clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 101/16

Datum: 1. August 2016
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

Eurex Clearing's C7 Release 3.1: Simulationskalender und Dokumente

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 060/15
Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 061/16, 088/16
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 Glattstellungsfunktion („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")
- Änderungen am AMQP-Broker

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. Das vorliegende Rundschreiben enthält den Simulationskalender sowie die Daten der Veröffentlichung der Release-Dokumente.

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

Eurex Clearing's C7 Release 3.1: Simulationskalender und Dokumente

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 Glattstellungsfunktion („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")
- Änderungen am AMQP-Broker

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. Details hierzu sind Eurex-Rundschreiben 061/16 zu entnehmen.

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 Glattstellungsfunktion („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 ein Flexibler Kontrakt an Eurex Exchange zum Handel zugelassen wird, wird die resultierende Position automatisch in eine an Eurex Clearing zugelassene Position konvertiert.

Wenn der Fälligkeitstag eines Flexiblen Kontrakts auf einen Feiertag bei Eurex Exchange 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.

Bitte beachten Sie: 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 Positionstransfers mit Geldbetrag, Ausübung („Exercise“) oder Ausübungsverzicht („Abandon“), kann der Freigeber dedizierte GUI-Fenster nutzen, um noch freizugebende Requests unabhängig vom Eingeber zu bearbeiten.

Änderungen am AMQP-Broker

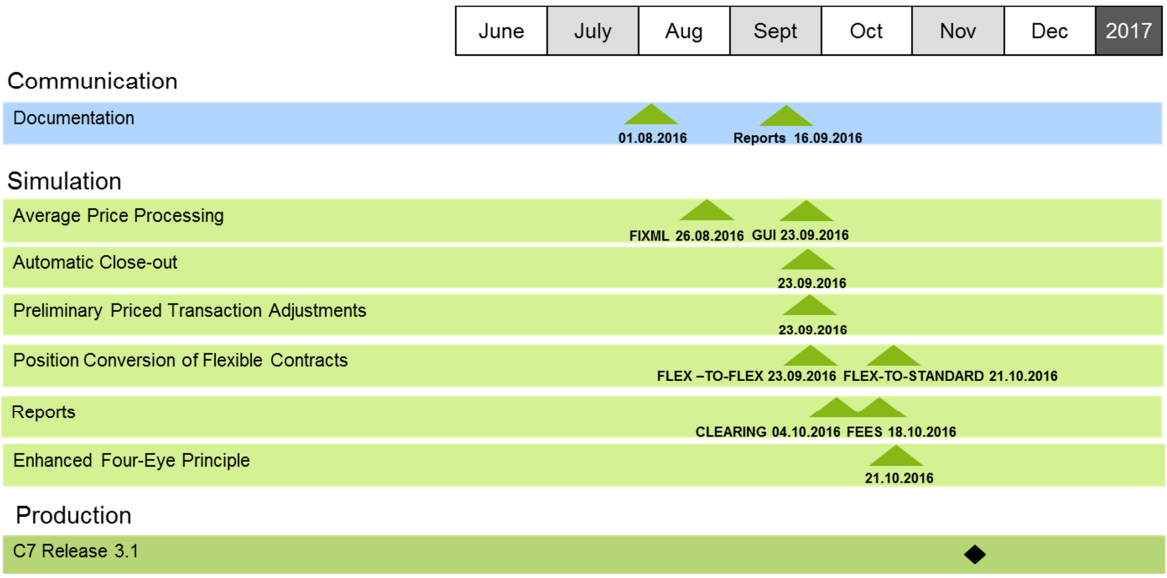
Broadcast-Nachrichten, die über die Eurex Clearing FIXML-Schnittstelle gesendet werden, werden während der täglichen Tagesendverarbeitung vom AMQP-Broker nicht gelöscht. Stattdessen verbleiben sie auf dem Broker jeweils 24 Stunden bis zu ihrem Verfall. Der AMQP-Broker wird während der Tagesendverarbeitung nicht mehr heruntergefahren. Stattdessen ist er während des gesamten Geschäftstages erreichbar. Weitere Details können der Dokumentation „Eurex Clearing Messaging Interfaces“ entnommen werden.

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, E
- 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

Veröffentlichung von Dokumenten und Simulationskalender



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

Technology > Eurex Clearing´s C7 > System documentation > Release 3.1

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

1. August 2016