

Clearing-Bedingungen

1 Abschnitt

Allgemeine Vorschriften

1.1 Teilabschnitt

Clearing-Lizenz

1.1.1 Clearing-Lizenz

(1) ...

(2) Eine Clearing-Lizenz wird als General-Clearing-Lizenz oder als Direkt-Clearing-Lizenz erteilt. Die Lizenz wird mit Abschluss der entsprechenden im Anhang dieser Bedingungen abgedruckten Clearing-Vereinbarung erteilt. Eine General-Clearing-Lizenz berechtigt zum Clearing von eigenen Geschäften, Kundengeschäften und Geschäften von Börsenteilnehmern ohne Clearing-Lizenz (Ziffer 1.2.5 Absatz 1). Eine Direkt-Clearing-Lizenz berechtigt zum Clearing von eigenen Geschäften, Kundengeschäften und Geschäften konzernverbundener Börsenteilnehmer ohne Clearing-Lizenz (Ziffer 1.2.5 Absatz 2).

(3) Eine Clearing-Lizenz können beantragen:

~~wird nur – von nachfolgenden Ausnahmen abgesehen – Kreditinstituten im Sinne von § 1 des Gesetzes über das Kreditwesen (KWG) und Banken im Sinne von Art. 3 und Art. 3 bis des Bundesgesetzes über die Banken und Sparkassen (BankG) erteilt (Clearing-Mitglied).~~

(a) Institute mit Sitz in einem Staat der Europäischen Union oder der Schweiz, sofern sie von den zuständigen Stellen ihres Herkunftsstaats zugelassen worden sind und die Zulassung das Betreiben von Einlagengeschäft, Kreditgeschäft und Finanzkommissionsgeschäft abdeckt und das Institut von den zuständigen Stellen nach den Vorgaben der Richtlinien der Europäischen Union beaufsichtigt wird;

(b) Zweigstellen und Zweigniederlassungen von Instituten gemäß § 53, 53 b oder 53 c KWG, sofern die Zweigstelle beziehungsweise das Institut die Voraussetzungen der Ziffern 1.1.1 Absatz 3 (a) und 1.1.2 erfüllt;

(c) Niederlassungen im Sinne von Art. 2 Abs. 1 des schweizer Bundesgesetzes über die Banken und Sparkassen i. V. m. Art. 1 ff. der Verordnung der Eidgenössischen Bankenkommission über die ausländischen Banken in der Schweiz, sofern die Niederlassung das Vorliegen der Voraussetzungen der Ziffern 1.1.1 Absatz 3 (a) und 1.1.2 nachweist.

Institute gemäß Ziffer (b) und (c) müssen schriftlich garantieren, dass sie die aus dem Clearing ihrer Zweigstellen beziehungsweise Zweigniederlassungen entstehenden Verpflichtungen in unbegrenzter Höhe auf erstes Anfordern der Eurex Clearing AG erfüllen werden. Zur Prüfung der Rechtswirksamkeit dieser Garantie kann die Eurex Clearing AG vom Institut auf dessen Kosten alle erforderlichen Auskünfte und Nachweise, einschließlich einer rechtsgutachterlichen Stellungnahme eines von der Eurex Clearing AG bestimmten Gutachters verlangen.

~~(4) Einem ausländischen Unternehmen wird für seine in Deutschland oder in der Schweiz domizilierte Zweigniederlassung eine Clearing-Lizenz erteilt,~~

~~– sofern es sich um eine Zweigniederlassung im Sinne der §§ 53 b oder 53 c KWG handelt, wenn das ausländische Unternehmen das Vorliegen der Voraussetzungen der Ziffer 1.1.2 Absatz 1 nachweist;~~

~~– sofern es sich um eine Zweigniederlassung im Sinne des § 53 KWG handelt, wenn die Zweigniederlassung das Vorliegen der Voraussetzungen der Ziffer 1.1.2 Absatz 1 dieser Bedingungen durch Einreichen einer Vermögensübersicht gemäß § 53 Absatz 2 Nr. 2 KWG bei Antragstellung durch~~

~~das ausländische Unternehmen nachweist;~~

~~– sofern es sich um ein Institut im Sinne von Art. 2 Abs. 1 BankG i. V. m. Art. 1 ff. der Verordnung der Eidgenössischen Bankenkommission über die ausländischen Banken in der Schweiz (ABV) handelt, wenn das ausländische Unternehmen das Vorliegen der Voraussetzungen der Ziffer 1.1.2 Absatz 1 nachweist.~~

~~Das ausländische Unternehmen muss der Eurex Clearing AG schriftlich bestätigen, dass es die aus dem Clearing seiner Zweigniederlassung entstehenden Verpflichtungen in unbegrenzter Höhe erfüllen wird. Auf Verlangen der Eurex Clearing AG hat es die rechtliche Wirksamkeit und Durchsetzbarkeit dieser Erklärung durch eine rechtsgutachtliche Stellungnahme auf seine Kosten zu bestätigen; die Eurex Clearing AG kann den Gutachter bestimmen.~~

1.1.2 Voraussetzungen der Clearing-Lizenz

~~(1) Eine General-Clearing-Lizenz können Kreditinstitute im Sinne des KWG und Banken im Sinne des BankG erhalten, die über setzt ein haftendes Eigenkapital des antragstellenden Instituts in Höhe von mindestens EUR 125 Millionen oder Eigenmittel im entsprechenden Gegenwert in CHF verfügen dem entsprechenden Gegenwert in der Währung des Staats voraus, in dem das antragstellende Institut seinen Sitz hat. Für Institute, die nicht dem Anwendungsbereich des KWG unterfallen gilt eine dem haftenden Eigenkapital vergleichbare Eigenmittelgröße. Die Berechnung des haftenden Eigenkapitals beziehungsweise der Eigenmittel erfolgt nach den am Ort der Niederlassung des Kreditinstitutes beziehungsweise der Bank geltenden gesetzlichen Vorschriften.~~

~~Eine Direkt-Clearing-Lizenz können Kreditinstitute im Sinne des KWG und Banken im Sinne des BankG erhalten, die über setzt ein haftendes Eigenkapital des antragstellenden Instituts in Höhe von mindestens EUR 12,5 Millionen oder Eigenmittel im entsprechenden Gegenwert in CHF verfügen dem entsprechenden Gegenwert in der Währung des Staats voraus, in dem das antragstellende Institut seinen Sitz hat. Für Institute, die nicht dem Anwendungsbereich des KWG unterfallen gilt eine dem haftenden Eigenkapital vergleichbare Eigenmittelgröße.~~

~~Die Berechnung des haftenden Eigenkapitals beziehungsweise der vergleichbaren Eigenmittel erfolgt nach den am Ort der Niederlassung des Kreditinstitutes beziehungsweise der Bank im Staat des Sitzes des Instituts geltenden gesetzlichen Vorschriften. Die Höhe des haftenden Eigenkapitals beziehungsweise der vergleichbaren Eigenmittel ist der Eurex Clearing AG bei Antragstellung sowie während der Clearing-Mitgliedschaft jederzeit auf Verlangen nachzuweisen. Zur Überprüfung kann die Eurex Clearing AG einen Abschlußprüfer auf Kosten des antragstellenden Instituts beauftragen.~~

~~(2) Reicht das Soweit die Höhe des haftende Eigenkapital beziehungsweise die vergleichbaren Eigenmittel eines des antragstellenden Instituts für die Erteilung einer General-Clearing-Lizenz oder einer Direkt-Clearing-Lizenz nicht ausreicht, kann die Eurex Clearing AG bestimmen, das fehlende Eigenkapital beziehungsweise können die fehlenden Eigenmittel durch eine Bankgarantie eines von der Eurex Clearing AG anerkannten Kreditinstitutes beziehungsweise Bankinstitutes zu Gunsten der Eurex Clearing AG in Höhe des fehlenden Betrages kompensiert werden dass der Fehlbetrag durch Bankgarantien und/oder Sicherheiten in Geld oder in Wertpapieren ausgeglichen wird.~~

~~Die Bankgarantie muß von einer von der Eurex Clearing AG anerkannten Bank mit Sitz in einem Staat der Europäischen Union oder der Schweiz erklärt werden. Das antragstellende Institut und die garantierende Bank müssen personenverschieden sein. Art und Umfang eines zulässigen Konzernverbunds zwischen antragstellendem Institut und der garantierenden Bank werden von der Eurex Clearing AG bestimmt. Die Bankgarantie muß die unbedingte und unwiderrufliche Verpflichtung der Bank enthalten, den garantierten Betrag auf erstes Anfordern der Eurex Clearing AG auf ein von dieser benanntes Konto anzuschaffen. Art, Inhalt und Form der Bankgarantie werden von der Eurex Clearing AG bestimmt.~~

~~Sicherheiten in Geld sind gemäß Ziffer 1.3.4 zu leisten. Sicherheiten in Wertpapieren sind durch Sicherungsübereignung oder Sicherungsabtretung auf ein von der Eurex Clearing AG bestimmtes Depot bei der Clearstream Banking AG oder bei der SegalIntersettle AG zu leisten.~~

Die Bankgarantien dient zur Besicherung der gesamten Kontraktverpflichtungen des Clearing-Mitgliedes und sonstiger Ansprüche der Eurex Clearing AG gegenüber dem Clearing-Mitglied und die Sicherheiten in Geld und in Wertpapieren dienen der Sicherung der Erfüllung der Kontraktverpflichtungen des betreffenden Clearing-Mitglieds sowie aller sonstigen Ansprüche der Eurex Clearing AG gegen das betreffende Clearing-Mitglied im Zusammenhang mit dem Clearing von dessen Kontrakten (Sicherheitsleistung).

~~(2) Das antragstellende Unternehmen muss die Voraussetzungen für eine Clearing-Lizenz (Ziffer 1.1.4) erfüllen und der Eurex Clearing AG eine Clearing-Garantie gemäß Ziffer 1.6.1 Absatz 1 und 2 als Beitrag zum Garantiefonds zur Verfügung stellen.~~

In dem Antrag nach Ziffer 1.1.1 Absatz 1 Nachzuweisen sind: das

~~(a) ein Wertpapierdepot sowie und das ein jeweiliges Pfanddepot bei der Clearstream-Banking AG in Frankfurt am Main oder bei der SegalInterSettle AG, das~~

~~(b) ein Konto bei der Landeszentralbank in Hessen – Hauptstelle Frankfurt der Deutschen Bundesbank (LZB) –, das und ein Konto bei der Schweizerischen Nationalbank (SNB) einschließlich eines SIC-Kontos sowie die für die Abwicklung der an den Eurex-Börsen handelbaren Fremdwährungsprodukte erforderlichen Fremdwährungskonten bei einer von der Eurex Clearing AG anerkannten Bank der CBF anzugeben, über die das Clearing-Mitglied seine Geschäfte an den Eurex-Börsen abwickelt; die Eurex Clearing AG kann gestatten, dass für die Geldverrechnung mit der Eurex Clearing AG Konten einer von der Eurex Clearing AG anerkannten Korrespondenzbank eingesetzt werden;~~

~~(c) Jedes Clearing-Mitglied hat der Einsatz angemessener technischer Einrichtungen (Backoffice-Einrichtung) einzusetzen, um eine ordnungsgemäße Aufzeichnung, Verbuchung und Überwachung aller Transaktionen sowie der Sicherheitsleistungen und die Berechnung der erforderlichen Sicherheitsleistungen gegenüber seinen den Kunden nach den Mindestanforderungen der Eurex Clearing AG (Clearing-Pflichten) sicherzustellen; im Übrigen gelten die Durchführungsbestimmungen der Eurex-Börsen über Technische Einrichtungen entsprechend;~~

~~(d) Jedes Clearing-Mitglied ist verpflichtet, der Einsatz mindestens eines ausreichend qualifizierten Mitarbeiters zur ordnungsgemäßen Durchführung seiner der Clearing-Pflichten im Backoffice mindestens einen qualifizierten Mitarbeiter einzusetzen; eine ausreichende Qualifikation der eingesetzten Backoffice-Mitarbeiter für die Erfüllung dieser Clearing-Pflichten ist anzunehmen, wenn der von der Eurex Clearing AG angebotene Eignungstest für Backoffice-Mitarbeiter (Clearer-Test) erfolgreich abgelegt wurde; mindestens ein ausreichend qualifizierter Mitarbeiter hat jederzeit während des Börsentages anwesend und telefonisch und mittels Telefax erreichbar zu sein.~~

~~(e) die Leistung des Beitrags zum Clearing-Fonds gemäß Ziffer 1.6.1.~~

~~(4) Das Vorliegen der Voraussetzungen nach Ziffer 1.1.2 Absatz 1 bis 3 ist bei Antragstellung nachzuweisen. Clearing-Mitglieder sind auf Anforderung der Eurex Clearing AG verpflichtet, bis spätestens zum Ablauf von sechs Monaten nach Ende eines jeden Geschäftsjahres des Clearing-Mitgliedes gegenüber der Eurex Clearing AG einen Nachweis über das Vorliegen der in Ziffer 1.1.2 Absatz 1 geregelten Voraussetzungen für die Erteilung einer Clearing-Lizenz zu erbringen.~~

1.1.3 Mitteilungspflichten; Überprüfungsrecht

Ein ~~Jedes~~ Clearing-Mitglied hat die Eurex Clearing AG unverzüglich zu unterrichten, sobald die Voraussetzungen gemäß Ziffern 1.1.1 Absatz 3 und 1.1.2 Absatz 1 nicht mehr vorliegen erfüllt sind oder sonstige Umstände vorliegen, die zum Wegfall dieser Voraussetzungen führen können. Das Fortbestehen dieser Voraussetzungen ist der Eurex Clearing AG auf Verlangen nachzuweisen. Die Eurex Clearing AG kann zur weiteren Überprüfung einen Abschluss-Prüfer im Sinne des § 27 Absatz 1 KWG oder vergleichbarer Regelungen beziehungsweise eine Revisionsstelle im Sinne von Art. 20 BankV auf Kosten des Clearing-Mitgliedes beauftragen.

1.1.4 Voraussetzungen für die Erteilung der Clearing-Lizenz

(1) In dem Antrag nach Ziffer 1.1.1 Absatz 1 sind das Wertpapierdepot sowie das jeweilige Pfanddepot bei der Clearstream Banking AG in Frankfurt am Main (CBF) oder bei der SIS-SEGAINTERSETTLE AG (SIS), das Konto bei der Landeszentralbank in Hessen – Hauptstelle Frankfurt der Deutschen Bundesbank (LZB) –, das Konto bei der Schweizerischen Nationalbank (SNB) sowie die für die Abwicklung der an den Eurex-Börsen handelbaren Fremdwährungsprodukte erforderlichen Fremdwährungskonten bei der CBF anzugeben, über die das Clearing-Mitglied seine Geschäfte an den Eurex-Börsen abwickelt. Die Eurex Clearing AG kann gestatten, dass für die Geldverrechnung mit der Eurex Clearing AG Konten einer Korrespondenzbank eingesetzt werden.

(2) Jedes Clearing-Mitglied hat angemessene technische Einrichtungen (Backoffice-Einrichtung) einzusetzen, um eine ordnungsgemäße Aufzeichnung, Verbuchung und Überwachung aller Transaktionen sowie der Sicherheitsleistungen und die Berechnung der erforderlichen Sicherheitsleistungen gegenüber seinen Kunden nach den Mindestanforderungen der Eurex Clearing AG (Clearing-Pflichten) sicherzustellen. Im Übrigen gelten die Durchführungsbestimmungen der Eurex-Börsen über Technische Einrichtungen entsprechend.

1.1.54 Rückgabe, Rücknahme, Widerruf Beendigung und Ruhen der Clearing-Lizenz

(1) Jedes Clearing-Mitglied kann seine Clearing-Lizenz schriftlich ohne Angabe von Gründen zurückgegeben werden beenden. Die Rückgabe Beendigung wird erst wirksam, nachdem alle Positionen, für deren Clearing ein betroffenes das betreffende Clearing-Mitglied zuständig ist, glattgestellt oder auf ein anderes Clearing-Mitglied übertragen und alle ausstehenden Lieferungs- und Zahlungsverpflichtungen des betreffenden Clearing-Mitgliedes erfüllt worden sind.

(2) Die Eurex Clearing AG nimmt beendet eine Clearing-Lizenz zurück,

(a) wenn die Voraussetzungen zur für deren Erteilung der Clearing-Lizenz nicht vorgelegen haben, insbesondere wenn die Clearing-Lizenz aufgrund unrichtiger oder unvollständiger Angaben des Clearing-Mitglieds erteilt wurde, oder

(3) Die Eurex Clearing AG widerruft eine Clearing-Lizenz,

(b) wenn die Voraussetzungen zur für deren Erteilung der Clearing-Lizenz nachträglich weggefallen sind, oder

(c) wenn ein Clearing-Mitglied wesentliche Clearing-Bedingungen verletzt oder trotz Abmahnung wiederholt gegen diese Bestimmungen die Clearing-Bedingungen verstoßen hat; fehlendes Verschulden des Clearing-Mitglieds ist insoweit unbeachtlich; oder

(d) wenn gegen das Clearing-Mitglied Maßnahmen nach gemäß §§ 45 ff. KWG – auch soweit deren Anwendung auf §§ 53 b oder 53 c KWG beruht – angeordnet sind oder das Vergleichs- oder Konkursverfahren Insolvenzverfahren beantragt worden ist, oder wenn entsprechende Maßnahmen nach Schweizer Recht, insbesondere das Konkurs- oder Nachlassverfahren im Sinne von Art. 36 f. BankG eingeleitet worden sind. Gleiches gilt, wenn ein Clearing-Mitglied um Stundung gemäß Art. 29 ff. BankG nachsucht. Den Maßnahmen gemäß §§ 45 ff. KWG und dem Insolvenzverfahren stehen entsprechende Maßnahmen und Verfahren nach dem Recht im Staat des Sitzes des Clearing-Mitglieds gleich.

(4) Rücknahme oder Widerruf der Clearing-Lizenz teilt die Eurex Clearing AG dem Betroffenen unter Angabe der Gründe schriftlich mit. Die Eurex Clearing AG teilt dem betroffenen Clearing-Mitglied die Beendigung der Clearing-Mitgliedschaft schriftlich unter Angabe der Gründe mit.

(3) Besteht der begründete Verdacht, dass die Voraussetzungen einer Rücknahme Beendigung nach Absatz 2 oder eines Widerrufs nach Absatz 3 vorliegen, kann die Eurex Clearing AG das Ruhen der Clearing-Lizenz für die Dauer von längstens sechs Monaten anordnen. Zum Zwecke der Überprüfung kann die Eurex Clearing AG von dem betreffenden Clearing-Mitglied auf dessen Kosten alle die erforderlichen Auskünfte und Nachweise verlangen. Ziffer 1.1.3 Satz 2 und 3 gelten entsprechend. Das Ruhen der Clearing-Lizenz kann auch für die Dauer des Verzuges nach Ziffer 1.7.1 ff. angeordnet

werden.

~~(4) Sind Maßnahmen nach den Absätzen 2, 3 oder 5 ergangen, Im Fall der Beendigung oder des Ruhens einer Clearing-Mitgliedschaft dürfen Börsenteilnehmer bei einem davon betroffenen dem betreffenden Clearing-Mitglied keine neuen Positionen eröffnen; alle bestehenden Positionen sind glattzustellen oder auf ein anderes Clearing-Mitglied zu übertragen. Ein General-Clearing-Mitglied oder Direkt-Clearing-Mitglied hat seine Nicht-Clearing-Mitglieder unverzüglich zu benachrichtigen, so dass diese Vorkehrungen zur Übertragung ihrer Positionen auf ein anderes General-Clearing-Mitglied oder ein anderes konzernverbundenes Direkt-Clearing-Mitglied treffen können. Die Eurex Clearing AG überwacht die Glattstellung beziehungsweise Übertragung der offenen Positionen.~~

~~(5) Ist die Glattstellung beziehungsweise Übertragung der Positionen nicht innerhalb einer von der Eurex Clearing AG hierfür im Einzelfall gesetzten Frist abgeschlossen, kann die Eurex Clearing AG die Glattstellung vornehmen.~~

~~(6) Rücknahme, Widerruf oder Ruhen der Clearing-Lizenz entlässt das betroffene Clearing-Mitglied nicht aus seinen Rechten und Pflichten aus den bestehenden Kontrakten, für deren Clearing es zuständig ist. Die Beendigung oder das Ruhen der Clearing-Mitgliedschaft läßt die Rechte und Pflichten des betreffenden Clearing-Mitglieds aus den bestehenden Kontrakten, für deren Clearing es zuständig ist, unberührt.~~

1.1.65 Nichtübertragbarkeit

Eine Clearing-Lizenz kann nicht durch Rechtsgeschäft übergehen übertragen werden.

1.2 Teilabschnitt

Allgemeine Clearing-Bestimmungen; Haftung

1.2.1 Geschäftsabschlüsse

(1) ...

(2) Ist ein Börsenteilnehmer selbst nicht zum Clearing berechtigt (Nicht-Clearing-Mitglied), kommen Geschäfte nur über das General-Clearing-Mitglied (Ziffer 1.2.5 Absatz 1) oder das konzernverbundene Direkt-Clearing-Mitglied (Ziffer 1.2.5 Absatz 2) zustande, über das er seine Geschäfte an den Eurex-Börsen abwickelt. Wird ein von einem Nicht-Clearing-Mitglied in das System der Eurex-Börsen eingegebener Auftrag oder Quote mit einem anderen Auftrag oder Quote zusammengeführt, kommt ein Geschäft zwischen dem Nicht-Clearing-Mitglied und dem General-Clearing-Mitglied oder dem Direkt-Clearing-Mitglied und gleichzeitig ein entsprechendes Geschäft zwischen dem General-Clearing-Mitglied oder dem Direkt-Clearing-Mitglied und der Eurex Clearing AG zustande.

1.2.2 Kontraktverpflichtungen

(1) Clearing-Mitglieder mit Direkt-Clearing-Lizenz sind nach näherer Maßgabe von Ziffer 1.8.4 zur Erfüllung aller Verbindlichkeiten verpflichtet, die sich aus der Zusammenführung von Aufträgen oder Quotes (Matching) ergeben, die von ihnen sowie von konzernverbundenen Nicht-Clearing-Mitgliedern (Ziffer 1.2.1 Absatz 2) in das System der Eurex-Börsen eingegeben worden sind.

(2) ...

(3) ...

1.2.3 Einwendungen

...

1.2.4 Börsentage

...

1.2.5 Clearing-Verfahren

...

1.2.6 Haftung

...

1.3 Teilabschnitt

Sicherheitsleistung

1.3.1 Verpflichtung zur Sicherheitsleistung

...

(3) Clearing-Mitglieder können in ihrem internen Wertpapierverrechnungskonto bei der Eurex Clearing AG gebuchte und in dem Pfanddepot bei der Clearstream Banking AG oder der SegaIntersettle AG hinterlegte Aktien beziehungsweise sicherungsgezielte Wertrechte als kongruente Deckung für verkaufte Kaufoptionen (Short Calls) in diesem Basiswert bestimmen. Eine Short-Position mit kongruenter Deckung bleibt bei der Ermittlung der erforderlichen Sicherheitsleistung unberücksichtigt. Bei einer Kapitalveränderung entstehende Nebenrechte gelten nicht als kongruente Deckung.

...

1.3.2 Grundlagen der Sicherheitenermittlung

...

1.3.3 Zusätzliche Sicherheitsleistung

...

1.3.4 Sicherheiten in Geld

(1) Sicherheiten in Geld können in verschiedenen Währungen geleistet werden. Der Vorstand der Eurex Clearing AG legt fest, in welchen Währungen Sicherheiten in Geld zugelassen werden.

(2) Sicherheiten in EUR werden geleistet, indem das Clearing-Mitglied die LZB zeitgerecht beauftragt, die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten seines LZB-Kontos einzulösen und den jeweiligen Betrag auf das LZB-Konto der Eurex Clearing AG zu übertragen. Die Eurex Clearing AG schreibt den auf ihrem LZB-Konto eingegangenen Betrag dem internen Geldverrechnungskonto (Ziffer 1.4.1) des Clearing-Mitgliedes unverzüglich gut.

Sicherheiten in CHF werden geleistet, indem das Clearing-Mitglied die SNB zeitgerecht beauftragt, Abbuchungen der Eurex Clearing AG von seinem Konto zu erfüllen und an die Eurex Clearing AG zu übertragen. Die Eurex Clearing AG schreibt den vom SNB-Konto des Clearing-Mitgliedes bei der SNB abgebuchten Betrag dem internen Geldverrechnungskonto (Ziffer 1.4.1) des Clearing-Mitgliedes unverzüglich gut.

(3) Ist der Sicherheitenbetrag nicht fristgerecht (Ziffer 1.3.1 Absatz 2, Ziffer 1.3.3) auf dem LZB-Konto oder auf dem SNB-Konto der Eurex Clearing AG eingegangen, so kann die Eurex Clearing AG Maßnahmen nach den Ziffern 1.7.1 ff. ergreifen.

(4) Sicherheiten in anderen, gemäß Absatz 1 von der Eurex Clearing AG zugelassenen Währungen werden geleistet, indem das Clearing-Mitglied den als Sicherheit zu hinterlegenden Betrag auf das hierzu eingerichtete Unterkonto des jeweiligen Fremdwährungskontos der Eurex Clearing AG bei der CBF einer von dieser anerkannten Bank einzahlt. Nachdem die CBF betreffende Bank der Eurex Clearing AG die Einzahlung bestätigt hat, dass der zu leistende Betrag zur Verfügung steht, wird der auf dem Konto der Eurex Clearing AG eingegangene Betrag dem internen Sicherheitenverrechnungskonto (Ziffer 1.4.2) des Clearing-Mitgliedes unverzüglich gutgeschrieben und die Hinterlegung bei der Sicherheitenanforderung für den folgenden Börsentag berücksichtigt, sofern die Bestätigung gemäß Satz 2 spätestens 30 Minuten vor

Ende der letzten Post-Trading-Periode zugeht.

(5) Die Freigabe der gemäß Absatz 2 und 4 gestellten ~~geleisteten~~ Sicherheiten erfolgt auf Veranlassung der Eurex Clearing AG.

1.3.5 Sicherheiten in Wertpapieren und Wertrechten

(1) Sicherheiten in Wertpapieren und in Wertrechten sind von jedem Clearing-Mitglied in dem von ihm einzurichtenden Pfanddepot bei der Clearstream Banking AG oder bei der SegaIntersettle AG zu hinterlegen.

(2) Die Eurex Clearing AG legt die von ihr als Sicherheit akzeptierten Wertpapiere und Wertrechte sowie deren jeweilige Beleihungswerte fest.

(3) Zur Erbringung der Sicherheit gemäß Absatz 1 bestellt das Clearing-Mitglied der Eurex Clearing AG ein Pfandrecht an allen in dem Pfanddepot hinterlegten Wertpapieren durch Abschluss einer entsprechenden Verpfändungsvereinbarung. Das Clearing-Mitglied zeigt der Clearstream Banking AG oder der SegaIntersettle AG den Abschluss dieser Verpfändungsvereinbarung an. Soweit Clearing-Mitglieder Sicherheiten in Wertrechten leisten, werden diese der Eurex Clearing AG sicherungsgezielt; die vorstehende Regelung gilt entsprechend.

(4) Die Hinterlegung der Wertpapiere beziehungsweise der Wertrechte erfolgt, indem das Clearing-Mitglied die Clearstream Banking AG oder die SegaIntersettle AG zeitgerecht anweist, Wertpapiere in dessen Pfanddepot bei der Clearstream Banking AG oder der SegaIntersettle AG zu übertragen. Die Clearstream Banking AG beziehungsweise die SegaIntersettle AG benachrichtigt die Eurex Clearing AG von der Übertragung. Die Eurex Clearing AG bucht daraufhin den entsprechenden Wert oder die Stückzahl auf dem internen Sicherheitenverrechnungskonto (Ziffer 1.4.2) des Clearing-Mitgliedes und berücksichtigt die Hinterlegung bei der Sicherheitenanforderung für den folgenden Börsentag, sofern die Benachrichtigung durch die Clearstream Banking AG beziehungsweise die SegaIntersettle AG bis 30 Minuten vor Ende der letzten Post-Trading-Periode erfolgte.

(5) Clearing-Mitglieder können bei der Eurex Clearing AG bis 30 Minuten vor Ende der letzten Post-Trading-Periode eines jeden Börsentages die Freigabe von verpfändeten Wertpapieren oder von sicherungsgezielten Wertrechten beantragen. Der Freigabeantrag wird von der Eurex Clearing AG noch am selben Börsentag bearbeitet, und die Eurex Clearing AG vollzieht dies durch Buchung auf dem internen Sicherheitenverrechnungskonto (Ziffer 1.4.2) nach. Steht einem Antrag die Sicherheitsanforderung für den folgenden Börsentag entgegen, so gibt die Eurex Clearing AG ihre Zustimmung an die Clearstream Banking AG oder die SegaIntersettle AG erst weiter, wenn der Fehlbetrag bis zu dem von der Eurex Clearing AG bestimmten Zeitpunkt, grundsätzlich aber vor Handelsbeginn des nächsten Börsentages, in bar ausgeglichen worden ist.

(6) ...

(7) ...

1.4 Teilabschnitt

Konten der Clearing-Mitglieder

1.4.1 Geldverrechnungskonten

...

1.4.2 Sicherheitenverrechnungskonto

...

1.5 Teilabschnitt

Entgelte

1.5.1 Clearing-Mitgliedschaft

1.5.2 Transaktionen

1.6 Teilabschnitt

Garantiefonds Clearing-Fonds

1.6.1 Clearing-Garantie Beitrag zum Clearing-Fonds

(1) Unbeschadet der anderweitigen Sicherheitsleistungen ist jedes Clearing-Mitglied zur Leistung eines Beitrags zum Clearing-Fonds verpflichtet. Die Höhe des zu leistenden Beitrags wird für jedes Clearing-Mitglied von der Eurex Clearing AG festgesetzt.

Clearing-Mitglieder mit einer General-Clearing-Lizenz müssen eine Clearing-Garantie über EUR 5 Millionen oder CHF 8,5 Millionen, Clearing-Mitglied mit einer Direkt-Clearing-Lizenz eine solche über EUR 1 Million oder CHF 1,7 Millionen beibringen.

Der Beitrag ist durch Bankgarantien und/oder Sicherheiten in Geld oder Wertpapieren zu leisten. Ziffern 1.1.2 Absatz 2 Satz 2 bis 7 gelten entsprechend.

(2) Die Eurex Clearing AG kann bildet aus ihrem Jahresüberschuss nach eigenem Ermessen Rücklagen für den Clearing-Fonds bilden, um zur Erfüllung der Pflichten eines in Verzug geratenen Clearing-Mitgliedes beizutragen.

1.6.2 Inanspruchnahme der Clearing-Garantie Verwertung des Clearing-Fonds

(1) Der von einem Clearing-Mitglied geleistete Beitrag zum Clearing-Fonds kann zur Behebung finanzieller Folgen eines Verzuges (Ziffer 1.7.1) dieses sowie anderer Clearing-Mitglieder in Anspruch genommen werden.

(2) Im Falle eines Schadensausgleiches wegen Verzuges (Ziffer 1.7.1) wird die Eurex Clearing AG Sicherheiten in nachstehender Reihenfolge verwerten:

1. die Sicherheitsleistungen des in Verzug geratenen Andere Sicherheiten des erfüllungspflichtigen Clearing-Mitglieds als solche gemäß Ziffer 1.6.1,
2. dessen Clearing-Garantie Beitrag des erfüllungspflichtigen Clearing-Mitglieds zum Clearing-Fonds gemäß Ziffer 1.6.1,
3. die Mittel Rücklagen der Eurex Clearing AG nach gemäß Ziffer 1.6.1 Absatz 3 2, und
4. die Clearing-Garantien der anderen Clearing-Mitglieder verwerten. die Beiträge aller anderen Clearing-Mitglieder zum Clearing-Fonds.

Die Clearing-Garantien der anderen Beiträge der anderen Clearing-Mitglieder zum Clearing-Fonds werden zu einem prozentual gleichen Anteil in Anspruch genommen verwertet.

(3) Leistet ein Erbringt ein im Verzug (Ziffer 1.7.1) befindliches Clearing-Mitglied die von ihm verlangte Sicherheit, nachdem die Eurex Clearing AG Clearing-Garantien anderer Clearing-Mitglieder in Anspruch genommen hat, entschädigt die Eurex Clearing AG diese Clearing-Mitglieder mit einem prozentual gleichen Anteil, maximal bis zu der Höhe der jeweiligen Inanspruchnahme. die von ihm geschuldeten Leistungen nach Verwertung der Beiträge der anderen Clearing-Mitglieder zum Clearing-Fonds (Absatz 2 Nr. 4), stockt die Eurex Clearing AG aus dieser Leistung die Beiträge der anderen Clearing-Mitglieder mit einem prozentual gleichen Anteil, höchstens bis zum Betrag der erfolgten Verwertung auf.

1.6.3 Wiederaufstockung der Clearing-Garantien Beiträge zum Clearing-Fonds

Verwertete Beiträge zum Clearing-Fonds sind von den Clearing-Mitgliedern innerhalb von zehn Börsentagen nach ihrer Inanspruchnahme sind Clearing-Garantien wieder auf den ursprünglichen Betrag aufzustocken. Diese Verpflichtung gilt nicht für ein Clearing-Mitglied, das seine Clearing-Lizenz durch schriftliche Anzeige spätestens am fünften der Inanspruchnahme folgenden Börsentag an die Eurex Clearing AG zurückgegeben Erklärung gegenüber der Eurex Frankfurt AG spätestens am fünften der Verwertung folgenden Börsentag beendet hat.

1.6.4 Rückgabe von Clearing-Garantien Freigabe der Beiträge zum Clearing-Fonds

(1) Widerruft oder nimmt die Eurex Clearing AG die Clearing-Lizenz zurück oder gibt das Clearing-Mitglied diese zurück, erlischt Beendet die Eurex Clearing AG oder ein Clearing-Mitglied die Clearing-Mitgliedschaft, gibt die Eurex Clearing AG die Clearing-Garantie den Beitrag des betreffenden Clearing-Mitglieds zum Clearing-Fonds einen Monat nach Bekanntgabe des Widerrufs, der Rücknahme oder der Rückgabe Erklärung der Beendigung, frühestens jedoch einen Monat nach dem Tag, an dem alle Kontrakte auf den Konten, für deren Clearing das betreffende Clearing-Mitglied zuständig ist, abgewickelt worden sind, frei. Entsprechendes gilt für Bankgarantien Sicherheiten gemäß Ziffer 1.1.2 Absatz 2.

(2) Ist ein anderes Clearing-Mitglied zum Zeitpunkt des Widerrufs oder der Rückgabe der Beendigung der Clearing-Lizenz Mitgliedschaft in Verzug oder gerät ein anderes Clearing-Mitglied vor dem Datum in Verzug, an welchem das Mitglied seine Clearing-Garantie zurücknehmen will ein Beitrag zum Clearing-Fonds freizugeben ist, erlischt die Clearing-Garantie erfolgt die Freigabe entgegen Absatz 1 erst, nachdem die Verpflichtungen des in Verzug geratenen anderen Clearing-Mitgliedes gegenüber der Eurex Clearing AG vollständig erfüllt sind.

1.7 Teilabschnitt

Verzug

1.7.1 Eintritt des Verzuges

...

1.7.2 Technischer Verzug

...

1.7.3 Glattstellung, Sicherheitenverwertung

Beindet sich ein Clearing-Mitglied in Verzug nach Ziffer 1.7.1, wird die Eurex Clearing AG in nachstehender Reihenfolge Positionen glattstellen und Sicherheiten verwerten:

1. ...

2. Verwertung der Geld- und Wertpapiersicherheiten aller Sicherheiten des in Verzug befindlichen Clearing-Mitgliedes sowie Inanspruchnahme einschließlich der dessen Clearing-Garantie Beitrag zum Clearing-Fonds und der Bankgarantie gemäß Ziffer 1.1.2 Abs. 1 1.6.1 Absatz 1 dieses Clearing-Mitgliedes.

3. Erstattung eines Überschusses, falls der Erlös aus der Verwertung der Sicherheiten und der Inanspruchnahme der Clearing-Garantie sowie der Bankgarantie gemäß Ziffer 1.1.2 Abs. 1 des in Verzug geratenen Clearing-Mitgliedes einen höheren Betrag ergibt, als für die Abdeckung aller Verbindlichkeiten des Clearing-Mitgliedes aus Geschäften an den Eurex-Börsen erforderlich ist.

4. Verwendung der von der Eurex Clearing AG gemäß Ziffer 1.6.1 Absatz 2 bereitgestellten Mittel, falls der Erlös aus der Verwertung der Sicherheiten und der Inanspruchnahme des Beitrags zum Clearing-Fonds sowie der Sicherheiten gemäß Ziffer 1.1.2 Abs. 2 des in Verzug geratenen Clearing-Mitgliedes nicht zur Abdeckung Erfüllung seiner Verbindlichkeiten aus Geschäften an den Eurex-Börsen ausreicht.

~~5 Anteilige Inanspruchnahme der Clearing-Garantien Beiträge der nicht in Verzug befindlichen Clearing-Mitglieder zum Clearing-Fonds gemäß Ziffer 1.6.2 Absatz 2 Nr. 4, falls auch die von der Eurex Clearing AG gemäß Ziffer 1.6.1 Absatz 3 bereitgestellten Mittel nicht zur Abdeckung der Verbindlichkeiten des Clearing-Mitgliedes aus Geschäften an den Eurex-Börsen ausreichen.~~