klicken Sie bitte auf folgenden Link:
https://www.eurexchange.com/members/releases/otc_clear/irs_manuals_functional_en.html

Die in diesem Rundschreiben beschriebenen technischen Dokumente sind auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexclearing.com > Member Section > Releases > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > Technical Manuals

Zum direkten Zugang zu den Dokumenten klicken Sie bitte auf folgenden Link:
https://www.eurexchange.com/members/releases/otc_clear/irs_manuals_technical_en.html

Es wurden die folgenden Dokumente veröffentlicht:

Funktionale Dokumente

- **EurexOTC Clear Customer Roadmap**
  In diesem Dokument sind die empfohlenen Aktivitäten im Zusammenhang mit der Einführung von EurexOTC Clear aufgeführt. Ziel des Dokuments ist, die Teilnehmer bei der Planung zu unterstützen.

- **EurexOTC Clear Preliminary Risk Methodology Description**
  Der Zweck dieses Dokuments ist es, Teilnehmern und Vendoren Informationen bereitzustellen, um ihnen die Berechnung der Margin-Anforderungen nach der Margin-Methodik zu ermöglichen.

Technische Dokumente

- **EurexOTC Clear Preliminary GUI User Guide**
  Das Dokument beschreibt die Nutzung der graphischen Benutzeroberfläche (GUI) für EurexOTC Clear, dem neuen browser-basierten GUI für OTC-gehandelte Zinsprodukte. Das GUI bietet Clearing-Teilnehmern einen Echtzeit-Zugriff auf ihre Geschäfte sowie die ihrer angeschlossenen Kunden. Es unterstützt den Geschäftseingabeprozess (Take-up) und eine Reihe von Nachhandelsereignissen auf im Clearing befindliche Geschäfte.

- **EurexOTC Clear Preliminary Report Manual**
  Das Dokument liefert eine detaillierte Beschreibung über Aufbau und Inhalt der Reports, die mit EurexOTC Clear für Interest Rate Swaps zur Verfügung gestellt werden (Zweck, Häufigkeit, Feldbeschreibungen, Empfänger). Das Dokument beschreibt sowohl Clearing-Reports als auch Risk-Reports.

- **Common Report Engine User Guide**
  Für EurexOTC Clear werden Reports auch über die Common Report Engine versandt. Dieser Service basiert auf einem sicheren FTP-(Report)-Server und ermöglicht es den Teilnehmern, Reports von einer einzigen Stelle zu beziehen. Der Service ist gleichwertig zu dem bereits bestehenden Prozess für an der Eurex zugelassene Produkte (Listed Business).

- **Eurex @X-tract Clearing GUI User Guide**
  Das Dokument beschreibt die Nutzung des Eurex @X-tract Clearing-GUI, welches von Clearing-Teilnehmern hauptsächlich für das Sicherheiten- und Risiko-Management, aber auch für das Positions- und Trade Management von an Eurex-Börsen gehandelten Derivaten genutzt wird.

Neue Rubrik „EurexOTC Clear" auf der Eurex Clearing-Website

Unter der Überschrift „EurexOTC Clear" stellt Eurex Clearing ihren neuen Service für das Clearing von OTC-Produkten vor. Für weitergehende Informationen (z.B. Produktübersicht, funktionale Modellbeschreibung) zum EurexOTC Clear Service wurde auf der Eurex Clearing-Website die neue Rubrik „EurexOTC Clear" eingerichtet. Die neue Rubrik finden Sie unter dem Pfad:

www.eurexclearing.com > EurexOTC > EurexOTC Clear

Zum direkten Zugang klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexclearing.com/markets/otc/clear_en.html

Sollten Sie Fragen haben oder zusätzliche Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte Matthias Rohe unter der Telefonnummer +49-69-211-1 78 86.

28. November 2011