clear to trade

e u r e x c l e a r i n g
rundschreiben 088/13

Datum: 23. 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 und Informationen zum Produktionsstart

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:

- Ü Middle + Backoffice
- Ü IT/System Administration
- Ü Revision/Security Coordination

Anhänge:
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.

Ab dem **12. August 2013** wird EurexOTC Clear für Interest Rate Swaps (IRS), Release 2.1 für Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden verfügbar sein.

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 > Interest Rate Swaps > 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 und Informationen zum Produktionsstart

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: historische IRS-Geschäfte werden aus dem trade-by-trade Incremental Risk Check ausgeschlossen und stattdessen auf einer Portfolio-Basis einmal am Tag geprüft
- Near Time Clearing: Ermöglicht rechtliche 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 Feiertagskalender und flexiblerer „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.

Ab dem 12. August 2013 wird EurexOTC Clear für Interest Rate Swaps (IRS), Release 2.1 mit allen oben genannten Funktionen und Services für Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden verfügbar sein.

Die folgenden Dokumente wurden im Zusammenhang mit den obengenannten neuen Funktionalitäten und Services aktualisiert:

- Sample OTC IRS Reports - Updated and New Reports
- EurexOTC Clear IRS XML Schemas
- Report Manual Interest Rate Swaps (IRS) - Final Version
- EurexOTC Clear IRS Procedures Manual - Updated Version
- Beispiel-Portfolio im Margin-Calculator-Template
- Flexible Account Bulk Upload sheet - Updated Version
- Eurex Clearing FpML Specifications - Final Versions

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 > Interest Rate Swaps > IRS Release 2.1

Wichtige Informationen zum Produktionsstart

- Nutzung der Bulk-Backloading-Funktionalität: Eurex Clearing bietet allen Clearing-Mitgliedern, die diese Funktionalität nutzen wollen, eine geführte Bulk-Back Loading Session an. Um sich für diese Session anzumelden, wenden Sie sich bitte an Ihren Key Account Manager oder nutzen Sie den On-Boarding Team-Kontakt.

- Bitte beachten Sie, dass Eurex Clearing aufgrund von Vorbereitungen für den Produktionsstart und notwendigen Umstellungen den EurexOTC Clear Service am Freitag, dem 9. August 2013 schon um 20:00 Uhr MEZ schließen wird. Der EurexOTC Clear Service wird am Montag, dem 12. August 2013 ab 8:00 Uhr MEZ wieder verfügbar sein.

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

23. Juli 2013