clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 080/13

Datum: 5. Juli 2013
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG sowie Vendoren
Autorisiert von: Dr. Thomas Book

EurexOTC Clear für Interest Rate Swaps, Release 2.1: Aktualisierte Dokumentation

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 066/13

Kontakt: Member Services & Admission, T +49-69-211-1 17 00, memberservices@eurexclearing.com;
OTC IRS Helpdesk, T +49-69-211-1 28 28, OTCClear@eurexclearing.com

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ Middle + Backoffice ➲ IT/System Administration ➲ Revision/Security Coordination	keine

Zusammenfassung:

Im Zusammenhang mit der Einführung von EurexOTC Clear Release 2.1 hat Eurex Clearing verschiedene funktionale und technische Dokumente für die Vorbereitung auf die Simulation und den Produktionsstart aktualisiert. Die Dokumente sind in diesem Rundschreiben genannt.

Die Release-Simulation ist vom 16. Juli bis 9. August 2013 geplant. Weiterführende Informationen zur Simulation können dem aktualisierten Simulation Guide entnommen werden, der mit diesem Rundschreiben veröffentlicht wurde.

Die Einführung von Release 2.1 in Produktion ist für den **12. August 2013** geplant.

Die Dokumente wurden in der Member Section der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

https://member.eurexclearing.com > Clearing Ressourcen > Releases > EurexOTC Clear > IRS Release 2.1

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:
Dr. Thomas Book (Vorsitzender),
Jürg Spillmann (stv. Vorsitzender),
Heike Eckert, Thomas Laux,
Erik Tim Müller, Andreas Preuß

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

EurexOTC Clear für Interest Rate Swaps, Release 2.1: Aktualisierte Dokumentation

Im Zusammenhang mit der Einführung von EurexOTC Clear Release 2.1 hat Eurex Clearing verschiedene funktionale und technische Dokumente für die Vorbereitung auf die Simulation und den Produktionsstart aktualisiert.

Wie mit Eurex Clearing-Rundschreiben 066/13 mitgeteilt, wird Eurex Clearing ihren EurexOTC Clear Service für Interest Rate Swaps (IRS) um die folgenden Funktionalitäten und Services erweitern:

- Bulk-Backloading: Laden von historischen IRS-Geschäften über ein anerkanntes Trade Source-System
- Near Time Clearing: Ermöglicht Novation direkt nach der Risikoprüfung
- Erweiterungen im Bereich Risikokontrolle wie die Erweiterung des „Liquidity Adjustment", Anpassung bestehender und Einführung neuer Risk Reports
- Erweiterung des EurexOTC Clear Margin Calculator um die Funktion einer „Was-wäre-wenn-Analyse"
- Erweiterung des Produktumfangs durch Einführung weiterer Kalender und flexiblere „Trade Fees"
- Erweiterung des FpML Interface, um die Anbindung weiterer „Trade Flow Provider"/anerkannter Trade Source-Systeme zu ermöglichen
- Erweiterung und Änderung der EurexOTC Clear-Schnittstellen zur Unterstützung der vorgenannten Erweiterungen

Die folgenden Dokumente wurden im Zusammenhang mit den oben genannten neuen Funktionen und Services aktualisiert:

- EurexOTC Clear Risk Methodology Description Interest Rate Swaps (IRS) – Preliminary Version
- FpML Interface Specification – Volume 1: Overview – Updated Programming Version
- FpML Interface Specification – Volume 3: Trade Notification and Take-up Confirmation – Updated Version
- FpML Interface Specification – Volume 3-A: Post Trade Events – Updated Version
- FpML Interface Specification – Volume 3-B: Eurex FpML API for Trade Entry – Programming Version
- FpML API XSD and Samples (Current Version) for Simulation – Updated Version
- Report Manual Interest Rate Swaps (IRS) – Updated Version
- Simulation Guide – Updated Version
- Static Data Form for Clearing Member and Registered Customer (Simulation)
- EurexOTC Clear IRS GUI User Guide – Updated Version
- EurexOTC Clear Margin Calculator User Guide – Updated Version

Die Dokumente stehen zum Herunterladen in der Member Section auf der Website der Eurex Clearing unter dem folgenden Pfad zu Verfügung:

https://member.eurexclearing.com > Clearing Ressourcen > Releases > EurexOTC Clear > IRS Release 2.1

Bei Fragen und für weitere Auskünfte nehmen Sie bitte Kontakt auf mit Member Services & Admission unter Tel. +49-69-211-1 17 00, E-Mail memberservices@eurexclearing.com. Für OTC IRS-spezifische Anfragen kontaktieren Sie bitte das EurexOTC IRS Helpdesk unter Tel. +49-69-211-1 28 28 oder E-Mail OTCClear@eurexclearing.com.