

Kapitel II der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

Transaktionen an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

(Eurex-Börsen)

Stand 09.01.2017

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 09.01.2017
	Seite 1

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:
 ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN
 LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 2 Clearing von Futures-Kontrakten

Die nachfolgenden Bestimmungen regeln das Clearing von Transaktionen in den in Ziffer 1 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Futures-Kontrakte („**Eurex-Kontraktsspezifikationen**“).

[...]

2.3 Clearing von Fixed Income Futures-Kontrakten

Die nachfolgenden Bestimmungen regeln das Clearing von Transaktionen in den in Ziffer 1.2 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Fixed Income Futures-Kontrakte.

2.3.1 Verfahren bei Lieferung und Zahlung

Alle stückemäßigen Lieferungen sowie Zahlungen erfolgen Zug um Zug direkt zwischen den Clearing-Mitgliedern und der Eurex Clearing AG am zweiten Geschäftstag nach dem Anzeigetag (Ziffer 2.3.4 Abs. (2)) und an diesem Tag innerhalb des von der Eurex Clearing AG festgelegten Abwicklungsfensters.

Hierbei werden die Forderungen aus Wertpapiertransaktionen (wie in Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 1.3 definiert) über eine Abwicklungsstelle und die Zahlung über das entsprechende von der betreffenden Abwicklungsstelle festgelegte Konto abgewickelt.

Jedes Clearing-Mitglied und die Eurex Clearing AG haben sicherzustellen, dass die Transaktion an dem Geschäftstag im Brutto Liefermanagement gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 1.4.2 Abs~~atz~~- (2) und Ziffer 1.3.1 Abs~~atz~~- (1) (b) – (e) bearbeitet werden kann, an dem die Lieferanzeige erfolgte. Alle Clearing-Mitglieder haben ihre Liefer- und Zahlungsfähigkeit durch entsprechende Bestände (i) im Depot bei der jeweiligen Verwahrstelle und (ii) Guthaben auf dem RTGS-Konto oder dem euroSIC-Konto für Euro-Fixed Income Futures-Kontrakte und (iii) auf dem SIC-Konto für CONF-Futures Kontrakte sicherzustellen.

[...]
