Eurex Clearing-Rundschreiben 010/18

Roadmap der Eurex Clearing für das Jahr 2018

Zusammenfassung

Mit diesem Rundschreiben stellt Eurex Clearing einen Überblick über die geplanten Release-Einführungen für das Jahr 2018 zur Verfügung. Dieser Überblick soll den Mitgliedern die Ressourcen- und Zeitplanung erleichtern. Bitte beachten Sie, dass konkrete Produkteinführungen und weitere Clearing-Initiativen in dieser Roadmap nicht berücksichtigt sind.

Eurex Clearing wird weitere Details wie die Termine der Simulationsstarts und den Kommunikationskalender für die einzelnen Release-Einführungen rechtzeitig gesondert veröffentlichen.

Wir bitten Sie zu prüfen, ob Sie für die Themen Eurex Clearing's C7, Eurex Clearing Prisma, EurexOTC Clear und Eurex Clearing's Wertpapier-CCP einen oder mehrere Release-Kontakte in der Member Section auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com hinterlegt bzw. aktualisiert haben. Informationen werden nur an die dort hinterlegten Release-Kontakte über Newsflashs versendet.

Der Pfad auf der Eurex Clearing-Website lautet:

Member Section > Kontakte > Release-Kontakte

Eurex Clearing wird in Workshops vor Ort einen umfassenden Überblick zur Roadmap 2018 geben. Informationen zu Terminen und Orten werden rechtzeitig bekanntgegeben.

Datum: 31. Januar 2018

Empfänger:
Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren

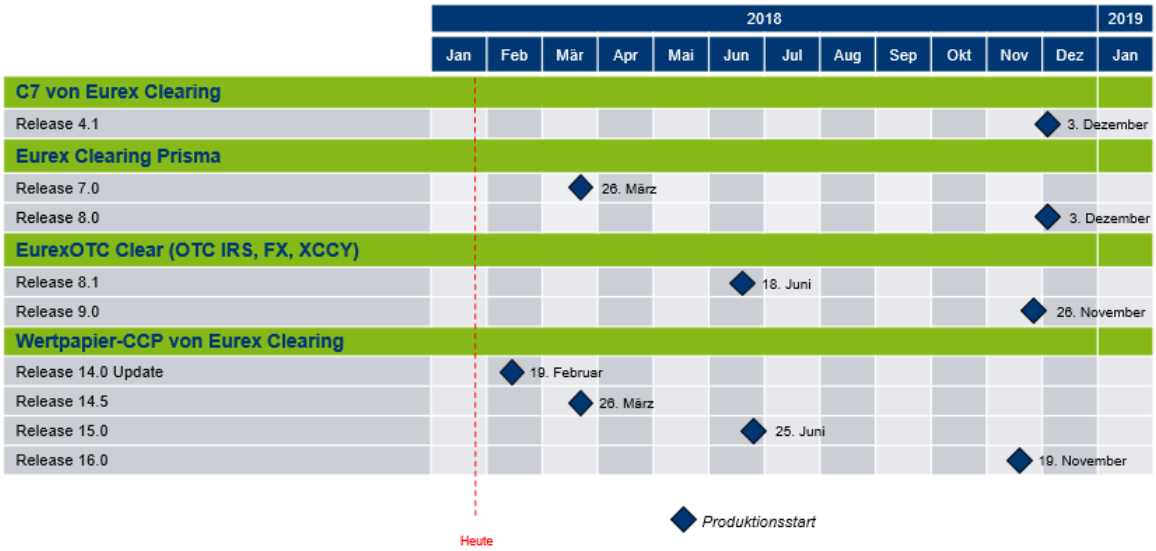
Autorisiert von:
Heike Eckert

Zielgruppe:
Alle Abteilungen

Kontakt:
Ihr Clearing Key Account Manager, clearing.services-admission@eurexclearing.com

Roadmap der Eurex Clearing für das Jahr 2018

Vorläufiger Zeitplan für 2018



Eurex Clearing's C7

Bei C7 Release 4.1 legt Eurex Clearing den Schwerpunkt auf die Optimierung der Tagesendverarbeitung. Des Weiteren reduziert Eurex Clearing die Komplexität der Infrastruktur durch die Überführung des Cash Payment-Service auf die C7-Architektur. Aufgrund dessen werden sich Änderungen in den Cash-Reports für die Kunden der Eurex Clearing ergeben.

Eurex Clearing Prisma

Mit Prisma Release 7.0 werden verschiedene interne Verbesserungen umgesetzt, die keine Auswirkungen auf Kunden haben. Außerdem werden weitere untertägige Risk-based Margining (RBM) Theo-Files von der Website und aus der Common Report Engine entfernt.

Im Mittelpunkt von Prisma Release 8.0 wird die Einführung des „Time To Expiry Adjustment" (TEA) stehen. Diese Änderung in der Berechnung ermöglicht eine angemessene Berücksichtigung von Marktrisiken aus Positionen, die kurz vor dem Verfall stehen und cash-gesettled werden. Sollten diese Positionen einen risikoreduzierenden Beitrag in Bezug auf die Marktrisiken von nicht verfallende Produkten innerhalb des gesamten Portfolios aufweisen, werden derartige Risikoreduktionen mittels TEA transparent gemessen und entsprechend nicht mehr gewährt. Der Margin-Effekt der verfallenden Positionen erhöht sich stufenweise vor dem Verfall auf Basis des Risikohorizonts der Liquidationsgruppe.

EurexOTC Clear

Mit EurexOTC Clear Release 8.1 beabsichtigt Eurex Clearing, ihre Interdealer-Clearing-Services für außerbörsliche Währungsprodukte (vorbehaltlich der Zustimmung der Aufsichtsbehörden) einschließlich OTC-FX-Spot-, FX-Forward-, FX-Swap- und OTC Cross Currency-Swaps (XCCY-Swaps) zu erweitern. Dabei werden Kunden Clearing-Services für die gleichen Produkte und mit den gleichen Funktionen wie für Interdealer angeboten.

Mit EurexOTC Clear Release 9.0 plant Eurex Clearing die Einführung neuer Währungspaare und Services zur Kompression von Geschäften in außerbörslichen Währungsprodukten.

Weitere funktionale und technische Änderungen für alle OTC-Produkte werden im Rahmen von beiden Releases eingeführt.

Eurex Clearing's Wertpapier-CCP

Das Update zu CCP Release 14.0 ist verpflichtend für alle Clearing-Mitglieder. Eurex Clearing wird bei drei CCP-Reports die auf Ebene des Kontonamens in C7 verfügbaren Informationen erweitern.

Mit CCP Release 14.5 wird für Eurex Clearing's Wertpapierleihe-CCP eine Erweiterung des Verpfändungsvertrags mit dem Triparty Collateral Agent umgesetzt: das „Secured Pledge-Modell".

Im Umfang von CCP Release 15.0 sind die Ablösung der Shaping-Funktion für T2S-Lieferungen und zusätzliche Erweiterungen im Bereich Wertpapierleihe. Sollten Änderungen bei T2S vorgenommen werden, wird Eurex Clearing entsprechende Änderungen auf technischer Ebene mit CCP Release 16.0 umsetzen.

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte Ihren Clearing Key Account Manager unter der E-Mail: clearing.services-admission@eurexclearing.com.

31. Januar 2018