

Kapitel II der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

Transaktionen an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

(Eurex-Börsen)

Stand 27.02.2017

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 27.02.2017
	Seite 1

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

Abschnitt 1 Allgemeine Bestimmungen

- (1) Die Eurex Clearing AG führt die Abwicklung bzw. das Clearing von an den Eurex-Börsen abgeschlossenen Transaktionen („**Derivate-Transaktionen**“) durch, sofern die den jeweiligen Derivate-Transaktionen zugrunde liegenden Futures-Kontrakte und Optionskontrakte bzw. die aus der Ausübung dieser Derivate-Transaktionen zu liefernden Wertpapiere von der Eurex Clearing AG und der jeweiligen Abwicklungsstelle abgewickelt werden können und die Voraussetzungen gemäß nachstehendem Absatz (2) erfüllt sind.

[...]

1.1 Clearing-Lizenz

1.1.1 Erteilung der Clearing-Lizenz

[...]

1.1.2 Voraussetzungen der Clearing-Lizenz

- (1) Bezüglich der im Rahmen der Erteilung der Clearing-Lizenz zu erfüllenden Voraussetzungen gilt Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 2.1.1 bis 2.1.3.

- (2) Der Antragsteller hat folgende weitere Voraussetzungen zu erfüllen:

- (a) Nachweis eines Kontos für Barzahlungen in Euro:

- RTGS-Konto oder
- SECB-Konto und euroSIC-Konto,

[...]

- (f) Den Nachweis der Zulassung zum Handel von FX Futures und/oder FX Optionen an den Eurex-Börsen. Soweit ein solcher Nachweis nicht erbracht wird, wird die Eurex Clearing AG das Clearing von Transaktionen des

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 27.02.2017
	Seite 2

betreffenden Clearing-Mitgliedes in Produkten gemäß Satz 1, als auch von solchen Transaktionen der dem jeweiligen Clearing-Mitglied angeschlossenen Nicht-Clearing-Mitglied bzw. Registrierte Kunden nicht durchführen. In diesem Fall findet Kapitel I Ziffer 1.2.2 keine Anwendung und die Eurex-Börsen werden das betreffende Clearing-Mitglied und dessen Nicht-Clearing-Mitglieder vom Handel solcher Produkte ausschließen.

- (g) Nachweis einer Zinsderivat-Clearing-Lizenz für in Euro denominierte OTC-Zinsderivat-Transaktionen gemäß Kapitel VIII Teil 3 der Clearing-Bedingungen. Soweit ein solcher Nachweis nicht erbracht wird, wird die Eurex Clearing AG das Clearing von Transaktionen in Zinsswap Futures-Kontrakten des betreffenden Clearing-Mitgliedes, als auch von solchen Transaktionen der dem jeweiligen Clearing-Mitglied angeschlossenen Nicht-Clearing-Teilnehmer bzw. Registrierte Kunden nicht durchführen. In diesem Fall findet Kapitel I Ziffer 1.2.2 keine Anwendung und die Eurex-Börsen werden das betreffende Clearing-Mitglied und dessen Nicht-Clearing-Mitglieder vom Handel solcher Produkte ausschließen.

[...]

1.2 Margin-Verpflichtung

[...]

1.10 Anforderungen an Nicht-Clearing Mitglieder bezüglich ausreichend qualifizierter Mitarbeiter im Back-Office

Ein Nicht-Clearing Mitglied muss mindestens einen ausreichend qualifizierten (wie von der Eurex Clearing AG festgelegt und gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 16.1 veröffentlicht) Mitarbeiter im Back-Office einsetzen.

Der ausreichend qualifizierte Mitarbeiter muss während des Geschäftstags bis 19:00 Uhr MEZ physisch anwesend und telefonisch sowie mittels Fax erreichbar sein. Das Nicht-Clearing Mitglied hat sicherzustellen, dass ein ausreichend qualifizierter Mitarbeiter von 19:00 Uhr MEZ bis 22:30 Uhr MEZ telefonisch erreichbar ist.

Für den Fall, dass ein Clearing-Mitglied oder ein Nicht-Clearing-Mitglied in das Clearing von Instrumenten involviert ist, die zum Handel an den Eurex-Börsen zugelassen und für den 23h-Handel verfügbar sind, muss die Erreichbarkeit des ausreichend qualifizierten Mitarbeiters auch für verlängerte Handelszeiten sichergestellt werden.

Ein Nicht-Clearing Mitglied ist nicht verpflichtet, einen ausreichend qualifizierten Mitarbeiter im Back-Office einzusetzen, falls es alle Back-Office-Funktionen auf sein Clearing Mitglied gemäß Kapitel 1 Abs. 1 Nummer 15.2 auslagert oder auf einen Insourcer, der über einen qualifizierten Mitarbeiter im Back-Office verfügt.

[...]
