X-pand into the Future

eurex rundschreiben 250/11

Datum: 14. Oktober 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

⚠ **Hohe Priorität**

Eurex Release 14.0: Anpassung des Prozesses für die Freigabe oder Hinterlegung von Geldsicherheiten

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 073/11, 207/11

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

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

Zusammenfassung:

Wie mit Eurex-Rundschreiben 073/11 angekündigt, wird mit Eurex Release 14.0 der Prozess der Freigabe oder Hinterlegung von Geldsicherheiten über das Eurex @X-tract Clearing GUI erweitert.

Derzeit können Clearing-Mitglieder bei Eurex Clearing auf zwei verschiedene Arten Geld als Sicherheit hinterlegen:

- Durch Erhöhung des Betrags der „Permanent Cash Balance“. Das Geldkonto des Clearing-Mitglieds wird so mit Wert zum nächsten Geschäftstag belastet.
- Untertägig zur Erfüllung eines „Intraday Margin Call” oder im Falle eines Sicherheitenaustauschs „Stücke gegen Geld”.

Um die Abbuchung vom Konto zu veranlassen, versendet hierbei das Clearing-Mitglied ein Fax mit entsprechender Anweisung an die Abteilung Eurex Clearing & Risk Operations.

Mit Beginn des Geschäftstags am **22. November 2011** können Clearing-Mitglieder über das Eurex @X-tract Clearing-GUI untertägig die Freigabe von hinterlegten Geldsicherheiten oder die Hinterlegung von Geldsicherheiten beantragen, anstatt dieses per Fax zu veranlassen. Ab diesem Datum werden Faxanträge nicht mehr akzeptiert.

eurex

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 14.0: Anpassung des Prozesses für die Freigabe oder Hinterlegung von Geldsicherheiten

Wie mit Eurex-Rundschreiben 073/11 angekündigt, wird mit Eurex Release 14.0 der Prozess der Freigabe oder Hinterlegung von Geldsicherheiten über das Eurex @X-tract Clearing GUI erweitert.

Derzeit können Clearing-Mitglieder bei Eurex Clearing auf zwei verschiedene Arten Geld als Sicherheit hinterlegen:

- Durch Erhöhung des Betrags der „Permanent Cash Balance“. Das Geldkonto des Clearing-Mitglieds wird so mit Wert zum nächsten Geschäftstag belastet.
- Untertägig zur Erfüllung eines „Intraday Margin Call” oder im Falle eines Sicherheitenaustauschs „Stücke gegen Geld”. Um die Abbuchung vom Konto zu veranlassen, versendet hierbei das Clearing-Mitglied ein Fax mit entsprechender Anweisung an die Abteilung Eurex Clearing & Risk Operations.

Mit Beginn des Geschäftstags am 22. November 2011 können Clearing-Mitglieder über das Eurex @X-tract Clearing-GUI untertägig die Freigabe von hinterlegten Geldsicherheiten oder die Hinterlegung von Geldsicherheiten beantragen, anstatt dieses per Fax zu veranlassen. Ab diesem Tag werden Faxanträge nicht mehr akzeptiert.

Der Antrag zur Freigabe oder Hinterlegung der Geldsicherheiten wird automatisch im Eurex Clearing-System verarbeitet. Zu diesem Zweck wird das „Security Collateral Transaction Entry”-Fenster in „Collateral Transaction Entry”-Fenster umbenannt und zusätzlich wird der bestehende Securities-Reiter um einen neuen Reiter für die Beantragung der Hinterlegung oder Freigabe von Geldsicherheiten ergänzt. Der beantragte Hinterlegungs- oder Freigabebetrag wird dem entsprechenden Konto des Clearing-Mitglieds, das für Barausgleichsgeschäfte genutzt wird, in der entsprechenden Währung entweder belastet oder gutgeschrieben.

Durch diese Erweiterung werden untertägige Freigaben oder Hinterlegungen von Geldsicherheiten automatisiert. Ebenso wie Clearing-Mitglieder heute eine Empfangsbestätigung für ein versandtes Fax erhalten, empfangen sie in Zukunft über das Eurex @X-tract Clearing GUI eine Bestätigung für den Antrag zur untertägigen Freigabe oder Hinterlegung von Geldsicherheiten.

Ab dem 22. November 2011 gelten für die Anträge die folgenden Fristen:

Währung	**Frist für Anträge zur Freigabe**	**Frist für Anträge zur Hinterlegung**
CHF	09:30 MEZ	09:00 MEZ
EUR	09:30 MEZ	14:00 MEZ
GBP	09:30 MEZ	09:00 MEZ
USD	09:30 MEZ	17:30 MEZ

Später eingereichte Anträge werden abgelehnt.

Die Fristen für Zinszahlungen auf Geldsicherheiten bleiben unverändert.

Eurex hat für Freitag, den 21. Oktober 2011 in der Eurex Release 14.0-Simulation einen zusätzlichen Fokustag eingerichtet, damit alle Teilnehmer diese Funktion umfassend testen können. Eurex Clearing Operations steht an diesem Tag für Rückmeldungen und Unterstützung unter der Tel. +49-69-211-1 12 50 zwischen 09:00 - 20:00 Uhr MESZ zur Verfügung.

14. Oktober 2011