clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 007/13

Datum: 17. Januar 2013
Empfänger: Alle Repo Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Dr. Thomas Book

Verlängerung der Repo-Laufzeiten

Kontakt: Stefan Knoblauch, T +49-69-211-1 59 16, stefan.knoblauch@eurexclearing.com

Zielgruppe:

Ü Front Office/Handel

Ü Middle + Backoffice

Anhänge:

keine

Eurex Clearing erlaubt mit Wirkung per **21. Januar 2013** den Abschluss von GC Pooling®- und Euro Repo-Markt-Transaktionen mit einer verlängerten Laufzeit.

Bisher können für Repo-Transaktionen zwischen dem Handelstag und dem Front Leg Settlement-Tag bis zu 365 Kalendertage liegen und die Laufzeit zwischen dem Front Leg und dem Term Leg eines Repos kann maximal 366 Tage betragen. Diese maximale Laufzeit von 366 Tagen gilt dabei ebenfalls für Open Term-Repos.

Mit Wirkung per 21. Januar 2013 können Repo-Transaktionen mit einem Term Leg-Settlement-Tag von 741 Tagen (zwei Jahre und zehn Tage) nach dem Handelstag abgeschlossen werden. Gleichzeitig wird ermöglicht, Open Term-Repos mit einer maximalen Laufzeit von 1096 Tagen (drei Jahre und ein Tag) abzuschließen.

Das Front Leg der Repo-Transaktion kann weiterhin unverändert bis zu 365 Tage in der Zukunft liegen.