clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 048/12

Datum: 15. Juni 2012
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

Einführung von US-Dollar als „Eurex Currency“ für das Risikomanagement

Kontakt: Maximilian Dannheimer, Clearing Business Development, Tel. +49-69-211-1 27 80,
E-Mail: maximilian.dannheimer@eurexclearing.com

Zielgruppe:	**Anhang:**
Ü Middle + Backoffice	keiner

Zum **20. Juni 2012** wird Eurex Clearing US-Dollar (USD) als „Eurex Currency“ in das Eurex®-Kernsystem einführen. Damit wird die automatisierte Kalkulation entsprechender Fremdwährungskurse, insbesondere für GC Pooling®-Transaktionen in USD, ermöglicht. Der Begriff „Eurex Currency“ weist dabei auf den ausschließlich operationalen und technischen Charakter dieser Währung hin, durch die ein erweiterter Risikomanagement-Prozess möglich wird.

Bitte beachten Sie, dass USD nicht zur „Clearing Currency“ aufgrund der Einführung als „Eurex Currency“ wird. Die einzigen „Clearing Currencies“ bleiben wie bisher Euro (EUR) und Schweizer Franken (CHF).

Ab dem 20. Juni 2012 wird die zusätzliche „Eurex Currency" USD in den Clearing-Systemen angezeigt und in den „Exchange Rate Overview“ des Risk-GUI „@x-tract“ integriert. Zum gleichen Datum werden auch abgeleitete USD Cross Currency Haircuts auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Pfad angezeigt:

Risk Management > Risk Parameters > Haircut und Bereinigter Wechselkurs

Clearing-Mitglieder und Vendoren, die die Currency Haircut-Datei (FPHCPA) automatisiert von der Eurex Clearing-Website importieren, müssen den erweiterten Inhalt (für die „Eurex Currency“ USD) der Datei ab dem 20. Juni 2012 berücksichtigen. Das Layout/die Struktur der Datei werden sich aufgrund der neuen „Eurex Currency“ nicht ändern.

Bitte beachten Sie auch, dass in Zukunft möglicherweise weitere „Eurex Currencies“ eingeführt werden. Sofern diese „Eurex Currencies“ nicht offiziell zur „Clearing Currency“ erklärt werden, bleiben sie ausschließlich „Eurex Currencies“.