clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 107/17

Datum: 24. Oktober 2017
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

Eurex OTC Clear: EUR OTC IRS-Kalkulation durch Eurex Clearing

Kontakt: EurexOTC Helpdesk, T +49-69-211-1 28 28, OTCClear@eurexclearing.com

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Eurex Clearing's umsichtiger Risikomanagementansatz ist im Einklang mit anerkannten Markstandards. Resultierend aus dem kontinuierlichen Wachstum und der zunehmenden Liquidität in unserem OTC IRS Clearing-Angebot, sind die Eurex Clearing-spezifischen EUR OTC IRS-Preise liquide und im Markt verfügbar geworden. Um unsere Berechnungsmethode für Variation Margins und Initial Margins an die festgestellten Marktpreise anzupassen und um die Preisbasis für unsere Default Management-Prozesse zu stärken, werden die festgestellten Eurex Clearing-spezifischen Preise in die untertägigen Berechnungen sowie Tagesendberechnungen für EUR OTC IRS **ab dem 18. Dezember 2017** mit einbezogen.

Es sind keine Änderungen an den Reports oder an anderen Prozessen seitens der Clearing-Mitglieder oder Vendoren notwendig.

Änderungen der EUR Swap Curves, die der Market-to-Market- und Margin-Kalkulation zugrunde liegen, werden für alle Swapkurven auf dem Input-Quote-Level vorgenommen (Eonia, 1m-, 3m-, 6m- und 12m-EURIBOR).

eurex clearing

Eurex Clearing AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

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