
ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Kapitel I Allgemeine Bestimmungen

[...]

Abschnitt 3 Sicherheitsleistung und Sicherungsrechte

[...]

3.4 Sicherheiten in Wertpapieren und Wertrechten

- (1) [...]
- (2) [...]
- (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 SegalIntersettle AG den Abschluss dieser Verpfändungsvereinbarung an. Soweit Clearing-Mitglieder Sicherheiten in Wertrechten leisten, werden diese der Eurex Clearing AG sicherungszediert; die vorstehende Regelung gilt entsprechend. Abweichend von Absatz 1 kann ein Clearing-Mitglied Sicherheiten durch Verpfändung oder Sicherungszession auch unter Nutzung des Sicherheitenverwaltungssystems Xemac[®] („Xemac“) der Clearstream Banking AG auf Basis der hierfür geltenden Sonderbedingungen Sicherheitenverwaltung („SB Xemac“) bestellen. Die Maßgabe des Absatzes 1 Satz 2 gilt auch insoweit. Im Zusammenhang mit der Bestellung von Sicherheiten gegenüber der Eurex Clearing AG über Xemac kann ein Clearing-Mitglied auch Wertpapiere oder Wertrechte nutzen, die es im Rahmen von GC Pooling ECB Basket Repo Geschäften – entsprechend Ziffer 3.3.1 der Geschäftsbedingungen für die Teilnahme und den Handel an der Eurex Repo GmbH

Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

– als Sicherheiten erhalten hat (Re-use i.S. Nr. 28 Absatz 1 (b) SB Xemac).
Abweichend von Absatz 1 Satz 1 kann ein Clearing-Mitglied, das am Handel von GC
Pooling Repos teilnimmt, bei Nutzung des für den Re-use vorgesehenen
Vertragstypus in Xemac, die Sicherheitenstellung in Xemac auf Antrag auch über
das Konto eines Abwicklungsinstitutes i.S. Kapitel IV Ziffer 1.1.2 Absatz 2 b)
vornehmen, soweit dieses seinen Sitz in Deutschland hat.

- (4) Die Hinterlegung der Wertpapiere bzw. der Wertrechte erfolgt, indem das Clearing-Mitglied die Clearstream Banking AG oder die SegalIntersettle AG zeitgerecht anweist, Wertpapiere in dessen Pfanddepot bei der Clearstream Banking AG oder der SegalIntersettle AG zu übertragen. Die Clearstream Banking AG bzw. die SegalIntersettle 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 4.4) des Clearing-Mitgliedes und berücksichtigt die Hinterlegung bei der Sicherheitenanforderung unmittelbar nach der Benachrichtigung durch die Clearstream Banking AG bzw. durch die SegalIntersettle AG, sofern die Benachrichtigung bis zu dem von der Eurex Clearing AG für den betreffenden Markt festgelegten Zeitpunkt erfolgte. Werden nicht als Sicherheit akzeptierte Wertpapiere oder Wertrechte in das Pfanddepot übertragen, so veranlasst die Eurex Clearing AG eine Rückbuchung. Im Zusammenhang mit der Bestellung von Sicherheiten über Xemac gelten die nach den SB Xemac hierfür festgelegten Prozesse.

(5) [...]

(6) [...]

(7) [...]

[...]

Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

[...]

Kapitel II Geschäfte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich (Eurex-Börsen)

[...]

Abschnitt 2 Clearing von Futures-Kontrakten

[...]

2.2 Teilabschnitt Clearing von Geldmarkt-Futures-Kontrakten

Die nachfolgenden Ziffern regeln das Clearing von Geschäften in den in Ziffer 1.1 der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Geldmarkt-Futures-Kontrakte.

2.2.1 Verfahren bei Zahlung

[...]

2.2.2 Schlussabrechnungspreis

(1) [...]

(2) [...]

(3) Bei der Festlegung des Schlussabrechnungspreises wird der EONIA-Durchschnittszinssatz sowie der für Dreimonats-Termingeld ermittelte Referenz-Zinssatz EURIBOR ~~kaufmännisch~~ auf drei Nachkommastellen das nächstmögliche Preisintervall (0,005; 0,01 oder ein Vielfaches) gerundet und anschließend von 100 subtrahiert. Bei der Rundung auf die dritte Nachkommastelle wird nachfolgend beschriebenes Verfahren angewendet. Die Werte von 1 bis 5 der vierten Nachkommastelle werden abgerundet und bei den Werten von 6 bis 9 wird aufgerundet. (Beispiel: wird ein EURIBOR-Zinssatz von 1,2235 festgestellt, wird auf 1,223 gerundet und dann von 100 subtrahiert).

[...]