clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 113/12

Datum: 11. Dezember 2012
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG, alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

Clearing, Abwicklung und Geldverrechnung am 24. und 31. Dezember 2012, Verfügbarkeit OTC-IRS Clearing und CCP-Services für Securities Lending

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 251/12

Kontakt: Funktionale Helpdesks: Securities Clearing, T +49-69-211-1 1 19 40, OTC-Clear, T +49-69-211-1 25 25, Derivatives Clearing, T +49-69-211-1 12 50

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Zur Vereinheitlichung der Abwicklungszeiten im Euroraum wurden der **24.** und **31. Dezember 2012** in den regulären Clearing- und Abwicklungskalender der Eurex Clearing AG aufgenommen.

Der letzte Handelstag in diesem Jahr ist Freitag, der **28. Dezember 2012**. Dies ist auch der letzte Tag des Jahres, an dem im Eurex®-System Ausübungen vorgenommen werden können.

Informationen zu den Eurex-Handelszeiten entnehmen Sie bitte dem Eurex Rundschreiben 251/12.

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:
Andreas Preuß (Vorsitzender),
Jürg Spillmann, Dr. Thomas Book,
Gary Katz, Michael Peters,
Peter Reitz

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

Clearing, Abwicklung und Geldverrechnung am 24. und 31. Dezember 2012, Verfügbarkeit OTC-IRS Clearing und CCP-Services für Securities Lending

Mit diesem Rundschreiben möchten wir Sie daran erinnern, dass seit 2009 der 24. und 31. Dezember reguläre Settlement-Tage sind (Abschaffung der Giovannini-Barriere 7).

Entsprechend werden an diesen Tagen an den Eurex-Börsen spezifische Handelsfunktionen auf Basis von Transaktionen des Vortages (HiTT, historischer Give-up, „Trade Adjustments“ wie auch „Position Adjustments“) angeboten.

An diesen Tagen ist über die gesamte Produktpalette der Eurex-Börsen hinweg weder Handel, noch Order-Management möglich. Ausübungen sind ebenfalls nicht möglich.

Der Tagesablauf stellt sich wie folgt dar:

Zeitpunkt*	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	

*Alle Zeitangaben in MEZ.

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

Das Verzugsprozedere gemäß den Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG, Abschnitt 7.2 gilt entsprechend.

Monats-/ und Jahresend-Reports für Dezember 2012 werden erst am 31. Dezember 2012 versandt.

Der „Securities CCP“ steht an den oben genannten Tagen mit der gesamten Funktionalität inklusive der Services für Securities Lending zur Verfügung.

Buy-In-Auktionen werden an diesen Tagen nicht durchgeführt, sondern auf den folgenden Geschäftstag verlegt. Diese Tage werden für den Late-Delivery-Prozess, die Ermittlung der Buy-In-Auktionstage sowie die Berechnung der „ESMA Late Delivery Fine“ wie reguläre Geschäftstage mitgezählt.

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

Die Anwesenheitspflicht für Backoffice-Mitarbeiter am 24. und 31. Dezember 2012 beläuft sich auf den Zeitraum von 08:00 bis 14:30 Uhr MEZ. Die anschließende telefonische Erreichbarkeit ist bis 20:00 Uhr MEZ vorgesehen.

Am 28. Dezember 2012 beläuft sich die Anwesenheitspflicht für Backoffice-Mitarbeiter auf den Zeitraum von 07:00 bis 20:00 Uhr MEZ.

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 Nicht-Handelstage einzelner Eurex-Produktgruppen gilt.

11. Dezember 2012