clear to trade

e u r e x c l e a r i n g
rundschreiben 115/13

Datum: 11. Oktober 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 3.0: Aktualisierte Dokumentation

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 107/13

Kontakt: Member Services & Admission, T +49-69-211-1 17 00, memberservices@eurexclearing.com;
EurexOTC 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 3.0 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.

Der Start der Release-Simulation ist für den **15. Oktober 2013** geplant. Weiterführende Informationen zur Simulation können dem aktualisierten „Simulation Guide“ entnommen werden, der im Zusammenhang mit diesem Rundschreiben veröffentlicht wurde.

Die Einführung von Release 3.0 in Produktion ist für den **18. November 2013** geplant.

Die Dokumente wurden in der Member Section der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

Member Section > Clearing Ressourcen > Releases > EurexOTC Clear > IRS Release 3.0

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 3.0: Aktualisierte Dokumentation

Im Zusammenhang mit der Einführung von EurexOTC Clear Release 3.0 hat Eurex Clearing verschiedene funktionale und technische Dokumente für die Vorbereitung auf die Simulation und den Produktionsstart aktualisiert. Die aktualisierten Dokumente sind in diesem Rundschreiben aufgeführt.

Wie mit Eurex Clearing-Rundschreiben 107/13 mitgeteilt, wird Eurex Clearing ihren EurexOTC Clear Service für Interest Rate Swaps (IRS) um die folgenden Hauptfunktionalitäten und Services erweitern, die ab dem 15. Oktober 2013 in der Simulation und ab dem 18. November 2013 in der Produktion verfügbar sind:

Funktionale Erweiterungen:

- Anbindung an den EurexOTC Clear Margin Calculator über die FpML-Schnittstelle (Margin Calculator API)
- Neuer täglicher OTC CCP Fee Statement Report (CB185) für OTC IRS-Entgeltkomponenten
- GBP Forward Rate Agreement (FRA) Intraday settlement - Wechsel der Abwicklung von „am nächsten Tag“ zu „untertägig“

Produkterweiterungen:

- Erweiterung des EurexOTC Clear-Produktumfangs um IRS und FRA in der Währung Japanische Yen (JPY); die Aktivierung in der Simulation ist für den 21. Oktober 2013 geplant
- Änderung des Datenquelle für den „Payment/Reset“-Kalender von öffentlich verfügbaren Informationen zum Datenlieferant Swaps Monitor

Erweiterungen im Sicherheiten-Management:

- Direkte Übertragung von Sicherheiten - dies ermöglicht dem NCM/RC, Sicherheiten direkt auf das eigene segregierte Konto zu übertragen
- Verspätete TARGET2-Einzahlungen - Buchungsschnitt für Einzahlungen in Euro wird auf späteren Zeitpunkt verschoben/angeglichen

Erweiterung des Risikomodells:

- Anpassungen im Risikomodell zur Unterstützung von Produkten in der Währung JPY, und Änderungen im Risikomodell zur Vorbereitung des Cross-Margining mit Zinsderivaten

Zusätzlich zu den oben genannten neuen Services und Funktionen werden die Reports und FpML-Nachrichten durch die folgenden funktionalen und technischen Erweiterungen angepasst. Diese Änderungen treten in der Simulation am 12. November 2013 und in Produktion am 2. Dezember 2013 in Kraft.

- Neue Reports: Intraday Settlement Report (CI280) und Intraday Fixing Report (CI281)
- Die Report-IDs der Liquidity Table (neu: CC220) und des Parameter File (neu: CC221) werden geändert und eine untertägige Version dieser Reports (Intraday Liquidity Table (CI220), Parameter File (CI221)) wird zur Verfügung stehen; diese Reports werden durch das hinzufügen neuer Felder erweitert
- Der OTC Fonds Manager Collateral und Margin Report (CI209/CC209), erstellt für Kunden mit flexibler Kontenstruktur, wird um eine neue Zeile erweitert, die Informationen über den aktuellen Liquidation Margin-Betrag für die verzögerte Abwicklung von IRS-Geschäften in der Währung JPY enthält
- Erweiterung des Eurex Clearing FpML-Nachrichtenformats, um regulatorische Meldungen zu unterstützen.

Beispiele für die oben aufgeführten neuen und geänderten Reports werden Ende Oktober 2013 veröffentlicht. Der Kommunikationsplan wurde entsprechend aktualisiert. Alle anderen Reports bleiben unverändert; deshalb sind keine neuen Beispielreports vorgesehen.

Detaillierte Informationen zu den oben genannten Funktionen und Services finden Sie in den EurexOTC Clear Functional Release Notes.

Die folgenden Dokumente wurden im Zusammenhang mit den oben genannten neuen Funktionen und Services aktualisiert:

- EurexOTC Clear IRS Supported Product List
- EurexOTC Clear Functional Release Notes
- EurexOTC Clear Simulation Guide - Updated Version
- FpML API XSD and Samples (Current Version) for Simulation - Updated Version
- EurexOTC Clear Report Manual Interest Rate Swaps (IRS) - Updated Version
- Eurex Clearing FpML Interface Specifications - Updated Version
- Sample EurexOTC Clear IRS Reports - OTC CCP Fee statement report
- EurexOTC Clear GUI User Guide - Updated Version
- EurexOTC Clear Margin Calculator User Guide - Updated Version
- EurexOTC Clear Margin Calculator Product Template Field Description
- EurexOTC Clear Margin Calculator Trade/Portfolio Templates

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

Member Section > Clearing Ressourcen > Releases > EurexOTC Clear > IRS Release 3.0

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

11. Oktober 2013