X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 186/09*

Datum: Frankfurt, 2. Oktober 2009
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Thomas Lenz

Eurex Release 12.0 Simulation: Zusätzliche Informationen

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 048/09, 160/09

Kontakt: Member Services & Admission, Tel. +49-69-211-1 17 00,
e-mail: customer.support@eurexchange.com,
Eurex Customer Technical Support, Tel. +49-69-211-1 12 00

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

Zusammenfassung:

Dieses Rundschreiben enthält zusätzliche Informationen zur Eurex Release 12.0 Simulation:

- **OTC-Volatilitätsstrategien mit Aktien als Basiswert**

- Informationen für Teilnehmer zu § 9 WpHG
- Give-up / Take-up-Funktionalität für OTC-Aktienvolatilitätsstrategiegeschäfte
- Online-Informationen über OTC-Volatilitätsstrategiegeschäfte für Clearing-Mitglieder

- **Erweiterung der Margin-Gruppe Parameter-Datei „FPPARM"**

Das neue Feld „CURR-TYP-COD-RMPARM", welches die Währung der Margin-Klasse enthält, wird der FPPARM-Datei hinzugefügt.

- **Aktualisierung der Dokumentation**

- Eurex Member Interface Specifications – File Interface Layouts
- Die Dokumente „Eurex @X-ceed Trading User Guide" und „Eurex XML Report Reference Manual" sind auf der Eurex-Website verfügbar.

- **Aktualisierung des Eurex 12.0 Simulationskalenders**

- Verschiebung des Matcher Crash / Host-Ausfalltests und eines Market Reallocation-Ereignises (Fokustag) in der Eurex Release 12.0 Simulation.

Der Eurex 12.0 Simulationskalender steht in aktualisierter Form auf der Eurex-Website zum Herunterladen bereit:

www.eurexchange.com > Member Section > Eurex 12.0 Simulation > Standard Simulation

eurex

Eurex Deutschland
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
customer.support@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Thomas Book, Thomas Lenz,
Michael Peters, Andreas Preuß,
Peter Reitz, Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

Eurex Release 12.0 Simulation: Zusätzliche Informationen

Dieses Eurex-Rundschreiben enthält zusätzliche Informationen zur Eurex Release 12.0 Simulation zu den folgenden Eurex Release 12.0-Funktionen:

- **OTC Volatilitätsstrategien mit Aktien als Basiswert**

  - Informationen für Teilnehmer zu § 9 WpHG:
    Da Eurex als Gegenpartei an allen OTC-Geschäften beteiligt ist, berichtet Eurex gemäß Par. 9 WpHG das aus dem OTC-Volatilitätsstrategiegeschäft von Aktienoptionen resultierende Aktienbasisgeschäft an die BaFin. Der Bericht enthält als Börsenkürzel den Wert „XOFF". Eurex empfiehlt den Teilnehmern, in ihrem eigenen Reporting bezüglich des Aktienbasisgeschäfts an die BaFIN ebenfalls das Börsenkürzel „XOFF" zu verwenden. Bitte beachten Sie, dass das Reporting für die aus OTC-Volatilitätsstrategien von Aktienoptionen resultierenden Derivate-Geschäfte in gewohnter Weise unabhängig von dem Aktienbasisgeschäft an die BaFin erfolgt.

  - Give-up / Take-up-Funktionalität für OTC-Volatilitätsstrategiegeschäfte von Aktienoptionen:
    Die Give-up / Take-up-Funktionalität wird für Derivate-Geschäft angewendet, jedoch nicht für das Aktien-Basisgeschäft eines OTC-Volatilitätsstrategiegeschäfts. Wenn für ein OTC-Volatilitäts-strategiegeschäft von Aktienoptionen die Give-up / Take-Up-Funktionalität genutzt wird, wird das daraus entstehende Aktienbasisgeschäft mit den ursprünglichen Gegenparteien und mit Konto A1 zur Belieferung an den CCP übertragen.

  - Online-Information über OTC-Volatilitätsstrategiegeschäfte für Clearing-Mitglieder:
    Der Strategy Matching Event Broadcast-Strom enthält alle Informationen zu einem aus einem OTC-Volatilitätsstrategiegeschäft resultierenden Basisgeschäfts einschließlich Preis und Quantität des Aktienbasisgeschäfts (Details hierzu sind dem Dokument VALUES API Member Front End Development Guide, § 5.27.3 zu entnehmen). Über diesen Broadcast-Strom können auch Clearing-Mitglieder Informationen zu OTC-Volatilitätsstrategiegeschäften beziehen, welche von ihren Non-Clearing-Mitgliedern ausgeführt wurden.
    Zusätzlich zum Strategy Matching Event Broadcast-Strom erhalten Clearing-Mitglieder die Geschäftsbestätigungen (trade confirmations) der von ihren Non-Clearing-Mitgliedern durchgeführten Derivate-Geschäfte von OTC-Volatilitätsstrategiegeschäften. Bitte beachten Sie, dass es für das Aktienbasisgeschäft keine Geschäftsbestätigung gibt, das Feld der Ordernummer der Geschäftsbestätigung eines Derivate-Geschäfts jedoch die ID der Aktienlieferinstruktion des Aktienbasisgeschäfts auf der CCP-Seite enthält.

- **Erweiterung der Datei „FPPARM" für Margin-Gruppenparameter**

Im Zusammenhang mit der Einführung der untergeordneten Währungseinheit Great Britain Pence (GBX) mit Eurex Release 12.0 müssen Teilnehmer in ihren Systemen eine Reihe von Änderungen vornehmen, um die „kleinen" und „großen" Währungseinheiten verarbeiten zu können. Zur Umsetzung der Änderungen werden die Parameter der Margin-Gruppendatei „FPPARM" um die Währungen der Margin-Klasse erweitert:

Derzeitiges Format:

- STXT 050VOD 000003500000350.25VODFVODF011.500PSOA

Beispiel-Format mit Eurex Release 12.0:

- STXT 050VOD 000003500000350.25VODFVODF011.500P**GBX**

- **Aktualisierung der Dokumentation**

Die folgenden Dokumente stehen in aktualisierter Form auf der Eurex-Website **www.eurexchange.com** zum Herunterladen bereit:

- Eurex Member Interface Specifications – File Interface Layouts
  Die angekündigte Erweiterung der Datei für Margin-Gruppenparameter „FPPARM" wurde vorgenommen.
- Eurex @X-ceed Trading User Guide
  Zur Unterstützung des Imports von OTC Block Trades in Optionsstrategien wurde das **OTC Block Trade Bulk Load**-Fenster erweitert. Das aktualisierte CSV-Datei-Template steht ebenfalls zur Verfügung.
- Eurex XML Report Reference Manual
  Das Handbuch enthält jetzt auch Erweiterungen des Report „CE070 Exercise and Assign Summary". Weitere Informationen sind den Modification Notes zu entnehmen.

Die aktualisierten Dokumente ersetzen frühere veröffentlichte Versionen derselben.

- **Aktualisierung des Eurex 12.0 Simulationskalenders**

Die folgenden, im Eurex Release 12.0 Member Simulation Guide veröffentlichten Ereignisse wurden auf eine anderes Datum verschoben:

- Der Eurex 12.0 Matcher Crash / Host-Ausfalltests in der Eurex Simulation, der ursprünglich für Mittwoch, den 21. Oktober 2009 angesetzt war, wurde auf Mittwoch, den 4. November 2009 verschoben.
- Das Eurex 12.0 Simulation Market Reallocation-Ereignis (Fokustag), welches ursprünglich für Montag, den 26. Oktober 2009 geplant war, wurde auf Montag, den 2. November 2009 verschoben.

Der entsprechend aktualisierte Eurex 12.0-Simulationskalender steht auf der Eurex-Website unter dem folgenden Pfad zur Verfügung:

www.eurexchange.com > Member Section > Eurex 12.0 Simulation > Standard Simulation

Falls Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, kontaktieren Sie das Member Services & Admission Team unter Tel. +49-69-211-1 17 00 oder E-Mail: customer.support@eurexchange.com oder den Eurex Customer Technical Support unter Tel. +49-69-211-1 12 00.

Frankfurt, 2. Oktober, 2009