



e u r e x information

Datum: Frankfurt, 23. Dezember 2004
Empfänger: Alle Eurex-Mitglieder und Vendoren, CCP-Teilnehmer
Autorisiert von: Axel Birk

Information bezüglich des Übergangs zum ab 1. Januar 2005 geltenden CCP-Preismodell

Kontakt: Customer Support, Tel. +49-69-211-1 17 00, Fax +49-69-211-1 17 01

Zielgruppe:

- ➡ Middle + Back Office
- ➡ Revision / Security Coordination

Anhänge:

keine

Im Rahmen des Übergangs zum neuen CCP-Preismodell wird der automatisierte Fakturierungs- und Berichtsprozess durch eine manuelle Verarbeitung ergänzt, um eine vollständige und zugleich überschneidungsfreie Entgeltberechnung zu gewährleisten.

Hintergrund ist, dass gemäß aktuellem CCP-Preismodell die Berechnung der Clearing-Entgelte zum Zeitpunkt der ersten Abwicklung stattfindet. Dagegen erfolgt ab 1. Januar 2005 die Berechnung der Clearing-Entgelte bereits zum Zeitpunkt T+1. Hierdurch würden die Clearing-Entgelte für Geschäfte, deren Zeitpunkt T+1 noch im alten Jahr liegt und deren erste Abwicklung im neuen Jahr erfolgt, nicht berücksichtigt.

Für diese Geschäfte wird die Berechnung der Clearing-Entgelte analog des heute bestehenden Verfahrens zum Zeitpunkt der ersten Abwicklung im neuen Jahr auf Basis des dann gültigen neuen Preismodells erfolgen. Die entsprechenden Entgelte werden den Clearing-Teilnehmern in einem zusätzlichen Anschreiben mit beigefügtem Report mitgeteilt und im Januar 2005 belastet.