clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 131/16

Datum: 28. Oktober 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: Ankündigung des Produktionsstarts und UTI-Prefixänderung auf 10 Zeichen

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 094/16

Kontakt: Group Client Services & Administration, T +49-69-211-1 17 00, memberservices@eurexclearing.com

Zielgruppe:
➲ Alle Abteilungen

Anhänge:
keine

Zusammenfassung:

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing den Produktionsstart von EurexOTC Clear Release 7.0 am **21. November 2016** an. Eine Beschreibung der Änderungen, die mit EurexOTC Clear Release 7.0 eingeführt werden, entnehmen Sie bitte Eurex Clearing-Rundschreiben 094/16 sowie den „EurexOTC Clear Functional Release Notes“.

Bitte beachten Sie, dass die mit diesem Release eingeführten Funktionen und Services Auswirkungen auf die Schnittstellen und Reports von Eurex Clearing haben werden.

Unter Bezugnahme auf die Allgemeinen Geschäftsbedingungen zum Vertrag über die technische Anbindung an die Clearing-EDV der Eurex Clearing AG (Eurex Clearing) (Anschlussvertrag) bitten wir die Eurex Clearing-Mitglieder, das ausgefüllte „Readiness Statement“ bis **19. November 2016** zurückzusenden.

Desweiteren hat Eurex Clearing beschlossen, den UTI-Prefix von 11 Zeichen auf 10 Zeichen zu ändern (Eurex Clearing UTI-Prefix: 1050000007), um so der Empfehlung der ISDA (International Swaps and Derivatives Association) zu entsprechen. Weitere Informationen sind dem ISDA-Dokument „Unique Trade Identifier (UTI): Generation, Communication and Matching” zu entnehmen, welches unter dem folgenden Pfad zur Verfügung steht: http://www2.isda.org/docssearch.

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: Ankündigung des Produktionsstarts und UTI-Prefixänderung auf 10 Zeichen

Mit diesem Rundschreiben kündigt Eurex Clearing den Produktionsstart von EurexOTC Clear Release 7.0 am 21. November 2016 an.

Eine Beschreibung der Änderungen, die mit EurexOTC Clear Release 7.0 eingeführt werden, entnehmen Sie bitte Eurex Clearing-Rundschreiben 094/16 sowie den „EurexOTC Clear Functional Release Notes“.

Bitte beachten Sie, dass die mit diesem Release eingeführten Funktionen und Services Auswirkungen auf die Schnittstellen und Reports von Eurex Clearing haben werden.

Der folgende Überblick enthält wichtige Informationen zu den Dokumenten, die kürzlich in der Member Section der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com veröffentlicht wurden:

Veröffentlichte Dokumente	
Aktion	**Name des Dokuments/Pfad**
Release Update	• EurexOTC Clear Procedure Manual • EurexOTC Clear Product List **Member Section > Technology > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > IRS Release 7.0 > Overview and Functionality**

1. Aktivierung neuer Währungen

Clearing-Mitglieder, die Swaps in den neuen Produktwährungen Norwegische Krone (NOK), Schwedische Krone (SEK), Dänische Krone (DKK) und Polnischer Zloty (PLN) abwickeln wollen, benötigen die entsprechende Geldinfrastruktur für die Verarbeitung dieser Produkte entweder über eine direkte Anbindung über die Deutsche Bank AG London als „Multi Currency Payment Bank“ oder über eine Korrespondenzbank, welche eine solche Verbindung hat. Ein OTC IRS Registrierter Kunde, der diese Produkte über Eurex Clearing abwickelt, braucht eine Clearing-Beziehung mit einem Clearing-Mitglied mit der genannten Infrastruktur.

Clearing-Mitglieder (CM) und Registrierte Kunden (RCs), die für die Abwicklung der folgenden Produkte aktiviert werden möchten, müssen die entsprechenden Dokumente vorlegen:

- CM/RC: „EurexOTC Clear Interest Rate Derivative Static Data Formular für Clearing-Mitglieder / Registrierte Kunden”
- CM: „Antrag auf Einrichtung / Löschung / Änderung von Sicherheiten Konten und Clearer-Geldkonten“

Bitte überprüfen Sie Ihre Rollen und Mappings und beantragen Sie, falls nötig, bei Ihrer „Approved Trade Source“ (MarkitWire, Bloomberg etc.) neue Mappings und Set-ups.

2. Produktionsvorbereitung

Bitte beachten Sie, dass die Funktionen und Services, die mit diesem Release eingeführt werden (wie Reports und FpML-Nachrichten) Auswirkungen auf die Schnittstellen von Eurex Clearing haben. Bitte aktualisieren Sie Ihre Systeme (z.B. für die Verarbeitung von Reports) mit den neu erstellten Schemas (z.B. Report-XSDs), die ab dem 21. November 2016 (Geschäftsbeginn) für EurexOTC Clear IRS Release 7.0 gültig sind, damit Sie auf den Produktionsstart vorbereitet sind.

Bitte beachten Sie: Nach der Batch-Verarbeitung am Freitag, den 18. November 2016, werden die Reports auf Basis der EurexOTC Clear Release 6.1-Formate generiert. Untertägige und Tagesend-Reports werden ab Montag, den 21. November 2016, Geschäftsbeginn, auf Basis der EurexOTC Clear Release 7.0-Formate generiert.

Ein Satz aller geänderten XSDs wurde zum Download in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Pfad eingestellt:

Member Section > Technology > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > IRS Release 7.0 > EurexOTC Clear Reports > EurexOTC Clear Sample Reports & XSD - Updated and New Reports

Mit dem Start von Release 7.0 wird ein kompletter Satz aller gültigen XSDs zum Download in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Pfad zur Verfügung gestellt:

Member Section > Technology > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > Network Access

3. Readiness Statement

Unter Bezugnahme auf die Allgemeinen Geschäftsbedingungen zum Vertrag über die technische Anbindung an die Clearing-EDV der Eurex Clearing AG (Eurex Clearing) (Anschlussvertrag) bitten wir die Eurex Clearing-Mitglieder, das ausgefüllte „Readiness Statement“ bis Freitag, den 19. November 2016 zurückzusenden.

Das „Readiness Statement” steht unter dem folgenden Link in der Member Section der Eurex Clearing-Website zum Herunterladen zur Verfügung:

Technology > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > IRS Release 7.0 > Overview & Functionality

4. UTI Prefix-Änderung auf 10 Zeichen

Zur Erfüllung der Anforderungen des EMIR-Reporting müssen alle OTC-Derivatetransaktionen unter Verwendung eines „Unique Transaction Identifier“ (UTI) gemeldet werden. Wie mit Rundschreiben 102/15 angekündigt, hat Eurex Clearing aufgrund von externen Abhängigkeiten den UTI-Prefix (aka „Namespace“, „UTI Issuer“) auf „E01XXXXECAG“ umgestellt. Dieser Code ist eine Kombination des „ESMA Method Identifier“ (E01), des MIC-Code (ISO 10383) des zugehörigen Handelsplatzes sowie des MIC-Code (ISO 10383) der zugehörigen Clearing-Stelle.

Um den Empfehlungen der ISDA zu entsprechen, hat Eurex Clearing nun entschieden, den UTI-Prefix von 11 Zeichen auf 10 Zeichen („1050000007”) zu ändern. Dies ist derselbe Wert wie der USI-Prefix.

Weitere Informationen sind dem ISDA-Dokument „Unique Trade Identifier (UTI): Generation, Communication and Matching” zu entnehmen, welches auf der Website http://www2.isda.org/docssearch zur Verfügung steht.

Die Änderungen treten in Simulation am 31. Oktober 2016 in Kraft, in Produktion am 21. November 2016.

Der „UTI” wird in Benachrichtigungen zu Geschäften, Bestätigungen für Geschäftseingaben, Reports für Mitglieder sowie Benachrichtigungen zu Ausnahmen verwendet (Report XML Feld ‘UTIIssuer’ und ‘priorUTIIssuer’; FpML tag ‘issuer’). Die Änderung gilt nur für neu eingegebene Geschäfte.

Die Beispielreports, Beispiel-FpML-Nachrichten und Dokumente werden entsprechend angepasst. Bitte beachten Sie, dass es in der Struktur der FpML Schema-Dateien und in den Report-XSDs keine Änderungen gibt. Der Prefix für börsengehandelte Derivate bleibt unverändert.

Sollten Sie Fragen haben oder nähere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Group Client Key Account Management Clearing unter Tel. +49-69-211-1 17 00 oder memberservices@ eurexclearing.com.

28. Oktober 2016