



Eurex Clearing-Rundschreiben 025/18

Einführung einer Ermäßigung für die OTC IRS & ZCIS „Gold Packs“ für die Eigenkonten der Clearing-Mitglieder

Zusammenfassung

Mit Wirkung zum **1. März 2018** führt Eurex Clearing eine Ermäßigung auf die OTC IRS und ZCIS „Gold Packs“ für die Eigenkonten der Clearing-Mitglieder ein. Das „Discounted Gold Pack“ erlaubt den Clearing-Mitgliedern unlimitiertes Clearing aller OTC IRD-Produkte, einschließlich IRS, OIS, FRA, Basis, ZCIS für alle Währungen vom 1. März bis zum 31. Dezember 2018. Die bestehenden „Gold Packs“ werden mit einer Ermäßigung von ~68 Prozent angeboten.

Die Eckpunkte des „Discounted Gold Pack“ sind wie folgt:

- Verfügbar für alle Clearing-Mitglieder
- Unlimitiertes Clearing für alle OTC IRD-Produkte: IRS, OIS, FRA, Basis und ZCIS für alle Währungen – es bestehen keine Limite für abgewickelte und ausstehende Volumina
- Buchungsfrist: 31. März 2018
- Laufzeit: 1. März bis 31. Dezember 2018 (10 Monate)
- Monatliche Raten von 100.000 Euro (entspricht ~68 Prozent Ermäßigung auf kombinierte „Gold Packs“)

Anhang:

- Überblick Discounted OTC IRD GOLD „All clear“ Pack for 2018 (in englischer Sprache)

Datum: 1. März 2018

Empfänger:

Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren

Autorisiert von:

Matthias Graulich

Zielgruppe:

Back Office

Kontakt:

Ihr Key Account Manager
Clearing, clearing.services-admission@eurexclearing.com
Eurex Pricing,
eurex.pricing@eurexexchange.com



Einführung einer Ermäßigung für die OTC IRS & ZCIS „Gold Packs“ für die Eigenkonten der Clearing-Mitglieder

Um es den Marktteilnehmern zu ermöglichen, den Aufbau eines alternativen Liquiditätspools für das Clearing von OTC-Zinsderivaten (OTC IRD) in der EU zu unterstützen, gewährt Eurex Clearing eine Ermäßigung auf ihre bestehenden „Gold Packs“ für Clearing-Mitglieder, die hohe Volumina in OTC IRD abwickeln. Dieses Paket erlaubt es Clearing-Mitgliedern, die das Paket abonniert haben, alle OTC IRD-Produkte inklusive IRS, OIS, FRA, Basis und ZCIS für alle Währungen ohne Limite für abgewickelte und ausstehende Volumina, unter einem „Discounted Gold Pack“ abzuwickeln. Das „Discounted Gold Pack“ wird mit einer Ermäßigung von ~68 Prozent gegenüber den „Gold Packs“ für IRS und ZCIS, die im Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG, Kapitel 10.4. aufgeführt sind, angeboten.

Die Details des „Discounted Gold Pack“ sind der nachfolgenden Tabelle zu entnehmen:

Discounted Gold Pack	
Beschreibung	„Discounted Gold Pack“
Produktumfang	IRS, FRA, OIS, Basis, ZCIS für alle Währungen
Buchungsfrist	31. März 2018
Laufzeit	1. März bis 31. Dezember 2018
Ermäßigtes fixes Entgelt für Laufzeit	1,0 Millionen EUR
Monatliche Raten über Laufzeit	100.000 EUR

Wenn Sie das „Discounted Gold Pack“ abonnieren möchten, nehmen Sie bitte die folgenden Schritte vor:

1. Füllen Sie die Seiten 1 und 6 des Formulars „EurexOTC Clear Interest Rate Derivative Static Data Formular fuer Clearing-Mitglieder (Produktion)“ aus. Wählen Sie dabei beide „Gold Packs“. Das Formular steht auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link zum Herunterladen zur Verfügung:

Ressourcen > Formulare > EurexOTC Clear > Interest Rate Swaps > EurexOTC Clear Interest Rate Derivative Static Data Formular fuer Clearing-Mitglieder (Produktion)

2. Reichen Sie das Formular bis spätestens dem **31. März 2018** bei Ihrem Key Account Manager Clearing ein.

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, kontaktieren Sie Ihren Key Account Manager Clearing oder senden eine E-Mail an: clearing.services-admission@eurexclearing.com.

Discounted OTC IRD GOLD “All clear” Pack for 2018 available until end of March 2018

	GOLD			GOLD <i>All clear 2018¹</i>
	IRS, OIS, FRA, Basis	ZCIS	Discount	IRS, OIS, FRA, Basis, ZCIS
Fixed Fee p.a. in mn EUR	2.75	0.375		1.0
<i>Threshold for cleared notional volume and notional outstanding in bn EUR included in fixed fee</i>	<i>unlimited</i>	<i>unlimited</i>		

- Term: March to December 2018
- Available to all Clearing Members
- Unlimited clearing for IRS, OIS, FRA, Basis and inflation swaps across all currencies
- Monthly instalment of € 100,000
- Booking possible until 31 March 2018