
ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Kapitel II

[...]

Abschnitt 2 Clearing von Futures-Kontrakten

Die nachfolgenden Bestimmungen regeln das Clearing von Transaktionen in den in Ziffer 1 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Futures-Kontrakte („**Eurex-Kontraktsspezifikationen**“).

[...]

2.3 Clearing von Fixed Income Futures-Kontrakten

Die nachfolgenden Bestimmungen regeln das Clearing von Transaktionen in den in Ziffer 1.2 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Fixed Income Futures-Kontrakte.

[...]

2.3.5 Nichtlieferung

- (1) Liefert das Clearing-Mitglied die von ihm zu liefernden Schuldverschreibungen nicht am Liefertag (entsprechend Ziffer 2.3.1) gemäß den Weisungen der Eurex Clearing AG, so hat die Eurex Clearing AG das Recht, folgende Maßnahmen zu treffen:

- Die Eurex Clearing AG ist berechtigt, die zu liefernden Schuldverschreibungen im Wege der Wertpapierleihe zu besorgen und sie dem nicht fristgerecht belieferten Clearing-Mitglied zu liefern.
- Die Eurex Clearing AG ist berechtigt, eine andere als die notifizierten Schuldverschreibungen aus dem Korb der lieferbaren Anleihen als zu lieferndes Wertpapier zu bestimmen und diese nach vorheriger Anzeige dem nicht fristgerecht belieferten Clearing-Mitglied zu liefern. Das säumige Clearing-Mitglied hat in diesem Falle die so von der Eurex Clearing AG notifizierten Schuldverschreibungen zu liefern. Die Eurex Clearing AG ist berechtigt, die so notifizierten Schuldverschreibungen im Wege der Wertpapierleihe zu besorgen und sie dem nicht fristgerecht belieferten Mitglied zu liefern.
- Werden die zu liefernden Schuldverschreibungen nicht spätestens am fünften Geschäftstag nach dem Liefertag mit der Standarddisposition der jeweiligen Abwicklungsstelle an die Eurex Clearing AG geliefert, ist die Eurex Clearing AG berechtigt, die nicht gelieferten Stücke einzudecken. Die Eindeckung kann ab dem fünften Geschäftstag nach dem Liefertag über ein Eindeckungsgeschäft erfolgen.

Die eingedeckten Schuldverschreibungen wird die Eurex Clearing AG an das nicht fristgerecht belieferte Clearing-Mitglied liefern.

- (2) Das nicht fristgerecht belieferte Clearing-Mitglied muss die Maßnahmen gemäß Absatz (1) gegen sich gelten lassen.
- (3) Die Kosten, die durch Maßnahmen nach Absatz (1) entstanden sind, hat das Clearing-Mitglied, das gegen seine Lieferpflicht verstoßen hat, zu tragen.
- (4) Liefert das Clearing-Mitglied die von ihm zu liefernden Schuldverschreibungen nicht am Liefertag, zahlt das Clearing-Mitglied, das gegen seine Lieferpflicht verstoßen hat, der Eurex Clearing AG eine Entschädigung für den Zeitraum ab dem Lieferungstag (einschließlich) bis zum (a) Tag der tatsächlichen Lieferung (ausschließlich) oder (b) dem Tag eines Ersatzkaufes (ausschließlich) (wobei auf den jeweils früheren Termin abzustellen ist) in folgender Höhe:
 - bei Euro-Fixed Income Futures-Kontrakten: 0,40 Prozent vom Nominalwert der ausstehenden Lieferung pro Geschäftstag, liefert das säumige Clearing-Mitglied geschuldete Schuldverschreibungen der Bundesrepublik Deutschland am Liefertag nach Ablauf des ersten im zweiten Same Day Settlement-Buchungslauf der Clearstream Banking AG, aber vor Ablauf des zweiten Same Day Settlement-Buchungslauf der Clearstream Banking AG reduziert sich die vorgenannte Vertragsstrafe auf 0,04 Prozent vom Nominalwert der ausstehenden Lieferung; oder

- bei CONF Futures Kontrakten: 0,85 Prozent vom Nominalwert der ausstehenden Lieferung pro Geschäftstag,

in beiden Fällen jeweils zuzüglich eines Betrages pro Kalendertag der gemäß dem von der Eurex Clearing AG im Voraus festzulegenden und bekannt zu gebenden Prozentsatz des Gegenwerts der zur Lieferung angezeigten Schuldverschreibungen berechnet wird; der Prozentsatz orientiert sich:

- bei Euro-Fixed Income Futures-Kontrakten am Satz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der Europäischen Zentralbank zuzüglich 100 Basispunkte; und
- bei CONF Futures Kontrakten am Satz der Engpassfinanzierungsfazilität der Schweizerischen Nationalbank zuzüglich 100 Basispunkte.

Die vorgenannten Zinssätze werden auf den Internetseiten der Europäischen Zentralbank und der Schweizerischen Nationalbank veröffentlicht.

Zur Klarstellung sei angemerkt, dass die Bestimmungen dieser Ziffer 2.3.5 Abs. (4) zusätzlich zu Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 14.2 gelten.

- (5) Die Geltendmachung eines weiteren Schadens sowohl der Eurex Clearing AG als auch des nicht fristgerecht belieferten Clearing-Mitglieds bleibt unberührt.

[...]
