clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 060/16

Datum: 4. Mai 2016
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

Eurex Clearing Prisma: Verkürzung der Halteperiode für die Aktien-Liquidationsgruppe PEQ01

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 086/15, 092/15

Kontakt: Risk Control, T +49-69-211-1 24 52, risk@eurexclearing.com

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ Alle Abteilungen	keine

Zusammenfassung:

Mit diesem Rundschreiben informiert Eurex Clearing über die Verkürzung der Halteperiode für zum Handel zugelassene Aktienderivate und Aktienindexderivate, die der Liquidationsgruppe PEQ01 zugeordnet sind. Eurex Clearing wird die Halteperiode von vier auf drei Tage verkürzen. Die Einführung der verkürzten Halteperiode in die Produktion ist für den **13. Juni 2016** vorgesehen.

Eurex Clearing hat die verkürzte Halteperiode für Liquidationsperiode PEQ01 bereits im Mai 2015 in der Simulation eingeführt, sodass Clearing-Mitglieder und Software-Vendoren ausreichend Zeit haben, die Unterstützung mehrerer Halteperioden zu testen.

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:
Heike Eckert (stv. Vorsitzende),
Matthias Graulich,
Thomas Laux,
Erik Tim Müller

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
USt-IdNr. DE194821553
Amtsgericht Frankfurt/Main

Eurex Clearing Prisma: Verkürzung der Halteperiode für die Aktien-Liquidationsgruppe PEQ01

Mit diesem Rundschreiben informiert Eurex Clearing über die Verkürzung der Halteperiode für zum Handel zugelassene Aktienderivate und Aktienindexderivate, die der Liquidationsgruppe PEQ01 zugeordnet sind. Eurex Clearing wird die Halteperiode von vier auf drei Tage verkürzen. Die Einführung der verkürzten Halteperiode in die Produktion ist für den 13. Juni 2016 vorgesehen.

Angesichts der mittlerweile mehr als dreijährigen Nutzung der Liquidationsgruppe PEQ01 in Produktion und basierend auf gemessenen Verbesserungen in den Risk- und Default Management-Prozessen hat Eurex Clearing beschlossen, die Halteperiode von vier auf drei Tage zu verkürzen. Diese Entscheidung ist in enger Abstimmung mit den Marktteilnehmern und nach Konsultation mit dem Risk Committee und Regulatoren getroffen worden.

Eurex Clearing hat die verkürzte Halteperiode für Liquidationsgruppe PEQ01 bereits im Mai 2015 in der Simulation eingeführt, sodass Clearing-Mitglieder und Software-Vendoren ausreichend Zeit haben, die Unterstützung mehrerer Halteperioden zu testen. Die Halteperiode von vier Tagen für Liquidationsgruppe PEQ02 in der Simulation wird unverändert mindestens bis zur Verkürzung der Halteperiode für Liquidationsgruppe PEQ01 in der Produktion beibehalten, sodass Clearing-Mitglieder und Software-Vendoren ausreichend Zeit zur Verfügung haben, um das derzeitige Set-up in der Produktion zu testen.

Übergang zur neuen Halteperiode in Produktion

In der Produktion wird die Halteperiode für zum Handel zugelassene Aktienderivate und Aktienindexderivate, die der Liquidationsgruppe PEQ01 zugeordnet sind, am Freitag, dem 10. Juni 2016 nach der Tagesendverarbeitung von vier auf drei Tage reduziert. Aus diesem Grund kann sich die Bereitstellung der Transparency Enabler (TE)-Dateien mit der Tagesanfangsverarbeitung am 11. Juni 2016 verzögern. Die TE-Dateien, die mit der Tagesendverarbeitung am 10. Juni 2016 bereitgestellt werden, sind nicht betroffen. Die reduzierte Halteperiode wird mit Handelsbeginn am Montag, dem 13. Juni 2016 wirksam.

Verfügbarkeit von Listen der für Prisma zulässigen und nicht zulässigen Produkte

Eurex Clearing stellt Listen aller für Prisma zulässigen und aller für Prisma nicht zulässigen Produkte zur Verfügung. Die Listen sind auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter den folgenden Links abrufbar:

Risikomanagement > Risikoparameter > Liquidationsgruppen

Risikomanagement > Risikoparameter > Nicht Prisma Zulässige Produkte

Beide Listen werden täglich aktualisiert.

Sollten Sie Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Risk Control unter Tel. +49-69-211-1 24 52 oder per E-Mail an: risk@eurexclearing.com.

4. Mai 2016