Eurex Clearing-Rundschreiben 028/18

Aktienindexderivate: Einstellung der Clearing-Services für Futures und Optionen auf den Sensex-Index

Zusammenfassung

Im Zusammenhang mit dem von der Geschäftsführung der Eurex Deutschland und der Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG (zusammen: die Eurex-Börsen) gefassten Beschluss, die Zulassung zum Handel der Futures und Optionen auf den Sensex-Index an den Eurex-Börsen zu widerrufen, wird Eurex Clearing die Clearing-Services für diese Produkte mit Wirkung zum **3. April 2018** einstellen.

Dieses Rundschreiben enthält die geänderten Abschnitte der folgenden Regelwerke:

- Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG
- Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG

Informationen speziell zum Widerruf der Zulassung der Produkte und den geänderten Abschnitten der relevanten Regelwerke der Eurex-Börsen entnehmen Sie bitte Eurex-Rundschreiben 018/18.

Anhänge:

1. Aktualisierte Abschnitte der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG
2. Aktualisierte Abschnitte des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG

Datum: 6. März 2018

Empfänger:
Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren

Autorisiert von:
Heike Eckert

Zielgruppe:
Alle Abteilungen

Verweis auf Rundschreiben:
Eurex-Rundschreiben 018/18

Kontakt:
Clearing Operations,
T +49-69-211-1 12 50,
clearing@eurexclearing.com,
Risk Control,
T +49-69-211-1 24 52,
risk@eurexclearing.com

Aktienindexderivate: Einstellung der Clearing-Services für Futures und Optionen auf den Sensex-Index

Im Zusammenhang mit dem von der Geschäftsführung der Eurex Deutschland und der Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG (zusammen: die Eurex-Börsen) gefassten Beschluss, die Zulassung zum Handel der Futures und Optionen auf den Sensex-Index an den Eurex-Börsen zu widerrufen, wird Eurex Clearing die Clearing-Services für diese Produkte mit Wirkung zum 3. April 2018 einstellen.

Dieses Rundschreiben enthält die geänderten Abschnitte der folgenden Regelwerke:

- Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG
- Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG

Informationen speziell zum Widerruf der Zulassung der Produkte und den geänderten Abschnitten der relevanten Regelwerke der Eurex-Börsen entnehmen Sie bitte Eurex-Rundschreiben 018/18.

1. Änderungen in den Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

Die Änderungen in den Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG (Clearing-Bedingungen) sind diesem Rundschreiben angehängt (Anhang 1).

Die Änderungen treten zum 3. April 2018 in Kraft. Zum Datum des Inkrafttretens wird die Vollversion der geänderten Clearing-Bedingungen auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link zum Herunterladen verfügbar sein:

Ressourcen > Regelwerke > Clearing-Bedingungen

2. Änderungen im Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG

Die Änderungen im Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG (Preisverzeichnis) sind diesem Rundschreiben angehängt (Anhang 2).

Die Änderungen treten zum 3. April 2018 in Kraft. Zum Datum des Inkrafttretens wird die Vollversion des geänderten Preisverzeichnisses auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Link zum Herunterladen verfügbar sein:

Ressourcen > Regelwerke > Preisverzeichnis

Gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 17.2.2 und Ziffer 17.2.6 der Clearing-Bedingungen gelten die mit diesem Rundschreiben mitgeteilten Änderungen und Ergänzungen der Clearing-Bedingungen als durch jedes Clearing-Mitglied, Basis-Clearing-Mitglied, FCM-Clearing-Mitglied, Nicht-Clearing-Mitglied, jeden Registrierten Kunden und FCM-Kunden angenommen, sofern dieser nicht durch schriftliche Mitteilung an die Eurex Clearing AG innerhalb der Regulären Ankündigungsfrist von mindestens fünfzehn (15) Geschäftstagen vor dem tatsächlichen Inkrafttreten den Änderungen oder Ergänzungen der Clearing-Bedingungen widerspricht.

Gemäß Ziffer 14 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.

Für Fragen oder weitere Informationen kontaktieren Sie bitte Clearing Operations unter Tel. +49-69-211-1 12 50, E-Mail clearing@eurexclearing.com, oder Risk Control, Tel. +49-69-211-1 24 52, E-Mail: risk@eurexclearing.com.

6. März 2018

Kapitel II der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

Transaktionen an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

(Eurex-Börsen)

Stand 03.04.2018

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

Abschnitt 2 Clearing von Futures-Kontrakten

Die nachfolgenden Bestimmungen regeln das Clearing von Transaktionen in den in Ziffer 1 der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Futures-Kontrakte („**Eurex-Kontraktspezifikationen**“).

[…]

2.4.2 Schlussabrechnungspreis

Der Schlussabrechnungspreis der Index-Futures-Kontrakte wird von der Eurex Clearing AG am Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.3.4 der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich) eines Kontrakts festgelegt.

[…]

~~(8) Maßgebend für die Sensex Index Futures-Kontrakte ist der Schlusswert des Sensex Index auf der Grundlage der umsatzgewichteten Durchschnittskurse (VWAP) aller enthaltenen Wertpapiere über die letzten 30 Minuten des Handels an der Bombay Stock Exchange (BSE).~~

[…]

Abschnitt 3 Clearing von Optionskontrakten

Die nachfolgenden Bestimmungen regeln das Clearing von Transaktionen in den in Ziffer 2 der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Optionskontrakte („**Eurex-Kontraktspezifikationen**“).

[…]

3.4.3 Schlussabrechnungspreis

[…]

(8) ~~Maßgebend für die Sensex Index Options-Kontrakte ist der Schlusswert des Sensex Index auf der Grundlage der umsatzgewichteten Durchschnittskurse (VWAP) aller enthaltenen Wertpapiere über die letzten 30 Minuten des Handels an der Bombay Stock Exchange (BSE).~~

[…]

[…]

****

****

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)

[…]

3.1 Zusammenführung / Erfassung von Derivate-Geschäften

[…]

Produkt / Produktgruppe	**Währung**	**Ausführungsart**	**Konten**	**Standard-Entgelt pro Kontrakt** (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	**Reduziertes Entgelt pro Kontrakt** (Kontraktanzahl > Schwellenwert)	**Schwellen-wert** (Kontrakt-anzahl)
[…]						
Aktienindexderivate						
Aktienindex-Futures						
[…]						
~~Sensex Futures~~	~~USD~~	~~Orderbuch~~	~~A~~	~~0,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~P~~	~~0,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~M~~	~~0,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
		~~Off-Book~~	~~A~~	~~0,30~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~P~~	~~0,30~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~M~~	~~0,30~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
[…]						
Aktienindex-Optionen						
[…]						
~~Sensex Optionen~~	~~USD~~	~~Orderbuch~~	~~A~~	~~0,20~~	~~0,10~~	~~3.000~~
			~~P~~	~~0,20~~	~~0,10~~	~~2.000~~
			~~M~~	~~0,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
		~~Off-Book~~	~~A~~	~~0,20~~	~~0,10~~	~~3.000~~
			~~P~~	~~0,20~~	~~0,10~~	~~2.000~~
			~~M~~	~~0,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
[…]						

[…]

3.3 Positionsglattstellungen (Position Closing Adjustments)

[…]

Produkt / Produktgruppe	Entgelt pro Kontrakt
[…]	
Aktienindexderivate	
[…]	
~~Sensex Futures~~	~~USD 0,40~~
[…]	

3.4 Barausgleich (Cash Settlement)

Produkt / Produktgruppe	Entgelt pro Kontrakt	Maximales Entgelt für Kontrakte auf den gleichen Basiswert je A-, P- und M-Konto
[…]		
Aktienindexderivate		
[…]		
~~Sensex Futures~~	~~USD 0,20~~	~~n. a.~~
[…]		

[…]

3.7 Ausübung von Optionen

[…]

Produkt / Produktgruppe	Konten	Entgelt pro Kontrakt
[…]		
Aktienindexderivate		
[…]		
~~Sensex Optionen~~	~~A~~	~~USD 0,20~~
	~~P~~	~~USD 0,20~~
	~~M~~	~~USD 0,20~~
[…]		

[…]

****