clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 141/16

Datum: 5. Dezember 2016
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 23. und 30. Dezember 2016

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

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

Zusammenfassung:

Mit diesem Rundschreiben möchten wir Sie auf die veränderten Abwicklungszeiten für den **23. Dezember** und **30. Dezember 2016** verweisen.

Die aus den Abrechnungen der Vortage fälligen Geldbeträge in Euro, Schweizer Franken, US-Dollar, Britischem Pfund, Taiwan-Dollar und Japanischem Yen werden an beiden Tagen (23. Dezember und 30. Dezember 2016) abgerechnet. Der Südkoreanische Won wird am 23. Dezember 2016 abgerechnet und am 30. Dezember 2016 erfolgt keine Geldverrechnung.

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

Es besteht die reguläre Anwesenheitspflicht für Backoffice-Mitarbeiter.

eurex clearing

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:
Erik Tim Müller (Vorsitzender),
Heike Eckert (stv. Vorsitzende),
Matthias Graulich,
Thomas Laux,
Manfred Matusza

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
USt-IdNr. DE194821553
Amtsgericht Frankfurt/Main

Clearing, Abwicklung und Geldverrechnung am 23. und 30. Dezember 2016

Mit diesem Rundschreiben möchten wir Sie auf die veränderten Abwicklungszeiten für den 23. Dezember und 30. Dezember 2016 verweisen.

Die aus den Abrechnungen der Vortage fälligen Geldbeträge in Euro, Schweizer Franken, US-Dollar, Britischem Pfund, Taiwan-Dollar und Japanischem Yen werden an beiden Tagen (23. Dezember und 30. Dezember 2016) abgerechnet. Der Südkoreanische Won wird am 23. Dezember 2016 abgerechnet und am 30. Dezember 2016 erfolgt keine Geldverrechnung.

Die Vertragsstrafen gemäß den Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG, Kapitel I, Abschnitt 1 Nummer 14.2.2 gelten entsprechend. Es besteht die reguläre Anwesenheitspflicht für Backoffice-Mitarbeiter.

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

Für den 23. Dezember und 30. Dezember 2016 stellen sich die Handels- und Abwicklungszeiten wie folgt dar:

Derivatives Market		23. Dezember 2016			
		Trading	TES until	Post-Trading	Exercising until
Equity Products	Irish Stock Options	09:00 - 13:30	18:30	13:30 - 20:00	20:00
	British Stock Options	09:00 - 13:30	18:30	13:30 - 20:00	20:00
	Russian Stock Options	09:00 - 13:30	19:00	13:30 - 20:00	20:00
	Irish Stock Futures	09:00 - 13:30	19:33	13:30 - 20:00	
	British Stock Futures	09:00 - 13:30	19:36	13:30 - 20:00	
	Russian Stock Futures	09:00 - 13:30	19:36	13:30 - 20:00	
Index Products	RDX Index Options	09:00 - 13:30	19:00	13:30 - 20:30	
Commodity Derivatives	ETFS Crude Oil Futures/Options	09:00 - 13:30	18:30	13:30 - 20:00	
	ETFS Physical Gold Futures/Options	09:00 - 13:30	18:30	13:30 - 20:00	

Derivatives Market		30. Dezember 2016			
		Trading	TES until	Post-Trading	Exercising until
Equity Products	Irish Stock Options	09:00 - 13:30	18:30	13:30 - 20:00	20:00
	British Stock Options	09:00 - 13:30	18:30	13:30 - 20:00	20:00
	Russian Stock Options	09:00 - 13:30	19:00	13:30 - 20:00	20:00
	Irish Stock Futures	09:00 - 13:30	19:33	13:30 - 20:00	
	British Stock Futures	09:00 - 13:30	19:36	13:30 - 20:00	
	Russian Stock Futures	09:00 - 13:30	19:36	13:30 - 20:00	
	German Stock Options	09:00 - 14:00	19:00	14:00 - 20:00	20:00
	German Stock Futures	09:00 - 14:00	19:35	14:00 - 20:00	
Index Products	RDX Index Options	09:00 - 13:30	19:00	13:30 - 20:30	
	German Index Options	09:00 - 14:00	19:00	14:00 - 20:30	
Exchange Trades Funds	DB X-Trackers Options	09:05 - 14:00	19:00	14:00 - 20:00	
	iShares Options	09:05 - 14:00	19:00	14:00 - 20:00	20:00
	iShares Futures	09:05 - 14:00	20:00	14:00 - 20:00	
	Source Options	09:05 - 14:00	19:00	14:00 - 20:00	20:00
	Lyxor Options	09:05 - 14:00	19:00	14:00 - 20:00	20:00
Commodity Derivatives	ETFS Crude Oil Futures/Options	09:00 - 13:30	18:30	13:30 - 20:00	
	ETFS Physical Gold Futures/Options	09:00 - 13:30	18:30	13:30 - 20:00	
	Xetra-Gold Futures/Options	09:03 - 14:00	19:00	14:00 - 20:00	

Für alle anderen Produkte gelten die normalen Handelszeiten. Die Batchverarbeitung wird um 22:30 CET gestartet.

2. Clearing von Aktien, Anleihen und ETF-Geschäften an Eurex Bonds, Eurex Repo, Frankfurter Wertpapierbörse und Irish Stock Exchange und Geschäften aus Wertpapierdarlehens-Transaktionen (Securities Lending)

Der „Securities CCP“ steht am 23. Dezember und 30. Dezember 2016 mit der gesamten Funktionalität inklusive der Services für Securities Lending von 07:00 Uhr bis 19:00 Uhr MEZ zur Verfügung.

Buy-In-Auktionen werden an diesen Tagen wie gewohnt durchgeführt. Der 23. Dezember und 30. Dezember 2016 werden für den Late-Delivery-Prozess, die Ermittlung der Buy-In-Auktionstage sowie die Berechnung der „ESMA Late Delivery Fine“ wie reguläre Geschäftstage gezählt.

3. EurexOTC Clearing

Die „EurexOTC Clear Services“ zum Clearing von Interest Rate Swaps stehen am 23. Dezember und 30. Dezember 2016 mit der vollen Funktionalität von 08:00 Uhr bis 22:00 Uhr MEZ zur Verfügung.

4. Risikomanagement

Da der „Securities CCP“ und die „EurexOTC Clear Services“ mit der vollen Funktionalität zur Verfügung stehen, kann es während des gesamten Tages zu Intraday-Margin-Calls kommen, die wie gewohnt von Clearing-Teilnehmern bedient werden müssen.

5. Dezember 2016