eurexbonds Rundschreiben 11/14

Datum: 28. Februar 2014
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Bonds
Autorisiert von: Dr. Johannes Weßling

Dänisches Segment an Eurex Bonds: Zulässige Handelsplattform für dänische „Primary Dealers“, erforderliche Formulare für die Teilnahme, aufgesetzte Instrumente, Entgelte sowie Überblick der Feiertage in Handel und Abwicklung für 2014

Verweis auf Eurex Bonds-Rundschreiben: 051/13

Kontakt: Eurex Bonds Customer Support, T +49-69-211-1 12 22

Zielgruppe:	**Anhang:**
Ü Front Office/Handel Ü Middle + Back Office Ü IT/System Administration	(nur in Englisch) Reference Data Sheet for Eurex Bonds

Zusammenfassung:

Dieses Rundschreiben liefert Details zum dänischen Segment an Eurex Bonds: Erforderliche Formulare für die Teilnahme am Handel, verfügbare Instrumente, Entgelte und einen Überblick über die Feiertage im Handel und in der Abwicklung im Jahr 2014.

Eurex Bonds GmbH
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn

Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main

Kontakt:
T +49-69-211-1 12 22
F +49-69-211-1 70 03
info@eurex-bonds.com

Geschäftsführer:
Dr. Johannes Weßling,
Marcel Naas

GmbH
mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 49370
Amtsgericht Frankfurt/Main
USt Id 04523253333

Dänisches Segment an Eurex Bonds: Zulässige Handelsplattform für dänische „Primary Dealers“, erforderliche Formulare für die Teilnahme, aufgesetzte Instrumente, Entgelte sowie Überblick der Feiertage in Handel und Abwicklung für 2014

Seit dem 1. Januar 2014 ist Eurex Bonds eine zulässige Handelsplattform für dänische „Primary Dealers“. Seit diesem Datum können alle Handelsteilnehmer der Eurex Bonds, die auch dänische „Primary Dealers“ sind, auch an Eurex Bonds Quotes stellen und damit ihre Quotierungsverpflichtungen erfüllen.

Erforderliche Formulare für die Teilnahme

Für die Teilnahme am Handel im dänischen Segment müssen bereits zugelassenen Handelsteilnehmer der Eurex Bonds folgende Formulare für die Produktion und die Simulation einreichen:

Reference Data Sheet for Eurex Bonds (nur in Englisch)

Bitte geben Sie in diesem Formular unter „Required statement: For security settlement“ die Kontodaten für VP Securities A/S an. Dieses Formular ist diesem Rundschreiben angehängt.

Antrag auf Einrichtung/Löschung/Änderung von Wertpapierdepots und Clearer-Geldkonten

Bitte geben Sie in diesem Formular im Abschnitt 3.2 „Buy-in Cash Account“ die Nummern des Buy-in-Kontos für Dänische Kronen (DKK) an.

Antrag auf Einrichtung/Löschung/Änderung von CCP-Settlement-Konten in Dänemark (VP Securities A/S)

Dieses Formular muss vollständig ausgefüllt werden.

Die beiden letztgenannten Formulare können von der Website der Eurex Clearing www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link heruntergeladen werden:

Ressourcen > Formulare > Clearing Repo & Bonds > Rechtlich & Regulatorisch

Instrumente

Für den Handel von Anleihen mit Währung Dänische Krone sind zwei Instrumentengruppen aufgesetzt worden: GODK für Staatsanleihen in dänischen Kronen und CBDK für gedeckte Schuldverschreibungen (Covered Bonds) in dänischen Kronen.

Nachdem die oben genannten Formulare eingereicht wurden, muss der jeweilige Member Supervisor die Instrumentengruppen GODK und CBDK den entsprechenden Händlergruppen zuweisen (über das Subgroup Maintenance-Fenster), um den Handel in Anleihen in dänischen Kronen zu ermöglichen. Alle zugelassenen Staatsanleihen und Covered Bonds in dänischen Kronen werden diesen Instrumentengruppen zugeordnet.

Alle Handelsteilnehmer der Eurex Bonds können den Handel in ausgewählten Anleihen mit Währung Dänische Krone in der Eurex Bonds-Simulationsumgebung testen. Die Instrumentengruppen GODK und CBDK wurden bereits in der Simulationsumgebung aufgesetzt, entsprechend der Produktionsumgebung.

Entgelte

Für bereits zugelassene Eurex Bonds-Handelsteilnehmer fällt für das dänische Segment kein zusätzliches Jahresentgelt an.

Für neue Eurex Bonds-Handelsteilnehmer, die ausschließlich im dänischen Segment handeln, wird ein Jahresentgelt von EUR 5.000 berechnet.

Die Handelsentgelte sind wie folgt (pro Million Nominalwert):

Kein Aggressor	Aggressor
EUR -15	EUR 25

Abwicklung

Handelsteilnehmer der Eurex Bonds können dänische Anleihen auf zwei verschiedenen Wegen abwickeln:

1. direkte Abwicklung beim lokalen dänischen Zentralverwahrer (CSD) VP Securities A/S oder
2. über einen Dritten, z. B. einen internationalen Zentralverwahrer (ICSD), der eine Verbindung zu VP Securities A/S unterhält.

Feiertage in Handel und Abwicklung für das dänische Segment im Jahr 2014

Feiertage im Handel	
Neujahr	1. Januar 2014
Gründonnerstag	17. April 2014
Karfreitag	18. April 2014
Ostermontag	21. April 2014
Tag der Arbeit	1. Mai 2014
„Prayer Day“	16. Mai 2014
Christi Himmelfahrt	29. Mai 2014
Brückentag nach Christi Himmelfahrt	30. Mai 2014
„Constitution Day”	6. Juni 2014
Pfingstmontag	9. Juni 2014
Heiligabend	24. Dezember 2014
1. Weihnachtsfeiertag	25. Dezember 2014
2. Weihnachtsfeiertag	26. Dezember 2014
Silvester	31. Dezember 2014

Feiertage in der Abwicklung	
Neujahr	1. Januar 2014
Gründonnerstag	17. April 2014
Karfreitag	18. April 2014
Ostermontag	21. April 2014
„Prayer Day“	16. Mai 2014
Christi Himmelfahrt	29. Mai 2014
Brückentag nach Christi Himmelfahrt	30. Mai 2014
„Constitution Day”	6. Juni 2014
Pfingstmontag	9. Juni 2014
Heiligabend	24. Dezember 2014
1. Weihnachtsfeiertag	25. Dezember 2014
2. Weihnachtsfeiertag	26. Dezember 2014
Silvester	31. Dezember 2014

Sollten Sie Fragen haben, wenden Sie sich bitte an den Eurex Bonds Customer Support unter Tel. +49-69-211-1 12 22 oder senden Sie eine E-Mail an info@eurex-bonds.com.

28. Februar 2014