clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 075/16

Datum: 3. Juni 2016
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

Reportänderungen im Zusammenhang mit der Einführung des neuen Kundenzugangsmodells ISA-Direkt

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 042/16

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

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ Alle Abteilungen	keine

Zusammenfassung:

Wie am 30. März 2016 angekündigt, wird Eurex Clearing ein neues Kundenzugangsmodell ISA-Direkt einführen, in dem Kunden direkte Kontrahenten von verrechneten Transaktionen werden und die derzeitigen Clearing-Mitglieder als „Clearing-Agenten“ für die neuen ISA-Direkt-Mitglieder (rechtliche Bezeichnung: Basis-Clearing-Mitglieder) fungieren.

Um eine klare Identifikation von ISA-Direkt-Mitgliedern und die Abgrenzung von regulären Registrierten Kunden und Nicht-Clearing-Mitgliedern sicherzustellen, werden die Eurex-Reports CI042 Margin Call und CD230 Monthly Interest Report in der Produktion mit Wirkung zum **20. Juni 2016** angepasst. Des Weiteren wird Eurex-Report CD090 Overall Asset Summary angepasst und zwei neue Eurex-Reports, CD091 ISA Direct Member Asset Summary und CD092 Asset Summary Aggregation, mit Wirkung zum **18. Juli 2016** eingeführt.

Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing und Vendoren werden gebeten, mögliche Auswirkungen auf ihre Systeme aufgrund der Änderungen zu berücksichtigen. Das aktualisierte „Eurex XML Report Reference Manual“ und die Schema-Dateien werden – vor Verfügbarkeit der Änderungen in der Simulationsumgebung – am 3. Juni 2016 bzw. am 1. Juli 2016 zum Herunterladen auf der Website der Eurex Clearing www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link zur Verfügung stehen:

Technology > Eurex Clearing classic system > System documentation

Bei Fragen mit technischem Hintergrund oder wenn Sie weitere Informationen mit technischem Bezug benötigen, steht Ihnen Ihr Technischer Key Account Manager über Ihre VIP-Nummer oder per E-Mail cts@deutsche-boerse.com gerne zur Verfügung.

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:
Heike Eckert (stv. Vorsitzende),
Matthias Graulich,
Thomas Laux,
Manfred Matusza,
Erik Tim Müller

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
USt-IdNr. DE194821553
Amtsgericht Frankfurt/Main

Reportänderungen im Zusammenhang mit der Einführung des neuen Kundenzugangsmodells ISA-Direkt

Wie am 30. März 2016 angekündigt, wird Eurex Clearing ein neues Kundenzugangsmodell ISA-Direkt einführen, in dem Kunden direkte Kontrahenten von verrechneten Transaktionen werden und die derzeitigen Clearing-Mitglieder als „Clearing-Agenten" für die neuen ISA-Direkt-Mitglieder (rechtliche Bezeichnung: Basis-Clearing-Mitglieder) fungieren.

Um eine klare Identifikation von ISA-Direkt-Mitgliedern und die Abgrenzung von regulären Registrierten Kunden und Nicht-Clearing-Mitgliedern sicherzustellen, werden die folgenden Änderungen in Eurex-Reports eingeführt:

Erweiterung des Empfängerkreises für Report CI042 und Änderungen im Report CD230

- **Intraday report CI042 Margin Call**
  Dieser Report steht derzeit nur den Clearing-Mitgliedern zur Verfügung. Der Report wird auch den vollständig segregierten Nicht-Clearing-Mitgliedern und Registrierten Kunden (ISA-Kunden) aller Märkte verfügbar gemacht.

- **CD230 Monthly Interest Report**
  Dieser Report ist für Clearing-Mitglieder (CMs), Nicht-Clearing-Mitglieder (NCMs) und Registrierte Kunden (RKs) verfügbar. Die NCM/RK-Version für ISA-Direkt-Mitglieder und vollständig segregierte NCMs/RKs wird Zinsen auf hinterlegte Geldsicherheiten getrennt ausweisen. Für andere NCMs/RKs (die nicht am ISA-Direkt-Modell teilnehmen, die nicht vollständig segregiert sind) wird dieser Report immer leer sein. Das Etikett „Clearing Member" wird durch „Member ID" ersetzt.

Die Änderungen in den oben genannten Reports werden in der Simulationsumgebung der Eurex Clearing ab dem Geschäftstag 3. Juni 2016 (Beginn Geschäftstag) wirksam. Die Einführung in der Produktionsumgebung ist mit den Reports für den Geschäftstag 20. Juni 2016 (Beginn Geschäftstag) geplant.

Neue Struktur für das Reporting zum Clearing-Fonds und zum Unternehmenskapital

Aufgrund der Einführung des ISA-Direkt-Modells wird das Reporting zum Clearing-Fonds und zum Unternehmenskapital neu strukturiert:

- **Bestehender Report CD090 Overall Asset Summary**
  Report CD090 wird weiterhin Anforderungen und Beiträge für Clearing-Mitglieder in ihrer „traditionellen" Clearing-Mitglied-Rolle ausweisen. Da Clearing-Agenten Beiträge zum Default-Fonds im Namen von ISA-Direkt-Mitgliedern leisten, wird die zusätzliche Anforderung an Clearing-Fonds-Beiträge in der Rolle als Clearing-Agent bei der Erstellung von Report CD090 für Clearing-Mitglieder nicht berücksichtigt. Das Reporting zum Unternehmenskapital wird anders umgesetzt: Report CD090 wird die gesamte Anforderung an das Unternehmenskapital resultierend aus beiden Rollen, d. h. der Rolle des Clearing-Mitglieds und der des Clearing-Agenten, ausweisen, da die Geschäfte der zugehörigen ISA-Direkt-Mitglieder in die Berechnung einfließen. Das heißt, dass sich die zugrunde liegende Berechnungsmethode für Report CD090 ändern wird, jedoch nicht das Layout.

- **Neuer Report CD091 Direct Member Asset Summary**
  Report CD091 wird die Anforderungen für Beiträge zum Clearing-Fonds und an das Unternehmenskapital für ISA-Direkt-Mitglieder auf Basis ihrer Margin-Anforderung und ihren aktuell hinterlegten Beiträgen ausweisen.

- **Neuer Report CD092 Asset Summary Aggregation**
  Es ist davon auszugehen, dass Clearing-Mitglieder sowohl für Geschäfte von ISA-Direkt-Mitgliedern als auch für Geschäfte außerhalb von ISA-Direkt agieren werden. Daher bietet dieser neue Report CD092 einen aggregierten Überblick der Anforderungen und der Deckungen resultierend aus beiden Rollen.

Die angepassten und die neuen Reports stehen in der Simulationsumgebung von Eurex Clearing ab dem Geschäftstag 1. Juli 2016 (Beginn Geschäftstag) zur Verfügung. Die Einführung in Produktion ist mit den Reports für Geschäftstag 18. Juli 2016 geplant.

Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing und Vendoren werden gebeten, mögliche Auswirkungen auf ihre Systeme aufgrund der Änderungen zu berücksichtigen. Zur Vorbereitung auf die genannten Änderungen aktualisieren Sie bitte Ihre Systeme für die Reportverarbeitung mit den aktualisierten und neuen Report-XSDs.

Das aktualisierte „Eurex XML Report Reference Manual“ und die aktualisierten Schema-Dateien werden einen vollständigen Überblick über alle Reportänderungen und neuen Reports enthalten. Das „Eurex XML Report Reference Manual – Modification Notes“ wird einen Überblick über die Erweiterungen und Änderungen der Eurex XML Reports im Vergleich zur vorherigen Version enthalten. Die Dokumente werden – vor Verfügbarkeit der Änderungen in der Simulationsumgebung – am 3. Juni 2016 bzw. am 1. Juli 2016 zum Herunterladen auf der Website der Eurex Clearing www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link zur Verfügung stehen:

Technology > Eurex Clearing classic system > System documentation

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte Group Client Services & Administration, Telefon +49-69-211-1 17 00 oder E-Mail: memberservices@eurexclearing.com.

Bei Fragen mit technischem Hintergrund oder wenn Sie weitere Informationen mit technischem Bezug benötigen, steht Ihnen Ihr Technischer Key Account Manager über Ihre VIP-Nummer oder per E-Mail cts@deutsche-boerse.com gerne zur Verfügung.

3. Juni 2016