

clear to trade



eurex clearing

rundschreiben 165/14

Datum: 21. November 2014
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

 **Hohe Priorität**

EURIBOR-Futures: Clearing von Packs, Bundles, Strips und neuen Standard-Futures-Strategien

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 076/14, 248/14

Kontakt: Derivatives Clearing, T +49-69-211-1 12 50, clearing@eurexclearing.com

Zielgruppe:

☞ Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderte Abschnitte des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG

Zusammenfassung:

Mit Wirkung zum **8. Dezember 2014** bietet Eurex Clearing das Clearing der an Eurex Exchange mit T7 Release 2.5 eingeführten Produktstrategien in den EURIBOR-Futures an. Eingeführt werden Packs, Bundles und Strips sowie neue Standard-Futures-Strategien.

Um einen Anreiz zum Handel in den neuen Produktstrategien zu schaffen, werden die Transaktionsentgelte für Packs und Bundles in der Zeit vom 8. Dezember 2014 bis zum 30. Juni 2015 ausgesetzt. Ab dem 1. Juli 2015 können Packs und Bundles mit Ermäßigungen auf die Transaktionsentgelte im Vergleich zu den einzelnen Outright-Kontrakten gehandelt werden.

Dieses Rundschreiben enthält Informationen zum Clearing der neuen Produktstrategien sowie die geänderten Abschnitte des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG (Preisverzeichnis). Informationen speziell zum Handel der neuen Produktstrategien sowie die geänderten Abschnitte der relevanten Regelwerke der Eurex Deutschland und Eurex Zürich AG sind in den Eurex-Rundschreiben 076/14 und 248/14 enthalten.

Die geänderten Abschnitte im Preisverzeichnis werden zum 8. Dezember 2014 wirksam.



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),
Heike Eckert, Matthias Graulich,
Thomas Laux, Erik Tim Müller

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

EURIBOR-Futures: Clearing von Packs, Bundles, Strips und neuen Standard-Futures-Strategien

Mit Wirkung zum 8. Dezember 2014 bietet Eurex Clearing das Clearing der an Eurex Exchange mit T7 Release 2.5 eingeführten Produktstrategien in den EURIBOR-Futures an. Eingeführt werden Packs, Bundles und Strips sowie neue Standard-Futures-Strategien.

Um einen Anreiz zum Handel in den neuen Produktstrategien zu schaffen, werden die Transaktionsentgelte für Packs und Bundles in der Zeit vom 8. Dezember 2014 bis zum 30. Juni 2015 ausgesetzt. Ab dem 1. Juli 2015 können Packs und Bundles mit Ermäßigungen auf die Transaktionsentgelte im Vergleich zu den einzelnen Outright-Kontrakten gehandelt werden. In den folgenden Tabellen ist das Transaktionsentgeltmodell dargestellt:

Pack-Kombinationen	Transaktionsentgelt pro Kombination nach Rabatt	Transaktionsentgelt pro Leg nach Rabatt	Ersparnis gegenüber den einzelnen Outright Legs
White Pack	EUR 0,64	EUR 0,16	EUR 0,16
Red Pack	EUR 0,60	EUR 0,15	EUR 0,20
Green Pack	EUR 0,56	EUR 0,14	EUR 0,24
Blue Pack	EUR 0,16	EUR 0,04	EUR 0,64
Golden Pack	EUR 0,08	EUR 0,02	EUR 0,72

Bundle-Kombinationen	Transaktionsentgelt pro Kombination nach Rabatt	Transaktionsentgelt pro Leg nach Rabatt	Ersparnis gegenüber den einzelnen Outright Legs
2-Jahres-Bundle	0,96 EUR	0,12 EUR	0,64 EUR
3-Jahres-Bundle	0,96 EUR	0,08 EUR	1,44 EUR
4-Jahres-Bundle	0,96 EUR	0,06 EUR	2,24 EUR
5-Jahres-Bundle	0,80 EUR	0,04 EUR	3,20 EUR

Informationen speziell zum Handel der neuen Produktstrategien sowie die geänderten Abschnitte der relevanten Regelwerke der Eurex Deutschland und Eurex Zürich AG sind in den Eurex-Rundschreiben 076/14 und 248/14 enthalten.

Die geänderten Abschnitte des Preisverzeichnisses (siehe Anhang) treten am 8. Dezember 2014 in Kraft.

Ab dem 8. Dezember 2014 ist das vollständige angepasste Preisverzeichnis auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link abrufbar:

Ressourcen > Regelwerke > Preisverzeichnis

Gemäß Ziffer 16 Abs. 3 des Preisverzeichnisses gelten die mit diesem Rundschreiben mitgeteilten Änderungen und Ergänzungen des Preisverzeichnisses als durch das jeweilige Clearing-Mitglied angenommen, sofern dieses nicht durch schriftliche Mitteilung an die Eurex Clearing AG innerhalb von zehn (10) Geschäftstagen nach der Veröffentlichung widerspricht.

Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

3 Transaktionsentgelte für Derivate-Geschäfte (Orderbuch-Geschäfte und Off-Book-Geschäfte an den Eurex-Börsen)

[...]

3.2 Rabatte

[...]

3.2.4 Rabatte für Orderbuch-Geschäfte in Geldmarkt-Futures Strategien

<u>Strategie</u>	<u>Währung</u>	<u>Entgelt pro Strategie</u>	<u>Anzahl Kontrakte</u>	<u>Entgelt pro Kontrakt</u>
<u>Dreimonats-EURIBOR Futures</u>				
<u>Packs</u>				
<u>White Pack</u>	<u>EUR</u>	<u>0,64</u>	<u>4</u>	<u>0,16</u>
<u>Red Pack</u>	<u>EUR</u>	<u>0,60</u>	<u>4</u>	<u>0,15</u>
<u>Green Pack</u>	<u>EUR</u>	<u>0,56</u>	<u>4</u>	<u>0,14</u>
<u>Blue Pack</u>	<u>EUR</u>	<u>0,16</u>	<u>4</u>	<u>0,04</u>
<u>Gold Pack</u>	<u>EUR</u>	<u>0,08</u>	<u>4</u>	<u>0,02</u>
<u>Bundles</u>				
<u>2-Jahres Bundle</u>	<u>EUR</u>	<u>0,96</u>	<u>8</u>	<u>0,12</u>
<u>3-Jahres Bundle</u>	<u>EUR</u>	<u>0,96</u>	<u>12</u>	<u>0,08</u>
<u>4-Jahres Bundle</u>	<u>EUR</u>	<u>0,96</u>	<u>16</u>	<u>0,06</u>
<u>5-Jahres Bundle</u>	<u>EUR</u>	<u>0,80</u>	<u>20</u>	<u>0,04</u>

[...]