clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 130/17

Datum: 13. Dezember 2017
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Matthias Graulich

Entgelt-Report „CB169 MM Fee Refund": Beschreibung der Erweiterungen für den Stressereignis-Baustein

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 099/17

Kontakt: Client Maintenance Trading & Clearing, T +49-69-211-1 33 88, support.billing@deutsche-boerse.com

Zielgruppe:

- Middle + Backoffice
- IT/System Administration

Anhänge:

1. Ergänzung zum „Eurex XML Report Reference Manual", Dezember 2017 (nur in Englisch)
2. Schemadateien

Mit Eurex Clearing-Rundschreiben 099/17 hat Eurex Clearing die Einführung von Rabatten für den Stressereignis-Baustein im Rahmen des „Eurex Liquidity Provider Frameworks" angekündigt. Die Einführung von Rabatten für den Stressereignis-Baustein führt zu Erweiterungen im monatlichen Entgelt-Report CB169 MM Fee Refund, welche ab **Januar 2018** in der Produktion wirksam werden.

Der Entgelt-Report CB169 wird um neue Felder erweitert, so dass Rabatte für die Liquiditätsbereitstellung für den Stressereignis-Baustein separat ausgewiesen werden. Eine detaillierte Dokumentation der Erweiterungen im Report CB169 sowie die notwendigen Schemadateien sind diesem Rundschreiben angehängt und werden im „Eurex XML Report Reference Manual" im Februar 2018 veröffentlicht (Simulation).

Beispiel-Reports mit fiktiven Werten aus der Simulationsumgebung werden am 15. Dezember 2017 zum Herunterladen in der „Common Report Engine" zur Verfügung gestellt.

eurex clearing

Eurex Clearing AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

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

1 XML Report Descriptions

1.1 CB169 MM Fee Refund

Description This monthly report provides information about the Market Maker Refund. The report is available for EUREX/ECAG Members.

Frequency Monthly.

Availability This report is available for clearing and trading members.

XML Report Structure	M/O	Text Report Heading
cb169		
rptHdr		
exchNam	m	
envText	m	
rptCod	m	
rptNam	m	
rptFlexKey	o	
membId	o	
membLglNam	o	
rptPrntEffDat	m	
rptPrntEffTim	o	
rptPrntRunDat	m	
cb169Grp, repeated 0 ... variable times:		
cb169KeyGrp		
membClgIdCod	o	ClMbr
cb169Grp1, repeated 1 ... variable times:		
cb169KeyGrp1		
membExchIdCod	o	ExMbr
cb169Grp2, repeated 1 ... variable times:		
cb169KeyGrp2		
exchIdCod	o	Exch
cb169Grp3, repeated 1 ... variable times:		
cb169KeyGrp3		
currTypCod	o	Curr
cb169Grp4, repeated 1 ... variable times:		
cb169KeyGrp4		
prodId	o	Prod
fulfillId	o	Fulfillment
strFulfillId	o	SfF
bscReqId	o	BaR
pckReqId	o	PaR
sprdQuaId	o	SpQ
szQuaId	o	SzQ
rfqRspId	o	RFQ
strePresId	o	StP
liqClsId	o	LiC
cb169Grp5, repeated 1 ... variable times:		
cb169KeyGrp5		
sortFeeTyp	o	(XML only)
cb169Grp6, repeated 1 ... variable times:		

cb169KeyGrp6		
acctTypGrpX	o	AC
cb169Grp7, repeated 1 ... variable times:		
cb169KeyGrp7		
acctTyp36Grp	o	Account Name
cb169Rec, repeated 1 ... variable times:		
feeIndTyp	o	Fee Type
trdQty	o	Volume
rebQty	o	Reb rel Vol
feeCapAmnt	o	Refund Amount
feeRolMmAmnt	o	(XML only)
feeStrMmAmnt	o	(XML only)
feePckMmAmnt	o	(XML only)
feeSprdMmAmnt	o	(XML only)
feeSzMmAmnt	o	(XML only)
feeRfqMmAmnt	o	(XML only)
feeStrsMmAmnt	o	(XML only)
fullRebVol	o	Rebated Vol
sumFeeIndTypTrdQty	o	Total per Fee Type
sumFeeIndTypRebQty	o	
sumFeeIndTypFeeCapAmnt	o	
sumFeeIndTypFeeRolMmAmnt	o	(XML only)
sumFeeIndTypFeeStrMmAmnt	o	(XML only)
sumFeeIndTypFeePckMmAmnt	o	(XML only)
sumFeeIndTypFeeSprdMmAmnt	o	(XML only)
sumFeeIndTypFeeSzMmAmnt	o	(XML only)
sumFeeIndTypFeeRfqMmAmnt	o	(XML only)
sumFeeIndTypFeeStrsMmAmnt	o	(XML only)
sumFeeIndTypFullRebVol	o	
sumProdTrdQty	o	Total per Product
sumProdRebQty	o	
sumProdFeeCapAmnt	o	
sumProdFeeRolMmAmnt	o	(XML only)
sumProdFeeStrMmAmnt	o	(XML only)
sumProdFeePckMmAmnt	o	(XML only)
sumProdFeeSprdMmAmnt	o	(XML only)
sumProdFeeSzMmAmnt	o	(XML only)
sumProdFeeRfqMmAmnt	o	(XML only)
sumProdFeeStrsMmAmnt	o	(XML only)
sumProdFullRebVol	o	
sumCurrTrdQty	o	Total per Currency
sumCurrRebQty	o	
sumCurrFeeCapAmnt	o	
sumCurrFeeRolMmAmnt	o	(XML only)
sumCurrFeeStrMmAmnt	o	(XML only)
sumCurrFeePckMmAmnt	o	(XML only)
sumCurrFeeSprdMmAmnt	o	(XML only)
sumCurrFeeSzMmAmnt	o	(XML only)
sumCurrFeeRfqMmAmnt	o	(XML only)
sumCurrFeeStrsMmAmnt	o	(XML only)
sumCurrFullRebVol	o	
sumExchFeeGrp, repeated 0 ... 1 times:		
sumExchFeeRec, repeated 0 ... variable times:		
exchNam	o	

currTypCod o
sumExchFeeAmnt o
sumMembFeeGrp, repeated 0 ... 1 times:
sumMembFeeRec, repeated 0 ... variable times:
exchNam o
currTypCod o
sumMembFeeAmnt o

Text Report Structure

```
ClMbr ExMbr Exch Curr Prod Fulfillment SfF BaR PaR SpQ SzQ RFQ StP LiC Ac Account Name
----- ----- ---- ---- ---- ----------- --- --- --- --- --- --- --- --- -- ------------------------------------
XXXXX XXXXX XXXX  XXX XXXX XXXXXX        X   X   X   X   X   X   X   X XX XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX


Fee Type                       Volume      Reb rel Vol Rebated Vol Refund Amount
------------------------------ ----------- ----------- ----------- -------------
XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX   999999999   999999999   999999999  999999999.99
                               ----------- ----------- ----------- -------------
Total per Fee Type:              999999999   999999999   999999999  999999999.99


Total per Product:               999999999   999999999   999999999  999999999.99

Total per Currency:              999999999   999999999   999999999  999999999.99
```

2 XML Report Tag Descriptions

2.1 feeStrsMmAmnt

Description This field contains the monthly rebate per product regarding Stress Presence.

Format numeric 11, 2

Where used: CB169 MM Fee Refund

2.2 strePresId

Description This flag shows if Stress Presence was fulfilled (Y/N), Futures (X).

Format alphanumeric 1

Valid Values	Decodes	Descriptions
Y	-	Yes
N	-	No
X	-	Not applicable

Where used: CB169 MM Fee Refund

2.3 sumCurrFeeStrsMmAmnt

Description This field contains the sum of Stress Market Making rebate per currency.

Format numeric 11, 2

Where used: CB169 MM Fee Refund

2.4 sumFeeIndTypFeeStrsMmAmnt

Description This field contains the sum of Stress Market Making rebate per fee type.

Format numeric 11, 2

Where used: CB169 MM Fee Refund

2.5 sumProdFeeStrsMmAmnt

Description This field contains the sum of Stress Market Making rebate per product.

Format numeric 11, 2

Where used: CB169 MM Fee Refund