clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 092/16

Datum: 11. Juli 2016
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder, Nicht-Clearing-Mitglieder und Registrierte Kunden der Eurex Clearing AG sowie Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

Optimierung der Cash Management-Infrastruktur von Eurex Clearing

Kontakt: Group Client Services & Administration, T +49-69-211-1 17 00, memberservices@eurexclearing.com

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhänge:

1. Geänderte Abschnitte der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG
2. Geänderte Abschnitte des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG

Zusammenfassung:

Dieses Rundschreiben enthält Informationen hinsichtlich der Zahlungsinfrastruktur der Eurex Clearing zur Verarbeitung von Clearing-bezogenen Zahlungen und damit zusammenhängenden Änderungen in den Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG (Clearing-Bedingungen) und im Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG (Preisverzeichnis) in Bezug auf folgende Themen:

1. Änderung der allgemeinen Voraussetzungen für die Erteilung einer Clearing-Lizenz betreffend Geldkonten und die Einführung von Britischen Pfund als Clearing-Währung.
2. Reaktivierung der „Permanent Cash Balance“-Funktionalität für Britische Pfund.
3. Einführung eines „Abwicklungsbank-Entgeltes“ für Clearing-bezogene Geldzahlungen in Clearing-Währungen.

Die geänderten Abschnitte der Clearing-Bedingungen und des Preisverzeichnisses, wie durch den Vorstand der Eurex Clearing beschlossen, befinden sich im Anhang zu diesem Rundschreiben.

Alle Änderungen treten am **2. August 2016** in Kraft.

Optimierung der Cash Management-Infrastruktur von Eurex Clearing

Dieses Rundschreiben enthält Informationen hinsichtlich der Zahlungsinfrastruktur der Eurex Clearing zur Verarbeitung von Clearing-bezogenen Zahlungen und damit zusammenhängenden Änderungen in den Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG (Clearing-Bedingungen) und im Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG (Preisverzeichnis) in Bezug auf folgende Themen:

1. Änderung der allgemeinen Voraussetzungen für die Erteilung einer Clearing-Lizenz betreffend Geldkonten und die Einführung von Britischen Pfund als Clearing-Währung.
2. Reaktivierung der „Permanent Cash Balance"-Funktionalität für Britische Pfund.
3. Einführung eines „Abwicklungsbank-Entgeltes" für Clearing-bezogene Geldzahlungen in Clearing-Währungen.

Die geänderten Abschnitte der Clearing-Bedingungen und des Preisverzeichnisses, wie durch den Vorstand der Eurex Clearing beschlossen, befinden sich im Anhang zu diesem Rundschreiben.

Alle Änderungen treten am 2. August 2016 in Kraft.

1. Änderung der allgemeinen Voraussetzungen für die Erteilung einer Clearing-Lizenz betreffend Geldkonten und Einführung von Britischen Pfund als Clearing-Währung

Gegenwärtig verlangt Eurex Clearing, dass jedes Clearing-Mitglied zur Abwicklung aller mit dem Clearing verbundenen Geldzahlungen Zugriff auf ein Zentralbankkonto hat: Für Geldzahlungen in Euro ist ein Zugriff auf ein TARGET2-Konto bei einer Zentralbank des Eurosystems, die an TARGET2 teilnimmt, erforderlich; für Geldzahlungen in Schweizer Franken ist ein Zugriff auf ein Konto bei der SIX Interbank Clearing AG (SIC) bei der Schweizerischen Nationalbank erforderlich.

Diese allgemeine Voraussetzung wird geändert, da Eurex Clearing für die Erfüllung von Zahlungsverpflichtungen in Geld in Euro und Schweizer Franken alternativ die Nutzung von Geldkonten bei Geschäftsbanken gestattet. Der Antragsteller kann entweder ein eigenes Konto bei einer durch Eurex Clearing anerkannten Geschäftsbank für Euro/Schweizer Franken nutzen oder ein Konto bei einer durch Eurex Clearing anerkannten Geschäftsbank für Euro/Schweizer Franken, das im Namen einer Drittbank geführt wird.

Bitte beachten Sie, dass eine Geschäftsbanken-Infrastruktur für Clearing-bezogene Zahlungen momentan lediglich für Schweizer Franken verfügbar ist (siehe Eurex Clearing-Rundschreiben 056/15). Eine entsprechende Geschäftsbanken-Infrastruktur für Euro wird im November 2016 zur Verfügung stehen und in einem separaten Rundschreiben bekannt gegeben.

Des Weiteren hat Eurex Clearing nun ein Konto bei der Bank of England und wird somit Britische Pfund neben Euro und Schweizer Franken als Clearing-Währung für sämtliche Märkte außer für EurexOTC Clear anbieten können. Clearing-Mitgliedern wird gestattet, ein eigenes Geldkonto bei einer durch Eurex Clearing anerkannten Geschäftsbank für Britische Pfund zu nutzen oder ein Konto bei einer durch Eurex Clearing anerkannten Geschäftsbank für Britische Pfund, das im Namen einer Drittbank geführt wird. Britische Pfund wird als Clearing-Währung für EurexOTC Clear im November 2016 zur Verfügung stehen. Das genaue Datum wird in einem separaten Rundschreiben bekannt gegeben.

Geldkonten, welche unmittelbar bei der Bank of England gehalten werden, werden nicht zur Verarbeitung von Clearing-bezogenen Zahlungen in Britischen Pfund angeboten.

Eurex Clearing gewährleistet, dass über Geschäftsbanken zur Verfügung gestellte Geldmittel in Euro, Schweizer Franken und Britischen Pfund sicher auf dem relevanten Zentralbank-Geldkonto der Eurex Clearing hinterlegt werden.

Falls sich ein Clearing-Mitglied dazu entschließt, Geldmittel in Euro oder Schweizer Franken über Geschäftsbankkonten zur Verfügung zu stellen oder Britische Pfund als Clearing-Währung auszuwählen, akzeptiert der Antragsteller folgendes:

- Jede Zahlungsverpflichtung des Clearing-Mitglieds gegenüber Eurex Clearing gilt erst mit Gutschrift des entsprechenden Geldbetrags auf dem relevanten Zentralbankkonto der Eurex Clearing als erfüllt.
- Jede Zahlungsverpflichtung der Eurex Clearing gegenüber dem Clearing-Mitglied gilt bereits mit Gutschrift des entsprechenden Geldbetrags auf dem relevanten Konto der Eurex Clearing bei der Geschäftsbank als erfüllt.
- Alle Verluste, die durch Verzug oder Insolvenz der Geschäftsbank entstehen, sind vom Clearing-Mitglied zu tragen.

Clearing-Mitglieder, die sich für Britische Pfund als Clearing-Währung oder für die Nutzung von Geschäftsbanken für Euro und Schweizer Franken entscheiden, können sich an ihren Key Account Manager wenden, um Informationen über den weiteren Prozess zu erhalten.

Darüber hinaus haben die in diesem Rundschreiben angekündigten Änderungen keinerlei Auswirkungen auf die Geldkonten, welche für die Wertpapierabwicklung des Clearing-Mitglieds benötigt werden, um Lieferung gegen Zahlung sicherzustellen. Für diese Aktivitäten bleiben die Clearing-Bedingungen sowie die entsprechenden Anforderungen unberührt.

Die folgenden Bestimmungen in den Clearing-Bedingungen werden geändert:

- Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 1.2.4
- Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 1.4.1
- Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 2.1.2
- Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 14.2.2
- Kapitel VI Abschnitt 1 Ziffer 1.1.6

Die geänderten Abschnitte der Clearing-Bedingungen, wie durch den Vorstand der Eurex Clearing am 15. Juni 2016 beschlossen, befinden sich im Anhang zu diesem Rundschreiben.

2. Reaktivierung der „Permanent Cash Balance“-Funktionalität für Britische Pfund

Gegenwärtig haben Clearing-Mitglieder über die „Permanent Cash Balance“-Funktionalität (PCB) die Möglichkeit, ein permanentes Geldguthaben in Euro und Schweizer Franken bei Eurex Clearing zu verwalten.

Die PCB-Funktionalität wird für Britische Pfund reaktiviert und eröffnet Clearing-Mitgliedern somit die Möglichkeit ein permanentes Geldguthaben als Geldsicherheit auch in Britischen Pfund zu verwalten. Clearing-Mitglieder haben die Option, die PCB-Funktionalität für Britische Pfund über das Eurex Clearing GUI zu verwalten, so wie es bereits für Euro und Schweizer Franken möglich ist.

3. Einführung eines Abwicklungsbank-Entgeltes

Eurex Clearing führt ein Abwicklungsbank-Entgelt für Clearing-bezogene Geldzahlungen in Clearing-Währungen ein, welches Clearing-Mitglieder zu entrichten haben, die von der Nutzung einer Geschäftsbank für Zahlungen in Euro, Schweizer Franken oder Britischen Pfund Gebrauch machen.

Das volumenbasierte Entgelt wird in der gewählten Clearing-Währung berechnet und fällt mit 0,1 Basispunkten auf die Gesamtbeträge an, die durch die Geschäftsbank abgewickelt werden. Der monatliche Mindestbetrag liegt bei EUR 3.000.

Das volumenbasierte Entgelt wird seitens Eurex Clearing bis Ende 2017 nicht belastet.

Die geänderten Abschnitte des Preisverzeichnisses, wie durch den Vorstand der Eurex Clearing am 6. Juli 2016 beschlossen, befinden sich im Anhang zu diesem Rundschreiben.

Alle in diesem Rundschreiben angekündigten Änderungen treten am 2. August 2016 in Kraft. Ab diesem Datum werden die geänderten Clearing-Bedingungen zum Download auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter folgendem Link zur Verfügung gestellt:

Ressourcen > Regelwerke > Clearing-Bedingungen

Gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 17.2.3 der Clearing-Bedingungen gelten die mit diesem Rundschreiben mitgeteilten Änderungen und Ergänzungen der Clearing-Bedingungen als durch jedes Clearing-Mitglied, Nicht-Clearing-Mitglied und jeden Registrierten Kunden angenommen, sofern diese nicht durch schriftliche Mitteilung an die Eurex Clearing AG vor dem Ende des Geschäftstages vor dem tatsächlichen Inkrafttreten den Änderungen oder Ergänzungen der Clearing-Bedingungen widersprechen. Das Recht zur Beendigung der Clearing-Vereinbarung oder der Clearing-Lizenz gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 2.1.4 Absatz 2, Ziffer 7.2.1 Absatz 4 und Ziffer 13 der Clearing-Bedingungen bleibt unberührt.

Ab dem Wirksamkeitsdatum des 2. August 2016 wird das geänderte Preisverzeichnis auf der Eurex Clearing Website www.eurexclearing.com unter folgendem Link zur Verfügung gestellt:

Ressourcen > Regelwerke > Preisverzeichnis

Gemäß Ziffer 14 Abs. 3 des Preisverzeichnisses gelten die mit diesem Rundschreiben mitgeteilten Änderungen und Ergänzungen des Preisverzeichnisses als durch das jeweilige Clearing-Mitglied angenommen, sofern dieses nicht durch schriftliche Mitteilung an die Eurex Clearing AG innerhalb von zehn (10) Geschäftstagen nach der Veröffentlichung widerspricht.

Sollten Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Group Client Services & Administration unter Tel. +49-69-211-1 17 00 oder senden Sie eine E-Mail an memberservices@eurexclearing.com.

11. Juli 2016

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN,

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN.

****

Kapitel I Allgemeine Bedingungen

[…]

Abschnitt 1 Allgemeine Clearing-Bestimmungen

[…]

1.2 Clearing-Verfahren

[…]

[…]

1.2.4 Einzelne Begriffsbestimmungen und Auslegung

[…]

(2) Die „Clearingwährung“ ist entweder Euro („EUR“)<u>,</u> ~~oder~~ Schweizer Franken („CHF“) <u>oder Britisches Pfund („GBP“)</u>, so wie zwischen der Eurex Clearing AG und dem Clearing-Mitglied in Bezug auf jede Grundlagenvereinbarung schriftlich bestimmt.

[…]

[…]

1.4 Abwicklung von Transaktionen

[…]

[…]

1.4.1 Zahlung von Geldbeträgen

(1) Um Geldzahlungen in E<u>UR</u>~~uro~~ zu leisten, ist das Clearing-Mitglied verpflichtet, die Bank seines RTGS-Kontos oder <u>euro</u>SIC-Kontos (wie jeweils in Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) (aa)<u> ~~und (bb)~~</u> definiert) anzuweisen, die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten dieses Geldkontos einzulösen.

(2) Um Geldzahlungen in ~~Schweizer Franken~~CHF zu leisten, ist das Clearing-Mitglied verpflichtet, die Schweizerische Nationalbank („**SNB**“) anzuweisen, die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten seines SIC-Kontos~~SNB-Kontos~~ (wie in Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) (bb) definiert) einzulösen. ~~Für Clearing-Mitglieder, denen gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziff. 2.1.2 (4) (b) (bb) gestattet ist, die Kontoführung bei einer von der Eurex Clearing AG anerkannten Korrespondenzbank vorzunehmen, gilt die Verpflichtung entsprechend bezogen auf diese Korrespondenzbank.~~

(3) Nutzt das Clearing-Mitglied ein Geldkonto bei einer Korrespondenzbank gemäß Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) (ee), stellt das Clearing-Mitglied sicher, dass die Korrespondenzbank die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten dieses Geldkontos einlöst. Nutzt das Clearing-Mitglied ein Geldkonto bei einer Abwicklungsbank gemäß Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) (ff), stellt das Clearing-Mitglied sicher, dass die Abwicklungsbank die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten dieses Geldkontos einlöst. Nutzt das Clearing-Mitglied ein Geldkonto, das im Namen einer Bank bei einer Abwicklungsbank eröffnet wurde, gemäß Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) (gg), stellt das Clearing-Mitglied sicher, dass die Abwicklungsbank die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten dieses Geldkontos einlöst. ~~Wenn die Eurex Clearing AG die Nutzung von Geldkonten einer Korrespondenzbank gemäß Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) erlaubt hat, hat das Clearing-Mitglied dafür zu sorgen, dass die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten dieses Kontos eingelöst werden.~~

(4) Um Geldzahlungen in anderen Währungen als EUR~~uro~~ und CHF~~Schweizer Franken~~ zu leisten, ist das Clearing-Mitglied verpflichtet, die Abwicklungsbank ~~seine Bank~~ für die betreffende Währung anzuweisen, die von der Eurex Clearing AG eingegangenen Lastschriften zu Lasten ~~dieses~~ des relevanten Geldk~~K~~ontos einzulösen.

(5) Um Geldzahlungen in Bezug auf die Margin in einer anderen Währung als von der Eurex Clearing AG akzeptierten Clearingw~~W~~ährung~~en außer Euro und Schweizer Franken~~ zu leisten, hat das Clearing-Mitglied die jeweiligen Geldbeträge bis zu dem von der Eurex Clearing AG in Bezug auf die jeweilige Währung angegebenen Tag auf das dem Clearing-Mitglied von der Eurex Clearing AG jeweils mitgeteilte Konto zu überweisen. Das Clearing-Mitglied kann seine Abwicklungsb~~B~~ank ~~für~~in Bezug auf die betreffende Währung anweisen, die von der Eurex Clearing AG eingegangenen Lastschriften zu Lasten dieses Kontos einzulösen.

[…]

[…]

2 Clearing-Mitglieder

2.1 Clearing-Lizenz

[…]

[…]

2.1.2 Allgemeine Voraussetzungen für Clearing-Lizenzen

[…]

(4) Der Antragsteller verfügt über die folgenden Konten:

[…]

[…]

(b) Geldkonten:

(aa) für Geldzahlungen in EUR~~uro~~: (i) ein Konto innerhalb des Zahlungsmoduls bei einer Zentralbank des Eurosystems, die mit ihrem TARGET~~arget~~2-Komponentensystem an TARGET~~arget~~2 teilnimmt oder ein Konto bei einer anderen Zentralbank, die keine Zentralbank des Eurosystems ist und aufgrund einer besonderen Vereinbarung an TARGET~~arget~~2 angeschlossen ist (nachfolgend „**RTGS-Konto**“), (ii) ein Konto bei der SECB Swiss Euro Clearing Bank GmbH (das „**SECB-Konto**“) und ein euroSIC-Konto bei der SIX Interbank Clearing AG (beide Konten zusammen das „**euroSIC-Konto**“); (iii) ein Konto bei einer Korrespondenzbank gemäß (ee), (iv) ein Konto bei einer Abwicklungsbank gemäß (ff), oder (v) ein Konto bei einer Bank, die ein Konto bei einer Abwicklungsbank unterhält gemäß (gg);

(bb) für Geldzahlungen in ~~Schweizer Franken~~CHF: (i) ein Konto bei der SNB~~chweizerischen Nationalbank~~ (das „**SNB-Konto**“) und ein Konto bei der SIX Interbank Clearing AG (beide Konten ~~nachfolgend~~ zusammen das „**SIC-Konto**“~~); Clearing-Mitglieder mit Sitz außerhalb der Schweiz und ohne Niederlassung in der Schweiz, die als Clearingwährung nicht Schweizer Franken gewählt haben, können das SIC-Konto durch ein Konto bei einer durch die Eurex Clearing AG anerkannten Korrespondenzbank ersetzen;, und~~ (ii) ein Konto bei einer Korrespondenzbank gemäß (ee), (iii) ein Konto bei einer Abwicklungsbank gemäß (ff), oder (iv) ein Konto bei einer Bank, die ein Konto bei einer Abwicklungsbank unterhält gemäß (gg);

(cc) für Geldzahlungen in GBP: (i) ein Konto bei einer Abwicklungsbank gemäß (ff), oder (ii) ein Konto bei einer Bank, die ein Konto bei einer Abwicklungsbank unterhält gemäß (gg)

(jedes RTGS-Konto und SIC-Konto jeweils ein „**Zentralbank-Konto**“); und,

(ddcc) sofern das Clearing-Mitglied von der Möglichkeit Gebrauch machen möchte, Eurex-Entgelte (wie in Ziffer 5.1 definiert) nach Ziffer 1.4.1 Abs. (6) zu zahlen, ein Konto bei einer Bank für die jeweils betreffende Währung.

(alle diese Konten zusammen mit allen anderen in den Besonderen Clearing-Bedingungen vorgesehenen Geldkonten die „**Geldkonten des Clearing-Mitglieds**“).

(ee) ~~Die Eurex Clearing AG kann auf schriftlichen Antrag die Nutzung von nach Absatz (4) (b) erforderlichen Geldkonten bei einer von der Eurex Clearing AG anerkannten Korrespondenzbank gestatten~~ Der Antragssteller kann für Geldzahlungen in EUR und CHF ein Zentralbank-Konto nutzen, das im Namen einer anderen Bank geführt wird (die „**Korrespondenzbank**“).

(ff) Der Antragssteller kann ein Konto bei einer durch die Eurex Clearing AG anerkannten Geschäftsbank nutzen („**Abwicklungsbank**“). Für Geldzahlungen in EUR, CHF und GBP finden die folgenden Vorschriften Anwendung:

(i) Die Abwicklungsbank darf nicht dem Konzernverbund des Antragsstellers angehören. Art und Umfang des Konzernverbunds werden von der Eurex Clearing AG bestimmt.

(ii) Jede Zahlungsverpflichtung des Antragsstellers gegenüber der Eurex Clearing AG, die unter der relevanten Clearing-Vereinbarung, Grundlagenvereinbarung oder Transaktion entsteht, gilt nur dann als erfüllt, wenn der entsprechende Geldbetrag auf dem bestimmten TARGET2-Konto der Eurex Clearing AG, dem Konto der Eurex Clearing AG bei der SNB oder der Bank of England (beide ein „**ECAG Zentralbank-Konto**“) oder dem Konto der Eurex Clearing AG bei der SIX Interbank Clearing AG bzw. bei der Swiss Euro Clearing Bank GmbH (beide ein „**ECAG euroSIC-Konto**“) gutgeschrieben wurde. Die Eurex Clearing AG stellt sicher, dass sie die Abwicklungsbank unverzüglich nach jeder Gutschrift eines Geldbetrages auf ihrem Konto bei der Abwicklungsbank anweist, diesen Geldbetrag auf das entsprechende ECAG Zentralbank-Konto oder das ECAG euroSIC-Konto zu überweisen.

(iii) Jede Zahlungsverpflichtung der Eurex Clearing AG gegenüber dem Antragsteller, die unter der relevanten Clearing-Vereinbarung, Grundlagenvereinbarung oder Transaktion entsteht, gilt bereits dann als erfüllt, wenn der entsprechende Geldbetrag auf dem relevanten Konto der Eurex Clearing AG bei der Abwicklungsbank gutgeschrieben wurde. Die Eurex Clearing AG stellt sicher, dass sie die Abwicklungsbank unverzüglich nach jeder Gutschrift eines Geldbetrages auf ihrem Konto bei der Abwicklungsbank anweist,

diesen Geldbetrag auf das Konto des Antragsstellers bei der Abwicklungsbank zu überweisen.

(iv) Mit dem Eingehen einer Clearing-Vereinbarung mit der Eurex Clearing AG sichert der Antragssteller im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieversprechens in Bezug auf sich selbst gegenüber der Eurex Clearing AG zu und gewährleistet, dass er die Eurex Clearing AG von sämtlichen Schäden und Verlusten, die aus (a) der Nichtüberweisung des relevanten Geldbetrages von dem Konto der Eurex Clearing AG bei der Abwicklungsbank auf das relevante Zentralbank-Konto der Eurex Clearing AG oder (b) der Nichtüberweisung des relevanten Geldbetrages von dem Konto der Eurex Clearing AG bei der Abwicklungsbank auf das relevante Konto des Antragsstellers bei der Abwicklungsbank entstehen können, freizustellen, es sei denn die Nichtüberweisung basiert auf einem vorsätzlichen Handeln oder Unterlassen der Eurex Clearing AG. Die Eurex Clearing AG tritt sämtliche Ansprüche, die sie im Zusammenhang mit der Nichtüberweisung gegenüber der Abwicklungsbank erwirbt, an den Antragssteller ab.

(gg) Der Antragssteller kann ein Konto bei einer Abwicklungsbank nutzen, das im Namen einer anderen Bank geführt wird. Die Vorschriften unter (ff) gelten entsprechend.

[…]

[…]

[…]

14 Haftung, Notfallmaßnahmen, Vertragsstrafen, Delegation

[…]

14.2 Disziplinarverfahren; Vertragsstrafen

[…]

14.2.2 Bei Eintritt eines Beendigungsgrundes gemäß Ziffer 7.2.1 Abs. (1) oder im Falle der Nichtlieferung von Wertpapieren oder sonstiger Vermögenswerte oder einer Nichtbereitstellung von Geldbeträgen im Rahmen einer Physischen Lieferung gemäß den Besonderen Clearing-Bestimmungen – unabhängig davon, ob die Eurex Clearing AG Schäden erlitten hat – , es sei denn, eine solche Nichtlieferung von Wertpapieren oder sonstiger Vermögenswerte oder eine solche Nichtbereitstellung von Geldbeträgen beruht auf höherer Gewalt und/oder einer allgemeinen Markt- oder Systemstörung außerhalb der Kontrolle des Clearing-Mitglieds, hat das Clearing-Mitglied eine Vertragsstrafe in Höhe von 0,025 Prozent des jeweils ungezahlten fälligen Betrags, jedoch mindestens EUR 2.500 − oder den entsprechenden Gegenwert in ~~CHF~~einer durch die Eurex Clearing AG festgelegten anderen Clearingwährung − pro Kalendertag

auf Anweisung der Eurex Clearing AG zu zahlen, jedoch höchstens EUR 25.000 oder den entsprechenden Gegenwert in ~~CHF~~einer durch die Eurex Clearing AG festgelegten anderen Clearingwährung. Übersteigt der aus dem vorstehenden Prozentsatz errechnete Betrag EUR 25.000, so wird die Höhe der Vertragsstrafe − ungeachtet der Bestimmungen in Satz 1 − nach einem Prozentsatz des jeweils ungezahlten fälligen Betrags berechnet, wobei dieser Prozentsatz durch die Eurex Clearing AG im Voraus festgelegt und mitgeteilt wurde. Dieser Prozentsatz basiert auf dem jeweils für die betreffende Clearingwährung geltenden Tageszinssatz.

[…]

[…]

****

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

9. Serviceentgelte für Sicherheiten, Beiträge zum Clearing-Fonds 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

[…]

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: 0,50 % 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 (Kapitel I Abschnitt 2 Ziffer 4.2 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG), dem Segregierten Internen Margin-Konto (Kapitel I Abschnitt 3 Unterabschnitt A Ziffer 4.1.2 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG) und dem Internen Net Omnibus Margin-Konto (Kapitel I Abschnitt 4 Ziffer 4.2 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG) des Clearing-Mitglieds erfassten Eligiblen Margin-Vermögenswerte in Form von Geldbeträgen.

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

Wickelt das Clearing-Mitglied Zahlungen in EUR, CHF oder GBP 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 Währung, in der diese Geldzahlungen geleistet werden („Abwicklungsbank-Entgelt“). Der monatliche Mindestbetrag für das Abwicklungsbank-Entgelt (Untergrenze) liegt bei EUR 3.000.

[…]

****