clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 102/16

Datum: 9. August 2016
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG sowie Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

Britisches Pfund als Clearing-Währung und weitere Anpassungen

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 071/16, 092/16

Kontakt: Group Client Services & Administration, T +49-69-211-1 17 00, memberservices@eurexclearing.com

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Back Office
- IT/System Administration

Anhang:

Geänderte Abschnitte des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG

Zusammenfassung:

Dieses Rundschreiben enthält Informationen zu Britischem Pfund als Clearing-Währung sowie entsprechenden Anpassungen hinsichtlich der folgenden Themen:

1. Anpassung der Entgelte für geleistete Geldsicherheiten für Beiträge in Britischen Pfund von 0,50 Prozent p.a. auf 0,20 Prozent p.a.
2. Der monatliche Mindestbetrag an „Abwicklungsbank-Entgelt“ (Untergrenze) für Clearing-bezogene Geldzahlungen in Schweizer Franken und Britischen Pfund durch Geschäftsbanken wird auf CHF 3.300 und GBP 2.400 gesetzt.
3. Änderung der Annahmeschlusszeiten für die Bereitstellung von Geldsicherheiten in Britischen Pfund.

Die geänderten Abschnitte des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG, wie durch den Vorstand der Eurex Clearing AG beschlossen, befinden sich im Anhang zu diesem Rundschreiben.

Die unter den Punkten 1. und 2. genannten Änderungen werden am **24. August 2016** in Kraft treten.

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:
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

Britisches Pfund als Clearing-Währung und weitere Anpassungen

Dieses Rundschreiben enthält Informationen zu Britischem Pfund als Clearing-Währung sowie entsprechenden Anpassungen hinsichtlich der folgenden Themen:

1. Anpassung der Entgelte für geleistete Geldsicherheiten für Beiträge in Britischen Pfund von 0,50 Prozent p.a. auf 0,20 Prozent p.a.
2. Der monatliche Mindestbetrag an „Abwicklungsbank-Entgelt“ (Untergrenze) für Clearing-bezogene Geldzahlungen in Schweizer Franken und Britischen Pfund durch Geschäftsbanken wird auf CHF 3.300 und GBP 2.400 gesetzt.
3. Änderung der Annahmeschlusszeiten für die Bereitstellung von Geldsicherheiten in Britischen Pfund.

Die geänderten Abschnitte des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG, wie durch den Vorstand der Eurex Clearing AG beschlossen, befinden sich im Anhang zu diesem Rundschreiben.

Die unter den Punkten 1. und 2. genannten Änderungen werden am 24. August 2016 in Kraft treten.

1. Anpassung der Entgelte für geleistete Geldsicherheiten in Britischen Pfund

Aufgrund der Einführung von Britischem Pfund als zusätzliche Clearing-Währung werden die Entgelte für geleistete Geldsicherheiten in Britischen Pfund von 0,50 Prozent p.a. auf 0,20 Prozent p.a. angepasst. Das Wirksamkeitsdatum ist der 24. August 2016.

2. Monatlicher Mindestbetrag an „Abwicklungsbank-Entgelt“ (Untergrenze)

Am 2. August 2016 hat Eurex Clearing ein „Abwicklungsbank-Entgelt“ für Clearing-bezogene Geldzahlungen in Clearing-Währungen eingeführt, welches Clearing-Mitglieder zu entrichten haben, die von der Nutzung einer Geschäftsbank für Zahlungen in Euro, Schweizer Franken oder Britischen Pfund Gebrauch machen. Das volumenbasierte Entgelt wird in der gewählten Clearing-Währung berechnet und fällt mit 0,1 Basispunkten auf die Gesamtbeträge an, die durch die Geschäftsbank abgewickelt werden. Der monatliche Mindestbetrag (Untergrenze) liegt bei EUR 3.000. Das volumenbasierte Entgelt wird seitens Eurex Clearing bis Ende 2017 nicht belastet (siehe Eurex Clearing-Rundschreiben 092/16).

Es ist nicht beabsichtigt, das monatliche Mindestentgelt von EUR 3.000 auf einer monatlichen Basis in Schweizer Franken oder Britischen Pfund umzurechnen. Es ist vielmehr vorgesehen, einen feststehenden Gegenwert in Schweizer Franken und Britischen Pfund von CHF 3.300 und entsprechend GBP 2.400 zu verwenden. Der monatliche Mindestbetrag (Untergrenze) wird erhoben, wenn eine Abwicklungsbank an mindestens einem Tag des entsprechenden Kalendermonats genutzt wird.

3. Änderung der Annahmeschlusszeiten für die Bereitstellung von Geldsicherheiten in Britischen Pfund

Eurex Clearing hat beschlossen, die Kapazität zur Investition von Mitteln im Geldmarkt zu erweitern, um somit den Ertrag auf Kunden-Geldsicherheiten in Britischen Pfund zu verbessern. Daher wurden die Annahmeschlusszeiten zur Hinterlegung von Geldsicherheiten in Britischen Pfund auf 17:15 MEZ über das Eurex@X-tract Clearing GUI und entsprechend auf 17:00 MEZ über Fax geändert.

Die geänderten Abschnitte des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG, wie durch den Vorstand der Eurex Clearing AG beschlossen, befinden sich im Anhang zu diesem Rundschreiben.

Ab dem Wirksamkeitsdatum des 24. August 2016 wird das geänderte Preisverzeichnis auf der Eurex Clearing Website www.eurexclearing.com unter folgendem Link zur Verfügung gestellt:

Ressourcen > Regelwerke > Preisverzeichnis

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.

Sollten Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Group Client Services & Administration unter Tel. +49-69-211-1 17 00 oder senden Sie eine E-Mail an memberservices@eurexclearing.com.

9. August 2016

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

9. Serviceentgelte für Sicherheiten, Beiträge zum Clearing-Fonds und zur Erfüllung der Anforderungen an die Eigenmittel oder das gleichwertige regulatorische Eigenkapital bereitgestellte Mittel

9.1 Serviceentgelte für Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen

[…]

Das Entgelt für als Sicherheit gelieferte Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen ist je nach Währung, in der die Stellung von Eligiblen Margin-Vermögenswerten in Form von Geldbeträgen durch das Clearing-Mitglied erfolgt, festgelegt. Das jeweilige Entgelt beträgt demnach bei Geldbeträgen in:

CHF: 0,20 % p.a.

EUR: 0,20 % p.a.

GBP: 0,~~50~~ 20 % p.a.

USD: 0,50 % p.a.

Die Berechnung des Entgelts erfolgt act / 365 auf der Grundlage des Werts der auf dem Internen Margin-Konto (Kapitel I Abschnitt 2 Ziffer 4.2 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG), dem Segregierten Internen Margin-Konto (Kapitel I Abschnitt 3 Unterabschnitt A Ziffer 4.1.2 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG) und dem Internen Net Omnibus Margin-Konto (Kapitel I Abschnitt 4 Ziffer 4.2 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG) des Clearing-Mitglieds erfassten Eligiblen Margin-Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen.

Grundsätzlich behält sich ECAG vor, ein geringeres Entgelt zu erheben.

Wickelt das Clearing-Mitglied Zahlungen in EUR, CHF oder GBP gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 2.1.2 (4) (b) (ff) der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG über eine Abwicklungsbank ab, ist pro Clearing-Mitglied das untenstehende Entgelt zu entrichten.

Das Abwicklungsbank-Entgelt in Höhe von 0,001 % fällt monatlich auf die Gesamtbeträge an, die durch die Abwicklungsbank abgewickelt werden, um die Geldzahlungsverpflichtungen gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 1.4.1 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG zu erfüllen und richtet sich nach der jeweiligen Clearing~~W~~währung~~, in der diese Geldzahlungen geleistet werden~~ („Abwicklungsbank-Entgelt“). Der monatliche Mindestbetrag für das Abwicklungsbank-Entgelt (Untergrenze) liegt bei EUR 3.000 (gleichbedeutend mit CHF 3.300 oder GBP 2.400) pro Clearing-Mitglied und fällt bei Nutzung einer Abwicklungsbank für eine oder mehrere Währungen an mindestens einem Tag des entsprechenden Kalendermonats an.

[…]

****