

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 04.08.2014
	Seite 1

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Kapitel IV Transaktionen an der Eurex Repo GmbH (Eurex Repo)

[...]

Abschnitt 2 Clearing von Transaktionen an der Eurex Repo GmbH

[...]

2.2 Allgemeine Verpflichtungen

[...]

- (2) Für das Verfahren bei Lieferungen und Zahlungen, die aus Eurex Repo-Transaktionen resultieren, gilt ergänzend zu Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 1.2.5 und 1.4 Folgendes:

[...]

- (d) Belieferung und Zahlung bei GC Pooling Repo-Transaktionen:

[...]

Das Clearing-Mitglied hat bei GC Pooling Transaktionen, die in Euro an einem anderen Geschäftstag als dem Handelsdatum abgewickelt werden, die ihm obliegende Leistung derart zur Abwicklung zur Verfügung zu stellen, dass die Erfüllung seiner Verpflichtung gegenüber der Eurex Clearing AG im Rahmen des ersten Same Day Settlement-Buchungslaufs des Tages („**SDS1**“) der Clearstream Banking AG für den maßgeblichen Leistungstag erfolgen kann. Bei GC Pooling Transaktionen, die in anderen Währungen als Euro und US Dollar an einem anderen Geschäftstag als dem Handelsdatum abgewickelt werden, hat das Clearing-Mitglied die ihm obliegende Leistung derart zur Abwicklung zur Verfügung zu stellen, dass die Erfüllung seiner Verpflichtung gegenüber der Eurex Clearing AG bis um 11:30 CET an dem maßgeblichen Leistungstag erfolgen kann. Bei GC Pooling Transaktionen, die in US Dollar an einem anderen Geschäftstag als dem Handelsdatum abgewickelt werden, hat das Clearing-Mitglied die ihm obliegende Leistung derart zur Abwicklung zur Verfügung zu stellen, dass die Erfüllung seiner Verpflichtung gegenüber der

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 04.08.2014
	Seite 2

Eurex Clearing AG bis um 15:00 CET an dem maßgeblichen Leistungstag erfolgen kann.

[...]

2.6 Nichtlieferung

(1) Für das Verfahren bei Nichtlieferung gilt Folgendes:

(a) Nichtlieferung am Liefertag des Front-Leg

[...]

Erfüllt ein Clearing-Mitglied seine Leistungspflicht entgegen Kapitel IV Ziffer 2.2 Abs. (2) (d) nicht im Rahmen des SDS1 für GC Pooling Transaktionen in Euro bzw. bis 11:30 CET für GC Pooling Transaktionen in anderen Währungen als Euro und US Dollar bzw. bis 15:00 CET für GC Pooling Transaktionen in US Dollar, befindet es sich, unbenommen der vorstehenden Regelung, in einem untätigen Leistungsverzug. Soweit ein Clearing-Mitglied nicht geliefert hat, kann die Eurex Clearing AG für den operativen Mehraufwand eine Aufwandsentschädigung von EUR 2000 je nicht beliefertem GC Pooling Repo-Transaktion erheben. Weiterhin ist die Eurex Clearing AG berechtigt, dem Clearing-Mitglied anfallende Zwischenfinanzierungskosten bis zur Höhe des bei Bloomberg oder Reuters veröffentlichten STOXX GC Pooling EUR ON Index („**SGCPON**“) zuzüglich 50 Basispunkten p.a., bezogen auf den Wert der zugrunde liegenden GC Pooling-Transaktion bzw. den ausstehenden Geldbetrag, in Rechnung zu stellen und zwar bis zum Zeitpunkt der Erfüllung der Leistungspflicht.

(b) Nichtlieferung am Liefertag des Term-Leg

[...]