clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 088/16

Datum: 4. Juli 2016
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

Einführung von Eurex Clearing's C7 Release 3.1

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 060/15

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 061/16

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

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ Alle Abteilungen	Keine

Zusammenfassung:

Am 9. Mai 2016 hat Eurex Clearing erfolgreich die C7 Release 3.0-Architektur eingeführt. Eurex Clearing wird diese Architektur durch die Einführung verschiedener neuer Marktfunktionalitäten sowie durch die Erweiterung bereits bestehender Funktionen mit der Einführung von C7 Release 3.1 weiterentwickeln. Die Einführung ist für den **21. November 2016** geplant.

Die folgenden Marktfunktionalitäten und Erweiterungen bestehender Funktionen werden mit C7 Release 3.1 eingeführt:

- „Average Pricing"-Funktionalität („Average Price Processing")
- Regelbasierte automatische Glattstellungs-Funktion („Rule Based Automatic Close-outs")
- Transaktionsmanagement für vorläufig bepreiste Transaktionen („Preliminary Priced Transaction Adjustments")
- Konvertierung von Positionen in Flexiblen Kontrakten („Conversion of Flexible Contract Positions")
- Erweitertes Vier-Augen-Prinzip („Enhanced Four-Eye Principle")

Zusätzlich zu den oben genannten C7 Release 3.1-Funktionen und in Vorbereitung auf die Migration von Trade-Entry-Services nach T7 wird Eurex Clearing weitere Änderungen an der FIXML-Schnittstelle durchführen.

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

Einführung von Eurex Clearing‘s C7 Release 3.1

Am 9. Mai 2016 hat Eurex Clearing erfolgreich die C7 Release 3.0-Architektur eingeführt. Eurex Clearing wird diese Architektur durch die Einführung verschiedener neuer Marktfunktionalitäten sowie durch die Erweiterung bereits bestehender Funktionen mit der Einführung von C7 Release 3.1 weiterentwickeln. Die Einführung ist für den 21. November 2016 geplant.

Die folgenden Marktfunktionalitäten und Erweiterungen bestehender Funktionen werden mit C7 Release 3.1 eingeführt:

- „Average Pricing“-Funktionalität („Average Price Processing“)
- Regelbasierte automatische Glattstellungs-Funktion („Rule Based Automatic Close-outs”)
- Transaktionsmanagement für vorläufig bepreiste Transaktionen („Preliminary Priced Transaction Adjustments“)
- Konvertierung von Positionen in Flexiblen Kontrakten („Conversion of Flexible Contract Positions“)
- Erweitertes Vier-Augen-Prinzip („Enhanced Four-Eye Principle“)

Zusätzlich zu den oben genannten C7 Release 3.1-Funktionen und in Vorbereitung auf die Migration von Trade-Entry-Services nach T7 wird Eurex Clearing weitere Änderungen an der FIXML-Schnittstelle durchführen.

Neue Marktfunktionalitäten und Erweiterungen bestehender Funktionen

Transaktionsmanagement für vorläufig bepreiste Transaktionen („Average Price Processing”)

Die „Average Price“-Funktionalität erlaubt es, mehrere Transaktionen, die bereits zu unterschiedlichen Preisen ausgeführt wurden, in einer Transaktion zu dem von Eurex Clearing berechneten Durchschnittspreis zusammenzuführen. Mit der Verarbeitung von Durchschnittspreisen ist auch eine „De-Merge-Funktion“ verfügbar, die es ermöglicht, die Zusammenführung rückgängig zu machen und die ursprünglichen Transaktionen zu reaktivieren.

Regelbasierte automatische Glattstellungs-Funktion („Rule Based Automatic Close-outs”)

Den Clearing-Mitgliedern, Nicht-Clearing-Mitgliedern und Registrierten Kunden wird die Funktion einer automatischen Glattstellung („Rule Based Automatic Close-outs“) auf Ebene der Positionskonten zur Verfügung gestellt. Bei Nutzung dieser Funktion wird die Glattstellung der Positionen jeweils zum Tagesende („end of day“) wirksam.

Transaktionsmanagement für vorläufig bepreiste Transaktionen („Preliminary Priced Transaction Adjustments“)

Transaktionen, die als vorläufig bepreist gekennzeichnet sind, können per Transaktionsmanagement bearbeitet werden.

Konvertierung von Positionen in Flexiblen Kontrakten („Conversion of Flexible Contract Positions“)

Wenn der Fälligkeitstag eines Flexiblen Kontrakts auf einen Feiertag bei Eurex fällt, konvertiert Eurex Clearing automatisch das Fälligkeitsdatum auf den letzten Geschäftstag vor dem Feiertag („Conversion of Flexible Contract Positions“).

Identische Positionen Flexibler Kontrakte, die aus einer Kapitalmaßnahme resultieren, werden zusammengeführt.

Eurex Clearing wird die Eurex Clearing FIXML-Schnittstelle um eine Nachricht zum entsprechenden FIXML-Positions-Update ergänzen.

Erweitertes Vier-Augen-Prinzip („Enhanced Four-Eye Principle“)

Für Clearing-Prozesse, bei denen ein Vier-Augen-Prinzip bereits vorgesehen ist, wie beispielsweise Positionstransfers mit Geldbetrag, Ausübung („Exercise“) oder Ausübungsverzicht („Abandon“), kann der Freigeber dedizierte GUI-Fenster nutzen, um noch freizugebende Requests unabhängig vom Eingeber zu bearbeiten.

Dokumentation

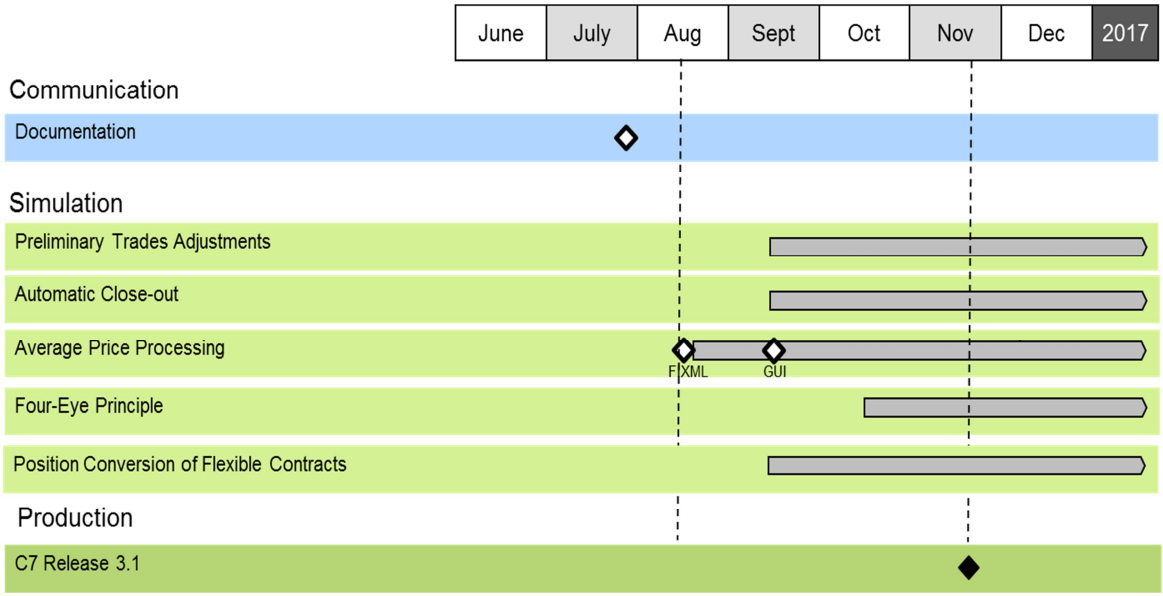
Eurex Clearing wird die folgenden Dokumente veröffentlichen, die weitere Details zu C7 Release 3.1 enthalten:

- C7 Release 3.1 Release Notes
- C7 Release 3.1 Member Access, User Maintenance and Entitlement Guide
- Derivatives Clearing Functional References
- C7 Release 3.1 Derivatives Clearing GUI - User Manual
- C7 – Eurex Clearing FIXML Interface Specification - Volume 1: Overview
- Eurex Clearing Messaging Interfaces - Connectivity Volumes A, B, C, D, E + Code Samples
- C7 – Eurex Clearing FIXML Interface Specification - Volume 3: Transaction & Position Confirmation
- C7 – Eurex Clearing FIXML Interface Specification - Volume 4: Transaction & Position Maintenance
- C7 – Eurex Clearing FIXML Interface Specification - Volume 5: Public Broadcasts
- C7 – Eurex Clearing FIXML Interface Specification - Volume 6: Message Samples (Production)
- FIXML Schema
- Eurex XML Report Reference Manual
- Eurex XML Reports Reference Manual – Modification Notes
- C7 Release 3.1 Simulation Guide

Die Dokumente werden zum Veröffentlichungszeitpunkt in der Member Section der Eurex Clearing Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Pfad zum Herunterladen zur Verfügung stehen:

Eurex Clearing Member Section > Technologie

Zeitplan für C7 Release 3.1



Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen zu den oben beschriebenen Themen benötigen, kontaktieren Sie bitte Ihren Key Account Manager oder memberservices@eurexclearing.com.

4. Juli 2016