****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

9. Serviceentgelte für Sicherheiten, Beiträge zum Ausfallfonds und zur Erfüllung der Anforderungen an die Eigenmittel oder das gleichwertige regulatorische Eigenkapital bereitgestellte Mittel

9.1 Serviceentgelte für Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen

Für als Sicherheit gelieferte Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen wird ein Entgelt erhoben. Das Entgelt wird auf sämtliche durch Clearing-Mitglieder gelieferte Eligible Margin–Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen erhoben.

Das Entgelt für als Sicherheit gelieferte Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen ist je nach Währung, in der die Stellung von Eligiblen Margin-Vermögenswerten in Form von Geldbeträgen durch das Clearing-Mitglied erfolgt, festgelegt. Das jeweilige Entgelt beträgt demnach bei Geldbeträgen in:

CHF: 0,20 % p.a.

EUR: 0,20 % p.a.

GBP: 0,20 % p.a.

USD: 0,50 % p.a.

Die Berechnung des Entgelts erfolgt act / 365 auf der Grundlage des Werts der auf dem internen Margin-Konto des Clearing-Mitglieds/Basis-Clearing-Mitglieds~~/ OTC-IRS-FCM-Clearing-Mitglieds~~ erfassten Eligiblen Margin-Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen.

Die Eurex Clearing AG gewährt einen Rabatt i.H.v. 50 Prozent auf das Entgelt für als Sicherheit gelieferte Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen für Eurex-Transaktionen, die auf Konten innerhalb einer RK-Transaktionskontengruppe, ~~oder~~ einer SK-Transaktionskontengruppe, einer ICM SK-Transaktionskontengruppe oder auf einem ICM-Transaktionskonto eines Registrierten Kunden gebucht sind. Voraussetzung für die Gewährung des Rabatts ist, dass das jeweilige Clearing-Mitglied ein separates internes Margin-Konto bei der Eurex Clearing AG eröffnet hat und diesem die Konten der jeweiligen RK-Transaktionskontengruppe und/oder SK-Transaktionskontengruppe zum Zwecke der Berechnung des Rabatts zugeordnet hat

(solch ein Konto im Folgenden „**ETD Collateral Incentive Pool**“ genannt). Der Rabatt wird auch gewährt auf das Entgelt für als Sicherheit gelieferte Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen für OTC-Zinsderivat-Transaktionen, die auf Konten innerhalb einer RK-Transaktionskontengruppe, ~~oder~~ einer SK-Transaktionskontengruppe, einer ICM SK-Transaktionskontengruppe oder auf einem ICM-Transaktionskonto eines Registrierten Kunden gebucht sind, vorausgesetzt der jeweilige Registrierte Kunde oder Spezifizierte Kunde schließt Eurex-Transaktionen unter derselben Kundenkennung/jeweils in demselben Konto ab und beide Transaktionsarten, Eurex Transaktionen und OTC-Zinsderivat-Transaktionen, sind demselben ETD Collateral Incentive Pool zugewiesen. Zur Klarstellung: Unter diesen Voraussetzungen ist es abweichend von Kapitel I Abschnitt 2 Unterabschnitt C Nummer 4.2 (iii) der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG zulässig, dass eine einzelne~~s~~ RK-Transaktionskontengruppe~~Eigenkonto~~ oder SK-Transaktionskontengruppe~~Konto~~ oder ein Transaktionskonto innerhalb dieser Transaktionskontengruppen als einzige Transaktionskontengruppe/einiges Transaktionskonto einem internen Margin-Konto zugewiesen wird.

Grundsätzlich behält sich ECAG vor, ein geringeres Entgelt zu erheben.

Wickelt das Clearing-Mitglied Zahlungen in EUR oder CHF gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 2.1.2 (4) (b) (ff) der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG über eine Abwicklungsbank ab, ist pro Clearing-Mitglied das untenstehende Entgelt zu entrichten.

Das Abwicklungsbank-Entgelt in Höhe von 0,001 % fällt monatlich auf die Gesamtbeträge an, die durch die Abwicklungsbank abgewickelt werden, um die Geldzahlungsverpflichtungen gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 1.4.1 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG zu erfüllen und richtet sich nach der jeweiligen Clearingwährung („Abwicklungsbank-Entgelt“). Der monatliche Mindestbetrag für das Abwicklungsbank-Entgelt (Untergrenze) liegt bei EUR 3.000 (gleichbedeutend mit CHF 3.300) pro Clearing-Mitglied und fällt bei Nutzung einer Abwicklungsbank für eine oder mehrere Währungen an mindestens einem Tag des entsprechenden Kalendermonats an.

9.2 Serviceentgelte für Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Wertpapieren

Für als Sicherheit gelieferte Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Wertpapieren und Wertrechten wird täglich in der jeweiligen Clearingwährung ein Entgelt in Höhe von 0,05 % p.a. berechnet, wenn das Verhältnis von Eligiblen Margin-Vermögenswerten in Form von Geldbeträgen zu den Margin-Verplichtungen gleich oder größer ist als 30:100, 0,075 % p.a., wenn das Verhältnis von Eligiblen Margin-Vermögenswerten in Form von Geldbeträgen zu den Margin-Verpflichtungen zwischen 20:100 und 29,99:100 liegt, und 0,10 % p.a. zzgl. einer Konzentrationszugabe von 0,10 Prozent p.a., wenn das Verhältnis von Eligiblen Margin-Vermögenswerten in Form von Geldbeträgen zu den Margin-Verpflichtungen zwischen 0:100 und 19,99:100 liegt.

Folgendes ist nicht Bestandteil der Berechnungsgrundlage, es werden also keine Entgelte erhoben für:

a. auf den Margin-Konten erfasste Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Wertpapieren und Wertrechten, deren Lieferung nicht zur Erfüllung der jeweiligen Margin-Verpflichtung erforderlich ist,

b. für OTC-Zinsderivat-Transaktionen festgelegte Margin-Verpflichtungen in Bezug auf ein ICM-Transaktionskonto eines Registrierten Kunden oder Konten innerhalb einer RK-Transaktionskontengruppe, einer ICM SK-Transaktionskontengruppe oder einer SK-Transaktionskontengruppe, vorausgesetzt dass (i) auf jedem dieser Konten ausschließlich OTC-Zinsderivat-Transaktionen gebucht sind und (ii) das jeweilige Clearing-Mitglied ein separates internes Margin-Konto bei der Eurex Clearing AG eröffnet hat und diesem die Konten der jeweiligen SK-Transaktionskontengruppe zum Zwecke der Berechnung des Rabatts zugeordnet hat (OTC Collateral Incentive Pool). Zur Klarstellung: Unter diesen Voraussetzungen ist es abweichend von Kapitel I Abschnitt 2 Unterabschnitt C Nummer 4.2 (iii) der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG zulässig, dass eine einzelnes SK-TransaktionskontengruppeKonto oder ein Transaktionskonto innerhalb dieser Transaktionskontengruppe als einzige Transaktionskontengruppe/einziges Transaktionskonto einem internen Margin-Konto zugewiesen wird.

Die Eurex Clearing AG gewährt einen Rabatt i.H.v. 50 Prozent auf das Entgelt für als Sicherheit gelieferte Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Wertpapieren und Wertrechten, die auf einem Basis-Clearing-Mitglied Eigenkontoen (wie in Kapitel I Abschnitt 65 Ziffer 5.1 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG definiert) und für Eurex Transaktionen und OTC-Zinsderivat-Transaktionen auf Konten innerhalb einer RK-Transaktionskontengruppe, einer ICM SK-Transaktionskontengruppe oder einer SK-Transaktionskontengruppe oder auf einem ICM-Transaktionskonto eines Registrierten Kunden gebucht sind. Voraussetzung für die Gewährung des Rabatts ist, dass das jeweilige Clearing-Mitglied den ETD Collateral Incentive Pool eröffnet hat. Zur Klarstellung: Unter diesen Voraussetzungen ist es abweichend von Kapitel I Abschnitt 2 Unterabschnitt C Nummer 4.2 (iii) der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG zulässig, dass eine einzelnes RK-TransaktionskontengruppeEigenkonto oder SK-Transaktionskontengruppe Konto oder ein Transaktionskonto innerhalb dieser Transaktionskontengruppen als einzige Transaktionskontengruppe/einziges Transaktionskonto einem internen Margin-Konto zugewiesen wird.

Für als Sicherheit gelieferte Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Wertpapieren und Wertrechten, die über die GC Pooling Reuse-Funktion geliefert werden, wird täglich in der jeweiligen Clearingwährung ein Entgelt in Höhe von 0,03 % p.a. berechnet. Die Berechnung des Entgelts erfolgt act / 365 auf der Grundlage des Werts der auf dem internen Margin-Konto des Clearing-Mitglieds/Basis-Clearing-Mitglieds/OTC-IRS-FCM-Clearing-Mitglied zur Erfüllung der Margin-Verpflichtung erfassten Eligiblen Margin-Vermögenswerte in Form von Wertpapieren und Wertrechten.

9.3 Für als Sicherheit gelieferte Eligible Margin-Vermögenswerte in Form von Wertpapieren und Wertrechten, die über die GC Pooling Reuse-Funktion geliefert werden, wird täglich in der jeweiligen Clearingwährung ein Entgelt in Höhe von 0,03 % p.a. berechnet. Die Berechnung des Entgelts erfolgt act / 365 auf der Grundlage des Werts der auf dem internen Margin-Konto des Clearing-Mitglieds/Basis-Clearing-Mitglieds/OTC-IRS-FCM-Clearing-Mitglied zur Erfüllung der Margin-Verpflichtung erfassten Eligiblen Margin-Vermögenswerte in Form von Wertpapieren und Wertrechten. Serviceentgelte für den untertägigen Austausch von Eligiblen Margin-Vermögenswerten.

Gemäß den von der ECAG festgelegten Spezifikationen für den untertägigen Austausch von als Sicherheit gelieferten Eligible Margin-Vermögenswerten in Form von Geldbeträgen durch Eligible Margin-Vermögenswerten in Form von Wertpapieren oder Wertrechten bzw. den untertägigen Austausch von als Sicherheit gelieferten Eligible Margin-Vermögenswerten in Form von Wertpapieren oder Wertrechten durch Eligible Margin-Vermögenswerten in Form von anderen Wertpapieren oder Wertrechten, berechnet die ECAG ein Serviceentgelt in Höhe von EUR 50,00 bzw. CHF 80,00 pro Austausch.

Die entsprechenden Serviceentgelte werden ohne Umsatzsteuer berechnet.

9.4 Serviceentgelte für Beiträge zum Ausfallfonds

Für Beiträge zum Ausfallfonds in Form von Geldbeträgen gelten die Regelungen der Ziffer 9.1 entsprechend mit der Maßgabe, dass keine Rabatte gewährt werden.

Für Beiträge zum Ausfallfonds in Form von Wertpapieren gelten die Regelungen der Ziffer 9.2 entsprechend mit der Maßgabe, dass keine Rabatte gewährt werden. Die Berechnung des Entgelts act / 365 erfolgt dabei auf der Grundlage des Werts aller auf dem internen Ausfallfonds-Konto erfassten Beiträgen in Form von Wertpapieren und Wertrechten (d.h. einschließlich eines Überschussbeitrages) und anstelle des Verhältnisses von Eligiblen Margin-Vermögenswerten in Form von Geldbeträgen zu der Margin-Verpflichtung ist das Verhältnis der Beiträge in Form von Geldbeträgen zur jeweiligen Beitragspflicht zum Ausfallfonds maßgeblich.

9.5 Serviceentgelte für zur Erfüllung der Anforderungen an die Eigenmittel oder das gleichwertige regulatorische Eigenkapital bereitgestellte Mittel

Für zur Erfüllung der Anforderungen an die Eigenmittel oder das gleichwertige regulatorische Eigenkapital bereitgestellte Mittel in Form von Geldbeträgen gelten die Regelungen der Ziffer 9.1 entsprechend mit der Maßgabe, dass keine Rabatte gewährt werden.

Für zur Erfüllung der Anforderungen an die Eigenmittel oder das gleichwertige regulatorische Eigenkapital bereitgestellte Mittel in Form von Wertpapieren werden keine Serviceentgelte erhoben.

[…]

****