

| | |
|--|------------------|
| | Eurex04 |
| Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG | Stand 07.03.2016 |
| | Page 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

[...]

2.1.3 Lizenz für das Clearing von OTC-Zinsderivat-Transaktionen

[...]

2.1.3.1 Voraussetzungen für die Erteilung einer Zinsderivat-Clearing-Lizenz

Die in Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 2.1.1 bis 2.1.3 genannten allgemeinen Voraussetzungen für die Erteilung einer Clearing-Lizenz finden Anwendung (mit Ausnahme von Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (a) (cc) und Ziffer 2.1.2 Abs. (5) (e)). Darüber hinaus hat das antragstellende Institut die folgenden weiteren Voraussetzungen für eine Zinsderivat-Clearing-Lizenz zu erfüllen:

- (a) Das Institut ist Teilnehmer eines Anerkannten Trade Source Systems;
- (b) Bestätigung über den Abschluss einer Lizenzvereinbarung zwischen dem Institut und Swaps Monitor Publications Inc., New York für die Nutzung von Daten zur Bestimmung des relevanten Geschäftstages;
- (c) zusätzlich zu den gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) erforderlichen Geldkonten sofern die Zinsderivat-Clearing-Lizenz des jeweiligen Clearing-Mitglieds für OTC-Zinsderivat-Transaktionen in USD gilt ein Geldkonto für USD;
- (d) sofern die Zinsderivat-Clearing-Lizenz des jeweiligen Clearing-Mitglieds für OTC-Zinsderivat-Transaktionen in GBP gilt, ein Geldkonto für GBP;

| | |
|--|------------------|
| | Eurex04 |
| Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG | Stand 07.03.2016 |
| | Page 2 |
| | |

- (e) sofern die Zinsderivat-Clearing-Lizenz des jeweiligen Clearing-Mitglieds für OTC-Zinsderivat-Transaktionen in JPY gilt, ein Geldkonto für JPY;
- (f) sofern die Zinsderivat-Clearing-Lizenz des jeweiligen Clearing-Mitglieds für OTC-Zinsderivat-Transaktionen in CHF gilt, ein Geldkonto für CHF; und
- (g) der Nachweis, dass jedes der Geldkonten gemäß Absatz ~~(c) bis (d) und~~ (f) bei einer von der Eurex Clearing AG anerkannten Bank gehalten wird.

[...]
