clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 088/11

Datum: 15. November 2011
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

Vertragsstrafenregelung für die verspätete Belieferung von EUR-/CHF-Fixed Income Futures: Änderung der Clearing-Bedingungen

Kontakt: Eurex Clearing Operations Helpdesk, Tel. +49-69-211-1 12 50,
E-Mail: clearing@eurexchange.com

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- Revision/Security Coordination

Anhang:
Aktualisierte Abschnitte der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

Die Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG („Clearing-Bedingungen“) werden in Bezug auf die Vertragsstrafenregelung für die verspätete Belieferung von EUR-/CHF-Fixed Income Futures mit Wirkung zum **30. November 2011** geändert.

Die entsprechenden Änderungen in den Clearing-Bedingungen betreffen die Referenzzinssätze bei der verspäteten Belieferung von CHF-Fixed Income Futures. Der derzeitige Satz der Spitzenrefinanzierungs-fazilität der Europäischen Zentralbank wird durch den Satz der Engpassfinanzierungsfazilität der Schweizerischen Nationalbank ersetzt.

Im Anhang befinden sich die geänderten Abschnitte der Clearing-Bedingungen.

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an das Eurex Clearing Operations Helpdesk unter Tel. +49-69-211-1 12 50, Fax +49-69-211-1 12 51 oder E-Mail: clearing@eurexchange.com.

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

Kapitel II
Geschäfte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich (Eurex-Börsen)

[…]

Abschnitt 2
Clearing von Futures-Kontrakten

[…]

2.3 Teilabschnitt Clearing von Fixed Income Futures-Kontrakten

[…]

2.3.5 Nichtlieferung

[…]

(4) Liefert das Clearing-Mitglied die von ihm zu liefernden Schuldverschreibungen nicht am Liefertag, zahlt das Clearing-Mitglied, das gegen seine Lieferpflicht verstoßen hat, der Eurex Clearing AG eine Entschädigung für den Zeitraum ab dem Lieferungstag (einschließlich) bis zum (a) Tag der tatsächlichen Lieferung (ausschließlich) oder (b) dem Tag eines Ersatzkaufes (ausschließlich) (wobei auf den jeweils früheren Termin abzustellen ist) in folgender Höhe:

- bei Euro-Fixed Income Futures-Kontrakten: 0,40 Prozent vom Nominalwert der ausstehenden Lieferung pro Geschäftstag, liefert das säumige Clearing-Mitglied geschuldete Schuldverschreibungen der Bundesrepublik Deutschland am Liefertag im zweiten Same Day Settlement-Buchungslauf der Clearstream Banking AG, reduziert sich die vorgenannte Vertragsstrafe auf 0,04 Prozent vom Nominalwert der ausstehenden Lieferung; oder

- bei CONF Futures Kontrakten: 0,85 Prozent vom Nominalwert der ausstehenden Lieferung pro Geschäftstag,

in beiden Fällen jeweils zuzüglich eines Betrages pro Kalendertag der gemäß dem von der Eurex Clearing AG im Voraus festzulegenden und bekannt zu gebenden Prozentsatz des Gegenwerts der zur Lieferung angezeigten Schuldverschreibungen berechnet wird; der Prozentsatz orientiert sich ~~am Satz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der Europäischen Zentralbank zuzüglich 100 Basispunkte, wie auf der Internetseite http://www.bundesbank.de/eurosystem/eurosystem_ezb.php veröffentlicht.~~

- bei Euro-Fixed Income Futures-Kontrakten am Satz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der Europäischen Zentralbank zuzüglich 100 Basispunkte,
- bei CONF Futures Kontrakten am Satz der Engpassfinanzierungsfazilität der Schweizerischen Nationalbank zuzüglich 100 Basispunkte.

Die vorgenannten Zinssätze werden auf den Internetseiten der Europäischen Zentralbank und der Schweizerischen Nationalbank veröffentlicht.

Zur Klarstellung sei angemerkt, dass die Bestimmungen dieser Ziffer 2.3.5 Absatz (4) zusätzlich zu Kapitel I Ziffer 13.2.

(5) Die Geltendmachung eines weiteren Schadens sowohl der Eurex Clearing AG als auch des nicht fristgerecht belieferten Clearing-Mitglieds bleibt unberührt.

[…]