clear to trade

e u r e x c l e a r i n g
rundschreiben 155/13

Datum: 19. Dezember 2013
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

Clearing, Abwicklung und Geldverrechnung am 24. und 31. Dezember 2013, Verfügbarkeit OTC-IRS Clearing und CCP-Services für Securities Lending

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 262/13

Verweis auf Xetra-Rundschreiben: 127/13

Kontakt: Funktionale Helpdesks: Securities Clearing, T +49-69-211-1 19 40; Derivatives Clearing, T +49-69-211-1 12 50; Risk Control, T +49-69-211-1 24 52; OTC-IRS Helpdesk, T +49-69-211-1 28 28

Zielgruppe:	**Anhänge:**
Ü Alle Abteilungen	keine

Zusammenfassung:

Zur Vereinheitlichung der Abwicklungszeiten im Euroraum wurden der **24. Dezember** und **31. Dezember 2013** in den regulären Clearing- und Abwicklungskalender der Eurex Clearing aufgenommen.

Der letzte Handelstag in diesem Jahr an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich AG ist Montag, der **30. Dezember 2013**. Dies ist auch der letzte Tag des Jahres, an dem in T7 von Eurex Exchange Ausübungen vorgenommen werden können.

Informationen zu den Eurex-Handelszeiten entnehmen Sie bitte dem Eurex-Rundschreiben 262/13.

Informationen zur Jahresabschlussbörse der Frankfurter Wertpapierbörse entnehmen Sie bitte dem Xetra-Rundschreiben 127/13.

Eurex Clearing AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
memberservices@
eurexclearing.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Dr. Hugo Bänziger

Vorstand:
Dr. Thomas Book (Vorsitzender),
Jürg Spillmann (stv. Vorsitzender),
Heike Eckert, Thomas Laux,
Erik Tim Müller, Andreas Preuß

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
Amtsgericht Frankfurt/Main

Clearing, Abwicklung und Geldverrechnung am 24. und 31. Dezember 2013, Verfügbarkeit OTC-IRS Clearing und CCP-Services für Securities Lending

Mit diesem Rundschreiben möchten wir Sie daran erinnern, dass seit 2009 der 24. Dezember und 31. Dezember reguläre Settlement-Tage sind (Abschaffung der Giovannini-Barriere 7). Der **24. Dezember** und **31. Dezember 2013** wurden daher in den regulären Clearing- und Abwicklungskalender der Eurex Clearing aufgenommen.

Die aus den Abrechnungen der Vortage fälligen Geldbeträge in Euro, Schweizer Franken, US-Dollar und Britischem Pfund werden an beiden Tagen (24. Dezember und 31. Dezember 2013) abgerechnet.

Die Vertragsstrafen gemäß den Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG, Kapitel 1, Abschnitt 1, Nummer 14.2.2, gelten entsprechend.

Monats- und Jahresend-Reports für Dezember 2013 werden erst am 31. Dezember 2013 versandt.

Die Anwesenheitspflicht für Backoffice-Mitarbeiter am 24. Dezember und 31. Dezember 2013 besteht für den Zeitraum von 08:00 Uhr bis 14:30 Uhr MEZ. Die anschließende telefonische Erreichbarkeit ist bis 20:00 Uhr MEZ vorgesehen.

Derivate-Clearing für Geschäfte der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich AG

Dem Clearing- und Abwicklungskalender der Eurex Clearing entsprechend werden am 24. Dezember und 31. Dezember 2013 für an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich AG abgeschlossenen Geschäfte spezifische Clearing-Transaktionen (HiTT, historischer Give-up, „Trade Adjustments“ wie auch „Position Adjustments“) für Handels-Transaktionen des Vortages angeboten.

Allerdings ist an diesen Tagen für die gesamte Produktpalette der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich AG weder Handel noch Order-Management möglich (d. h. keine Änderung von Vortages-Settlement-Preisen). Ausübungen sind ebenfalls nicht möglich.

Der Tagesablauf am 24. Dezember und 31. Dezember 2013 stellt sich wie folgt dar:

Zeitpunkt (MEZ)	Systemstatus	Hinweise
08:00 Uhr	Öffnung des Systems für Clearing-Transaktionen	Start Versand Settlement-Preise
13:30 Uhr	Schnitt bei der ZCQ (Previous/Current)	
14:30 Uhr	System wird für Clearing-Transaktionen geschlossen	
14:30 Uhr	Versand von End-Of-Assignment-Messages	
15:30 Uhr	Versand der Intra-Day-Theo-Dateien	Ende Versand Settlement-Preise
20:00 Uhr	Start Tagesendverarbeitung	

Des Weiteren möchten wir Sie darauf hinweisen, dass die oben genannte Regelung bezüglich erlaubter Clearing-Transaktionen (HiTT, historischer Give-Up einschließlich nachgelagerter „Trade Adjustments“ wie auch „Position Adjustments“) auch für andere Nicht-Handelstage einzelner Eurex-Produktgruppen gilt.

Securities Clearing von Aktien, Anleihen und ETF Geschäften an der Eurex Bonds, Eurex Repo, Frankfurter Wertpapierbörse oder Irish Stock Exchange und Securities Lending

Der „Securities CCP“ steht am 24. Dezember und 31. Dezember 2013 mit der gesamten Funktionalität inklusive der Services für Securities Lending zur Verfügung.

Buy-In-Auktionen werden an diesen Tagen nicht durchgeführt, sondern an dem folgenden Geschäftstag. Der. 24. Dezember und 31. Dezember 2013 werden für den Late-Delivery-Prozess, die Ermittlung der Buy-In-Auktionstage sowie die Berechnung der „ESMA Late Delivery Fine“ wie reguläre Geschäftstage gezählt.

EurexOTC Clearing

Die „OTC Clear Services“ zum Clearing von Interest Rate Swaps stehen am 24. Dezember und 31. Dezember 2013 in der vollen Funktionalität von 08:00 Uhr bis 20:00 Uhr MEZ zur Verfügung.

19. Dezember 2013