



GEOS

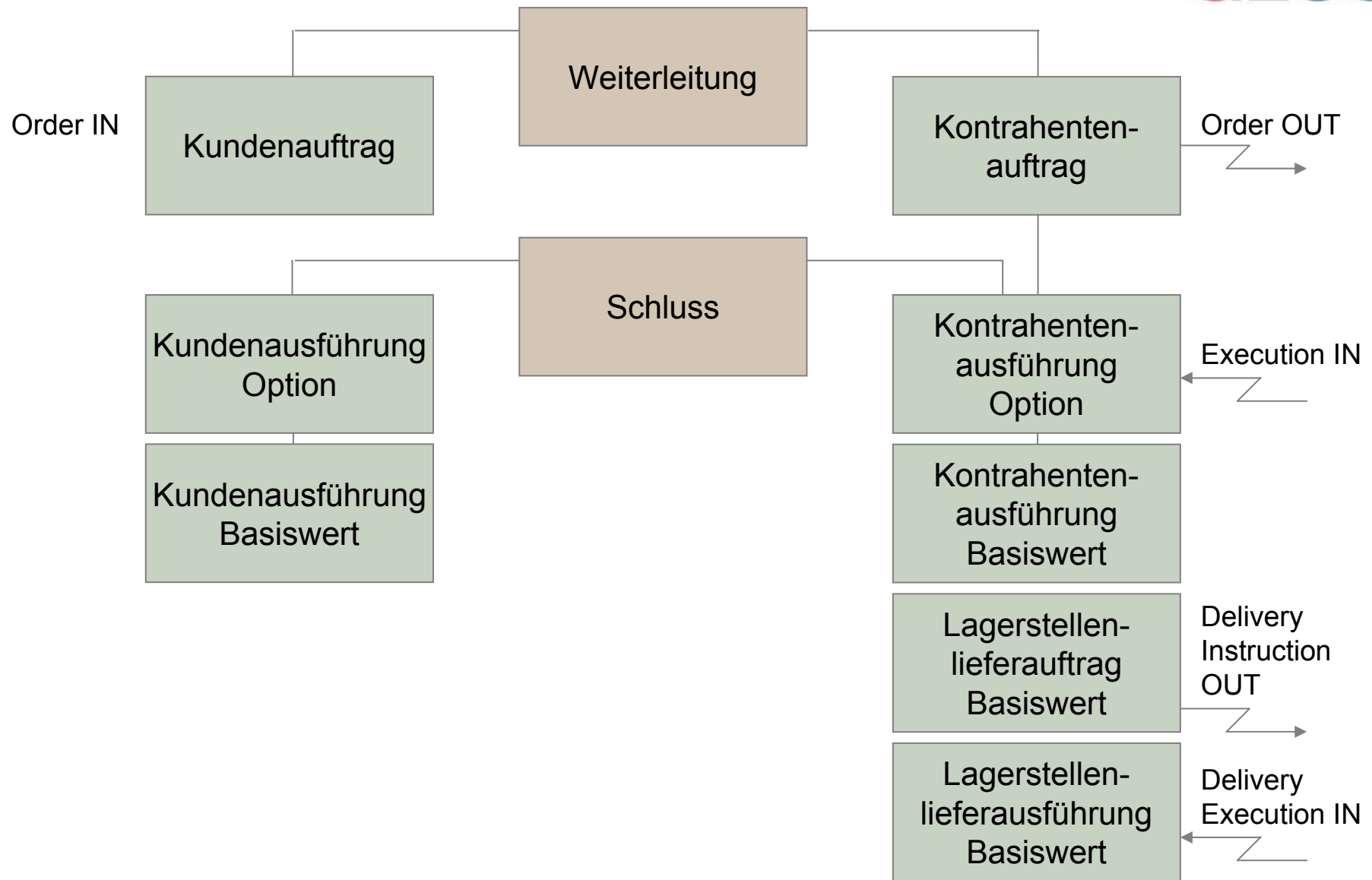
GEOS Derivate

- STP Abwicklungssystem für standardisierte Derivate
 - Stammdaten
 - Standardisierte Instrumente
 - Börsen
 - Notierungen
 - Kurse
 - Auftragsverwaltung
 - Settlement
 - Sicherheitenbewertung
 - Marginsysteme
 - Belege und Berichte

- Zentrale und dezentrale Auftragserfassung
- Aufträge für alle Transaktionstypen
- Automatische Orderweiterleitung
- Börslich und ausserbörslich
- Orderrouting, Settlement, Clearing
- Ausführungen für Derivat und Basiswert in einer Transaktion
- Auftragsmargin

- Handel (Kauf/Verkauf, Open/Close)
- Covered Call
- Give Up, Take Up
- Historisches Give Up / Take Up
- Ausübung
- Zuteilung
- Belieferung Bond Future
- Positionsübertrag

Ausübung



- Risk-Based
 - EUREX Risk-based Modul
 - OMS Risk-based Modul
- Standard Modul
- Variation Margin
- Variation Margin Bericht
- Margin Überziehungsliste
- Margin Erfordernisbericht

- Sicherheitensperren
- Flexible Bewertungsverfahren
- Online Sicherheitenbewertung

- Online-Verarbeitung
- Generierung der Ausführungen für Derivat und Basiswert in einer Transaktion
- Online Buchung
- Automatische Generierung von Lieferinstruktionen für Basiswerte

- Austausch von Collateral Messages mit Kunden und Kontrahenten
 - Gegenüberstellung von Sicherheiten und Risiko:
(SWIFT-MT506 Collateral and Exposure Statement)
 - Sicherheitenanforderung
(SWIFT-MT503 Collateral Claim)
 - Rückforderung von Sicherheiten
(SWIFT-MT503 Collateral Claim)
 - Stellung von Sicherheiten
(SWIFT-MT504 Collateral Proposal)
 - Die Bestätigung (z.B. Akzeptanz des Collateral Proposals)
(SWIFT-MT507 Collateral Status and Processing Advice)
 - Der Austausch von Sicherheiten
(SWIFT-MT505 Collateral Substitution)