clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 103/16

Datum: 12. August 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 und Beispiel-Reports, XSDs sowie Beispiel-FpML Broadcast Messages veröffentlicht.

Eine Beschreibung der Änderungen, die mit EurexOTC Clear IRS Release 7.0 eingeführt werden, ist Eurex Clearing-Rundschreiben 094/16 sowie den „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 und Beispiel-Reports, XSDs sowie Beispiel-FpML Broadcast Messages veröffentlicht.

Eine Beschreibung der Änderungen, die mit EurexOTC Clear IRS Release 7.0 eingeführt werden, ist Eurex Clearing-Rundschreiben 094/16 sowie den „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.

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	**Name des Dokuments/Pfad**
Release Update	• EurexOTC Clear Functional Release Notes – Preliminary Version **Member Section > Technology > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > IRS Release 7.0 > Overview and Functionality**
Release Update	• EurexOTC Clear Report Manual – Preliminary Version
	• EurexOTC Clear Sample Reports & XSD - Updated and New Reports – Preliminary Version **Member Section > Technology > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > IRS Release 7.0 > EurexOTC Clear Reports**

Bitte beachten Sie die folgenden Erweiterungen im Rahmen des Release, die ursprünglich nicht in der Release-Ankündigung enthalten waren, und die nur das EurexOTC Clear GUI betreffen:

- Unterstützung von Mass Confirmation/Rejection/Authorization für PTEs und Aktivitäten zu bilateralen Geschäften über das EurexOTC Clear GUI
- Unterstützung von „Multiple Trade Transfers” über das EurexOTC Clear GUI
- Zur Identifizierung von historischen Geschäften, die per Backloading hochgeladen wurden, wird der FpML Broadcast Message ein neues optionales Feld hinzugefügt.

Simulationskalender für EurexOTC Clear IRS

Der Simulationskalender für die EurexOTC Clear IRS-Simulation für den Zeitraum 5. September 2016 bis 1. Januar 2017 befindet sich im Anhang zu diesem Rundschreiben.

Detaillierte Informationen sowie der aktuelle Zeitplan für Batch- und Fokus-Tage innerhalb der Simulation stehen in der Member Section der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Link zur Verfügung:

Member Section > Technology > Simulation > EurexOTC Clear Simulation

Bitte beachten Sie, dass im Zeitraum vom 19. September bis zum 23. September 2016 keine Entgelt-Reports (CB185 Daily OTC CCP Fee Statement) geliefert werden.

Bereinigung der Simulationsumgebung

Um bereits vor der Einführung von Release 7.0 (am 6. Oktober 2016 in Simulation) die Qualität der EurexOTC Clear-Simulationsumgebung zu verbessern, wird Eurex Clearing eine strukturierte Bereinigung älterer Handelsaktivitäten in der Simulationsumgebung vornehmen.

Aus diesem Grund werden alle Handelsaktivitäten, die vor Montag, dem 9. Mai 2016 (Beginn der EurexOTC Clear IRS Release 6.1 Simulation) erfasst wurden, nicht mehr in der Simulationsumgebung zur Verfügung stehen. Dieser Prozess wird bei jeder größeren Release-Einführung wiederholt, was bedeutet, dass nur die Handelsaktivitäten in der Simulationsumgebung aufrufbar sein werden, die während der Entwicklung der aktuellen Release-Version erfasst wurden.

Bei Fragen zur Bereinigung der Simulationsumgebung oder wenn Sie Ihre alten Handelsaktivitäten behalten möchten, wenden Sie sich bitte an Ihren Account Manager bei Client Services Clearing oder senden Sie eine E-Mail an otcirs.onboarding@eurexclearing.com.

„Readiness Statement“

Wir bitten alle Clearing-Mitglieder, ihre Bereitschaft zur Aufnahme der Produktion unter EurexOTC Clear IRS Release 7.0 mit Hilfe des „Readiness Statement“ **bis spätestens 18. November 2016** zu bestätigen. Das „Readiness Statement“ ist den „EurexOTC Clear Functional Release Notes“ angehängt, die in der Member Section der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad abgerufen werden können:

Member Section > Technology > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > IRS Release 7.0 > Overview and Functionality

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte Group Client Services & Administration unter Tel. +49-69-211-1 17 00 oder per E-Mail an memberservices@eurexclearing.com.

12. August 2016