clear to trade

e u r e x c l e a r i n g
rundschreiben 056/10

Datum: Frankfurt, 30. Juli 2010
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Bonds GmbH, alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz

In US-Dollar emittierte Anleihen: Einführung für den Handel auf Eurex Bonds

Verweis auf Eurex Bonds-Rundschreiben: 44/10

Kontakt: Member Services & Admission Team, Tel. +49-69-211-1 17 00, Fax +49-69-211-1 17 01

Zielgruppe:	**Anhänge:**
Ü Front Office/Handel Ü Middle + Backoffice	1. Eurex Bonds: Liste der eingeführten USD-Anleihen 2. Angepasstes Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG

Ab dem **16. August 2010** startet Eurex Clearing mit dem Clearing von in US-Dollar lautenden Anleihen von Eurex Bonds. Zunächst werden in US-Dollar emittierte Anleihen des Bundes, der Kreditanstalt für Wiederaufbau, der European Investment Bank und der Landwirtschaftlichen Rentenbank eingeführt.

Eurex Clearing- und Eurex Bonds-Teilnehmer, die Eurex Bonds ein US-Dollar-Abwicklungskonto bekannt gegeben haben, sind berechtigt, die in US-Dollar emittierten Anleihen jeweils zu verrechnen und zu handeln.

Die neuen Anleihenprodukte werden in die existierenden Clearing-Prozesse für Anleihen integriert. Das „DvP/RvP Settlement“ der Anleihen wird bei Clearstream Banking, Luxemburg und Euroclear Bank, Brüssel, stattfinden.

Für die Abwicklung der entsprechenden Anleihen bei Clearstream Banking Luxemburg stehen die Kundenkonten wie auch die 6-er Konten (Clearstream Banking Frankfurt International) zur Verfügung.

Die Clearing-Entgelte für die neuen Anleihenprodukte entsprechen den bestehenden Entgelten für Eurex Bonds-Produkte.

Die Simulation ist in der permanenten CCP-Simulationsumgebung gemäß dem Simulationskalender möglich: www.eurexchange.com > Member Section > Simulation > CCP Standard Simulation.

Weitere Details finden Sie im Eurex Bonds-Rundschreiben 44/10.

Bitte leiten Sie diese Produktankündigung an alle beteiligten Abeilungen Ihres Unternehmens weiter.

Eurex Clearing AG
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
customer.support@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Prof. Dr. Peter Gomez

Vorstand:
Andreas Preuß (Vorsitzender), Jürg Spillmann, Thomas Book, Gary Katz, Michael Peters, Peter Reitz

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
Amtsgericht Frankfurt/Main

Eurex Bonds: Liste der eingeführten USD-Anleihen

Issuer	CCY	ISIN	Issue Date	Maturity
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0204937394	10-Nov-04	15-Dez-11
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0491677257	03-Mrz-10	16-Apr-12
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0225513703	26-Jul-05	15-Okt-12
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0205179483	12-Nov-04	14-Dez-12
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0252479497	28-Apr-06	15-Mai-13
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0271449000	18-Okt-06	15-Okt-13
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0287792914	23-Feb-07	15-Apr-14
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0322956490	26-Sep-07	15-Okt-14
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0347750365	28-Feb-08	15-Apr-15
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0468848253	24-Nov-09	15-Dez-16
EUROPEAN INVESTMENT BANK	USD	XS0070553820	06-Nov-96	06-Nov-26
FEDERAL REP OF GERMANY	USD	DE0001030120	21-Sep-09	21-Sep-12
KFW	USD	XS0390571585	01-Okt-08	15-Nov-10
KFW	USD	XS0187485098	09-Mrz-04	09-Mrz-11
KFW	USD	XS0469005887	24-Nov-09	23-Nov-11
KFW	USD	XS0172289604	15-Jul-03	15-Dez-11
KFW	USD	XS0215165209	17-Mrz-05	14-Dez-12
KFW	USD	XS0250875266	12-Apr-06	28-Mrz-13
KFW	USD	XS0431157584	28-Mai-09	28-Mai-13
KFW	USD	XS0292406476	20-Mrz-07	15-Mai-14
KFW	USD	XS0273786847	03-Nov-06	31-Okt-14
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	USD	XS0384563424	26-Aug-08	29-Okt-10
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	USD	XS0183647949	21-Jan-04	21-Jan-11
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	USD	XS0358293693	16-Apr-08	16-Apr-12
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	USD	XS0231018663	06-Okt-05	15-Jan-13
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	USD	XS0245900203	03-Mrz-06	15-Feb-13
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	USD	XS0281916931	11-Jan-07	10-Jan-14
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	USD	XS0339494303	15-Jan-08	02-Feb-15

Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

4 Transaktionsentgelte Eurex Bonds GmbH

Für Transaktionen gemäß Kapitel I Ziffer 1.5.2 der Clearing-Bedingungen im Zusammenhang mit Geschäften an der Eurex Bonds GmbH gemäß Kapitel III Ziffer 2.1 der Clearing-Bedingungen („Eurex Bonds-Geschäfte“) erhebt die ECAG Entgelte für die Regulierung von Geschäften und Positionen wie folgt:

Transaktionsvolumen pro Monat in Mio.:	**Entgelt ~~in EUR vom~~berechnet auf Grundlage des Nominalwertes:**
≤ 2.000	**0,00050 %**
> 2.000 ≤ 4.000	**0,00025 %**
> 4.000	**0,00002 %**

[…]

12 Fälligkeit

(1) Die für die Clearing-Mitgliedschaft zu zahlenden Entgelte gemäß Ziffer 1 werden wie folgt zur Zahlung fällig:

a) Das Aufnahmeentgelt gemäß Ziffer 1 Abs. (1) lit. a) wird mit Erteilung der Clearing-Mitgliedschaft zur Zahlung fällig.

b) Das jährliche Entgelt gemäß Ziffer 1 Abs. (1) lit. b) ist jeweils bis zum Ultimo des Monats Januar zahlbar.

Erfolgt die Erteilung der Clearing-Mitgliedschaft nach dem ersten Quartal eines Kalenderjahres, wird das jährliche Entgelt für dieses Jahr anteilig unter Zugrundelegung der verbleibenden Quartale, inklusive des Quartals der Zulassung berechnet; das Entgelt ist insoweit nach Rechnungseingang zur Zahlung fällig.

Wird die Clearing Lizenz vom Clearing Mitglied zurückgegeben, erstattet die ECAG das Entgelt für das laufende Jahr anteilig. Dabei wird der Anteil des Entgeltes gutgeschrieben, welcher auf die dem Zeitpunkt der Rückgabe folgenden Quartale entfällt.

(2) Die Anbindungsentgelte gemäß Ziffer 2 sind nach Rechnungseingang zur Zahlung fällig.

(3) Die Transaktions- bzw. Serviceentgelte gemäß Ziffer 3bis Ziffer 9 sind jeweils am dritten Börsentag des auf die jeweilige Transaktion bzw. auf die Inanspruchnahme des jeweiligen Services folgenden Kalendermonats zur Zahlung fällig.

(4) Transaktionsentgelte gemäß Ziffer 5, Ziffer 6 und Ziffer 9 in den Währungen SEK, JPY, AUD und CAD werden dem Clearing-Mitglied in EUR, USD, CHF oder GBP in Rechnung gestellt. Das Clearing-Mitglied ist verpflichtet, die Währung mitzuteilen, in welcher die Transaktionsentgelte in Rechnung gestellt werden sollen (Rechnungswährung). Die Rechnungswährung kann von dem Clearing-Mitglied jederzeit geändert werden. Bei Rechnungsstellung wird die Rechungswährung berücksichtigt, die das Clearing-Mitglied bis zum letzten Kalendertag des Rechnungsmonats mitgeteilt hat. Teilt das Clearing-Mitglied keine Rechnungswährung mit, ist die ECAG berechtigt, die Rechnung in EUR, USD, CHF oder GBP zu stellen.

Transaktionsentgelte gemäß Ziffer 3.10, Ziffer 4, Ziffer 5, Ziffer 6 und Ziffer 9 in den Währungen USD und GBP können dem Clearing-Mitglied auch in der von ihm gewünschten Rechnungswährung in Rechnung gestellt werden, sofern das Clearing-Mitglied dies ausdrücklich angibt.

[…]