X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 050/11*

Datum: 8. März 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ **Hohe Priorität**

Eurex Release 13.1: Fokustage in Simulation & Dokumentation

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 026/11, 103/10, 225/10

Kontakt: Member Services & Admission, Tel. +49-69-211-1 17 00,
E-Mail: customer.support@eurexchange.com

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ Alle Abteilungen	Nur in englischer Sprache und nur auf der Eurex-Website: 1. XML Report Reference Manual 2. X8000 Enhanced Broadcast Solution Interface Specification 3. X4104 System Overview & Information Manual 4. X6100 @X-tract Clearing User Guide

Zusammenfassung:

Fokustage in der Simulationsumgebung

Eurex plant die Durchführung von „Fokustagen“ in der Simulation für Eurex Release 13.1. An den Fokustagen haben Marktteilnehmer die Möglichkeit, ihre Sicherheitsanforderungen aus Eurex Releases 13.0 und 13.1 zu vergleichen, in dem sie in der Simulationsumgebung ein Produktionsportfolio in bestimmten Produkten eingeben. Eurex stellt sicher, dass die relevanten Parameter zur Sicherheitenberechnung (wie Volatilitäten, Abwicklungspreise, Offsets etc.) denen des vorhergehenden Arbeitstages in der Produktionsumgebung angenähert sind. Der erste Fokustag ist für den **22. März 2011** geplant mit Produktionsdaten vom 21. März. Der zweite Fokustag ist für den **28. März 2011** geplant mit Produktionsdaten vom 25. März.

Publikation der finalen Dokumentation

Die finalen Versionen der im Rahmen von Eurex Release 13.1 aktualisierten Dokumente stehen ab sofort in der Member Section der Eurex-Website zum Herunterladen unter folgendem Pfad bereit:

www.eurexchange.com > Member Section > Releases > Eurex 13.1 > Manuals

Wie üblich werden die Dokumente ausschließlich in englischer Sprache bereitgestellt. Das Rundschreiben enthält eine Übersicht der Änderungen.

Eurex Deutschland
Börsenplatz 4
60313 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, Michael Peters,
Andreas Preuß, Peter Reitz,
Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

Eurex Release 13.1: Fokustage in Simulation & Publikation der finalen Dokumentation

1. Fokustage in der Simulationsumgebung

Eurex plant die Durchführung von „Fokustagen“ in der Simulation für Eurex Release 13.1. An den Fokustagen haben Marktteilnehmer die Möglichkeit, ihre Sicherheitsanforderungen aus Eurex Releases 13.0 und 13.1 zu vergleichen, in dem sie in der Simulationsumgebung ein Produktionsportfolio in bestimmten Produkten eingeben. Eurex stellt sicher, dass die relevanten Parameter zur Sicherheitenberechnung (wie Volatilitäten, Abwicklungspreise, Offsets etc.) denen des vorhergehenden Arbeitstages in der Produktionsumgebung angenähert sind.

Der erste Fokustag ist für den 22. März 2011 geplant, mit Produktionsdaten vom 21. März. Der zweite Fokustag ist für den 28. März geplant, mit Produktionsdaten vom 25. März.

Die folgenden Produkte werden zum Vergleich zur Verfügung stehen:

Produkt	**Margin-Klasse**
DBK	DBK
OESX	EUSX
FESX	EUSX

Um das neue Besicherungsmodell „Besicherung nach Kontrakt und Verfall“ testen zu können, ist das Produkt A1LV in Simulation mit folgenden verfallspezifischen Faktoren konfiguriert:

A1LV DEC 11	0,85
A1LV DEC 12	0,92
A1LV DEC 13	0,76
A1LV DEC 14	0,94
A1LV DEC 15	1,00

2. Publikation der finalen Dokumentation

Allgemeine Hinweise

Alle unten aufgeführten Dokumente stehen zum Herunterladen in der Member Section der Eurex Webseite unter dem folgenden Pfad zur Verfügung:

www.eurexchange.com > Member Section > Releases > Eurex 13.1 > Manuals

Für den direkten Zugang zu den Dokumenten klicken Sie bitte auf den folgenden Link:
https://www.eurexchange.com/members/releases /eurex131/

Wenn Sie Schwierigkeiten beim Einloggen in die Member Section haben, wenden Sie sich an das Service Point Team unter Tel. +49-69-211-1 78 88.

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an das Member Services & Admission Team unter Tel. +49-69-211-1 17 00.

XML Report Reference Manual

Seit Beginn der Simulation sind einige Änderungen an den Strukturen einzelner XML-Reports vorgenommen worden. Im Einzelnen wurden folgende Reports und Felder verändert:

- CB187 Monthly Rebates Overview
- CC100 Risk Values
- adjVol, feeAftSavReb, fullRebVol, mmVol, netGuTu, netTat, remUnRebVol, savOverl, tdpVol, vol

Diese Änderungen sind ebenfalls im Dokument X7700 XML Report Reference Manual, den XML Report Modification Notes, sowie den XSD Schema Files vermerkt worden.

X8000 Enhanced Broadcast Solution Interface Specification

Wie in Eurex-Rundschreiben 026/11 angekündigt, wurde die Enhanced Broadcast Solution-Schnittstellen-dokumentation aktualisiert um die Entfernung des Overlapping Modes korrekt darzustellen. Darüber hinaus wurden keine weiteren Änderungen am Dokument vorgenommen. Zudem sind keine weiteren Änderungen an den Applikationen der Markteilnehmer vonnöten.

X4104 System Overview and Information Manual, X6100 @X-tract Clearing User Guide

Die Dokumente X4104 System Overview & Information Manual und X6100 @X-tract Clearing User Guide sind seit der letzten Publikation am 31. Januar 2011 nicht verändert worden und werden lediglich der Vollständigkeit halber als Produktionsversionen veröffentlicht.

8. März 2011