

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 11.01.2016
	Seite 1

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Kapitel VIII Clearing von OTC-Derivat-Transaktionen

[...]

Abschnitt 2 Clearing von OTC-Zinsderivat-Transaktionen

2.1 Allgemeine Bestimmungen

[...]

2.1.4.1 Transaktionsart-spezifische Novationskriterien

[...]

(3) Zahlungstypen

Die Zahlungen der Parteien müssen einem der folgenden Typen von Zahlungen entsprechen:

- (a) Festsatz oder Festbetrag (jeweils einschließlich Nullkuponzahlungen) gegen variabler Satz (einschließlich Nullkuponzahlungen);¹⁷ oder
- (b) (nur im Fall von IRS) variabler Satz gegen variabler Satz (jeweils einschließlich Nullkuponzahlungen);¹
- (c) (nur im Fall von ZCIS) jährlicher Festsatz (Nullkuponzahlung) gegen die Entwicklung des jeweiligen Inflationsindexes.

Zahlungen von Beträgen aufgrund eines IRS, ZCIS oder OIS (Gebühren ausgeschlossen) müssen nachträglich erfolgen (und nicht vor oder bei Beginn einer Berechnungsperiode).

- (+) Gebühren und andere Zahlungen werden bei Vertragsabschluss vereinbart. Die Gebühren müssen in der Handelswährung angegeben werden.

Bei IRS, OIS und FRA werden die Gebühren im Falle einer Beendigung einen Tag nach dem Enddatum für EUR, USD, GBP, CHF bzw. zwei Tage nach dem Enddatum für JPY

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 11.01.2016
	Seite 2

abgerechnet. Tritt die Endfälligkeit ein, so werden die Gebühren am Endfälligkeitstag abgerechnet.

Bei ZCIS werden die Gebühren im Falle einer Beendigung einen Tag nach dem Enddatum abgerechnet. Tritt die Fälligkeit ein, so werden die Gebühren am Fälligkeitstag abgerechnet.

Bei in der Zukunft beginnenden Transaktionen sind zusätzliche Zahlungen auch vor Transaktionsbeginn zulässig.

~~Zahlungen von Beträgen aufgrund eines IRS oder OIS müssen nachträglich erfolgen (und nicht vor oder bei Beginn einer Berechnungsperiode).~~

[...]
