

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:  
ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN,  
LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN.

\*\*\*\*\*

## Kapitel I Allgemeine Bedingungen

[...]

### Abschnitt 1 Allgemeine Clearing-Bestimmungen

[...]

#### 1.2 Clearing-Verfahren

[...]

[...]

#### 1.2.4 Einzelne Begriffsbestimmungen und Auslegung

[...]

(2) Die „Clearingwährung“ ist entweder Euro („EUR“), ~~oder~~ Schweizer Franken („CHF“) oder Britisches Pfund („GBP“), so wie zwischen der Eurex Clearing AG und dem Clearing-Mitglied in Bezug auf jede Grundlagenvereinbarung schriftlich bestimmt.

[...]

[...]

#### 1.4 Abwicklung von Transaktionen

[...]

[...]

#### 1.4.1 Zahlung von Geldbeträgen

(1) Um Geldzahlungen in ~~EUR~~uro zu leisten, ist das Clearing-Mitglied verpflichtet, die Bank seines RTGS-Kontos oder euroSIC-Kontos (wie jeweils in Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) (aa) ~~und (bb)~~) definiert) anzuweisen, die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten dieses Geldkontos einzulösen.

- (2) Um Geldzahlungen in ~~Schweizer Franken~~CHF zu leisten, ist das Clearing-Mitglied verpflichtet, die Schweizerische Nationalbank („SNB“) anzuweisen, die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten seines ~~SIC-Kontos~~SNB-Kontos (wie in Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) (bb) definiert) einzulösen. ~~Für Clearing-Mitglieder, denen gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziff. 2.1.2 (4) (b) (bb) gestattet ist, die Kontoführung bei einer von der Eurex Clearing AG anerkannten Korrespondenzbank vorzunehmen, gilt die Verpflichtung entsprechend bezogen auf diese Korrespondenzbank.~~
- (3) Nutzt das Clearing-Mitglied ein Geldkonto bei einer Korrespondenzbank gemäß Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) (ee), stellt das Clearing-Mitglied sicher, dass die Korrespondenzbank die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten dieses Geldkontos einlöst. Nutzt das Clearing-Mitglied ein Geldkonto bei einer Abwicklungsbank gemäß Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) (ff), stellt das Clearing-Mitglied sicher, dass die Abwicklungsbank die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten dieses Geldkontos einlöst. Nutzt das Clearing-Mitglied ein Geldkonto, das im Namen einer Bank bei einer Abwicklungsbank eröffnet wurde, gemäß Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) (gg), stellt das Clearing-Mitglied sicher, dass die Abwicklungsbank die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten dieses Geldkontos einlöst. Wenn die Eurex Clearing AG die Nutzung von Geldkonten einer Korrespondenzbank gemäß Ziffer 2.1.2 Abs. (4) (b) erlaubt hat, hat das Clearing-Mitglied dafür zu sorgen, dass die von der Eurex Clearing AG eingehenden Lastschriften zu Lasten dieses Kontos eingelöst werden.
- (4) Um Geldzahlungen in anderen Währungen als ~~EUR~~uro und ~~CHF~~Schweizer Franken zu leisten, ist das Clearing-Mitglied verpflichtet, die Abwicklungsbank ~~seine Bank~~ für die betreffende Währung anzuweisen, die von der Eurex Clearing AG eingegangenen Lastschriften zu Lasten ~~dieses des relevanten Geldk~~Kontos einzulösen.
- (5) Um Geldzahlungen in Bezug auf die Margin in einer anderen Währung als von der Eurex Clearing AG akzeptierten ~~Clearing~~Währungen ~~außer Euro und Schweizer Franken~~ zu leisten, hat das Clearing-Mitglied die jeweiligen Geldbeträge bis zu dem von der Eurex Clearing AG in Bezug auf die jeweilige Währung angegebenen Tag auf das dem Clearing-Mitglied von der Eurex Clearing AG jeweils mitgeteilte Konto zu überweisen. Das Clearing-Mitglied kann seine ~~Abwicklungsb~~Bank für in Bezug auf die betreffende Währung anweisen, die von der Eurex Clearing AG eingegangenen Lastschriften zu Lasten dieses Kontos einzulösen.

[...]

[...]

## 2 Clearing-Mitglieder

### 2.1 Clearing-Lizenz

[...]

[...]

#### 2.1.2 Allgemeine Voraussetzungen für Clearing-Lizenzen

[...]

(4) Der Antragsteller verfügt über die folgenden Konten:

[...]

[...]

(b) Geldkonten:

(aa) für Geldzahlungen in ~~EUR~~uro: (i) ein Konto innerhalb des Zahlungsmoduls bei einer Zentralbank des Eurosystems, die mit ihrem ~~TARGET~~target2-Komponentensystem an ~~TARGET~~target2 teilnimmt oder ein Konto bei einer anderen Zentralbank, die keine Zentralbank des Eurosystems ist und aufgrund einer besonderen Vereinbarung an ~~TARGET~~target2 angeschlossen ist (nachfolgend „~~RTGS-Konto~~“); (ii) ein Konto bei der ~~SECB Swiss Euro Clearing Bank GmbH (das „SECB-Konto“)~~ und ein ~~euroSIC-Konto bei der SIX Interbank Clearing AG (beide Konten zusammen das „euroSIC-Konto“)~~; (iii) ein Konto bei einer ~~Korrespondenzbank gemäß (ee)~~, (iv) ein Konto bei einer Abwicklungsbank gemäß (ff), oder (v) ein Konto bei einer Bank, die ein Konto bei einer ~~Abwicklungsbank unterhält gemäß (gg)~~;

(bb) für Geldzahlungen in ~~Schweizer Franken~~CHF: (i) ein Konto bei der ~~SNB Schweizerischen Nationalbank (das „SNB-Konto“)~~ und ein Konto bei der SIX Interbank Clearing AG (beide Konten ~~nachfolgend~~ zusammen ~~das „SIC-Konto“~~); ~~Clearing-Mitglieder mit Sitz außerhalb der Schweiz und ohne Niederlassung in der Schweiz, die als Clearingwährung nicht Schweizer Franken gewählt haben, können das SIC-Konto durch ein Konto bei einer durch die Eurex Clearing AG anerkannten Korrespondenzbank ersetzen;~~ und (ii) ein Konto bei einer Korrespondenzbank gemäß (ee), (iii) ein Konto bei einer Abwicklungsbank gemäß (ff), oder (iv) ein Konto bei einer Bank, die ein Konto bei einer Abwicklungsbank unterhält gemäß (gg);

(cc) für Geldzahlungen in GBP: (i) ein Konto bei einer Abwicklungsbank gemäß (ff), oder (ii) ein Konto bei einer Bank, die ein Konto bei einer ~~Abwicklungsbank unterhält gemäß (gg)~~

(jedes RTGS-Konto und SIC-Konto jeweils ein „Zentralbank-Konto“):  
und,

~~(dde)~~ sofern das Clearing-Mitglied von der Möglichkeit Gebrauch machen möchte, Eurex-Entgelte (wie in Ziffer 5.1 definiert) nach Ziffer 1.4.1 Abs. (6) zu zahlen, ein Konto bei einer Bank für die jeweils betreffende Währung-

(alle diese Konten zusammen mit allen anderen in den Besonderen Clearing-Bedingungen vorgesehenen Geldkonten die „**Geldkonten des Clearing-Mitglieds**“).

~~(ee) Die Eurex Clearing AG kann auf schriftlichen Antrag die Nutzung von nach Absatz (4) (b) erforderlichen Geldkonten bei einer von der Eurex Clearing AG anerkannten Korrespondenzbank gestatten. Der Antragssteller kann für Geldzahlungen in EUR und CHF ein Zentralbank-Konto nutzen, das im Namen einer anderen Bank geführt wird (die „Korrespondenzbank“).~~

~~(ff) Der Antragssteller kann ein Konto bei einer durch die Eurex Clearing AG anerkannten Geschäftsbank nutzen („Abwicklungsbank“). Für Geldzahlungen in EUR, CHF und GBP finden die folgenden Vorschriften Anwendung:~~

~~(i) Die Abwicklungsbank darf nicht dem Konzernverbund des Antragstellers angehören. Art und Umfang des Konzernverbunds werden von der Eurex Clearing AG bestimmt.~~

~~(ii) Jede Zahlungsverpflichtung des Antragstellers gegenüber der Eurex Clearing AG, die unter der relevanten Clearing-Vereinbarung, Grundlagenvereinbarung oder Transaktion entsteht, gilt nur dann als erfüllt, wenn der entsprechende Geldbetrag auf dem bestimmten TARGET2-Konto der Eurex Clearing AG, dem Konto der Eurex Clearing AG bei der SNB oder der Bank of England (beide ein „ECAG Zentralbank-Konto“) oder dem Konto der Eurex Clearing AG bei der SIX Interbank Clearing AG bzw. bei der Swiss Euro Clearing Bank GmbH (beide ein „ECAG euroSIC-Konto“) gutgeschrieben wurde. Die Eurex Clearing AG stellt sicher, dass sie die Abwicklungsbank unverzüglich nach jeder Gutschrift eines Geldbetrages auf ihrem Konto bei der Abwicklungsbank anweist, diesen Geldbetrag auf das entsprechende ECAG Zentralbank-Konto oder das ECAG euroSIC-Konto zu überweisen.~~

~~(iii) Jede Zahlungsverpflichtung der Eurex Clearing AG gegenüber dem Antragsteller, die unter der relevanten Clearing-Vereinbarung, Grundlagenvereinbarung oder Transaktion entsteht, gilt bereits dann als erfüllt, wenn der entsprechende Geldbetrag auf dem relevanten Konto der Eurex Clearing AG bei der Abwicklungsbank gutgeschrieben wurde. Die Eurex Clearing AG stellt sicher, dass sie die Abwicklungsbank unverzüglich nach jeder Gutschrift eines Geldbetrages auf ihrem Konto bei der Abwicklungsbank anweist,~~

diesen Geldbetrag auf das Konto des Antragsstellers bei der Abwicklungsbank zu überweisen.

(iv) Mit dem Eingehen einer Clearing-Vereinbarung mit der Eurex Clearing AG sichert der Antragssteller im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantiever sprechens in Bezug auf sich selbst gegenüber der Eurex Clearing AG zu und gewährleistet, dass er die Eurex Clearing AG von sämtlichen Schäden und Verlusten, die aus (a) der Nichtüberweisung des relevanten Geldbetrages von dem Konto der Eurex Clearing AG bei der Abwicklungsbank auf das relevante Zentralbank-Konto der Eurex Clearing AG oder (b) der Nichtüberweisung des relevanten Geldbetrages von dem Konto der Eurex Clearing AG bei der Abwicklungsbank auf das relevante Konto des Antragsstellers bei der Abwicklungsbank entstehen können, freizustellen, es sei denn die Nichtüberweisung basiert auf einem vorsätzlichen Handeln oder Unterlassen der Eurex Clearing AG. Die Eurex Clearing AG tritt sämtliche Ansprüche, die sie im Zusammenhang mit der Nichtüberweisung gegenüber der Abwicklungsbank erwirbt, an den Antragssteller ab.

(gg) Der Antragssteller kann ein Konto bei einer Abwicklungsbank nutzen, das im Namen einer anderen Bank geführt wird. Die Vorschriften unter (ff) gelten entsprechend.

[...]

[...]

[...]

## **14 Haftung, Notfallmaßnahmen, Vertragsstrafen, Delegation**

[...]

### **14.2 Disziplinarverfahren; Vertragsstrafen**

[...]

**14.2.2** Bei Eintritt eines Beendigungsgrundes gemäß Ziffer 7.2.1 Abs. (1) oder im Falle der Nichtlieferung von Wertpapieren oder sonstiger Vermögenswerte oder einer Nichtbereitstellung von Geldbeträgen im Rahmen einer Physischen Lieferung gemäß den Besonderen Clearing-Bestimmungen – unabhängig davon, ob die Eurex Clearing AG Schäden erlitten hat – , es sei denn, eine solche Nichtlieferung von Wertpapieren oder sonstiger Vermögenswerte oder eine solche Nichtbereitstellung von Geldbeträgen beruht auf höherer Gewalt und/oder einer allgemeinen Markt- oder Systemstörung außerhalb der Kontrolle des Clearing-Mitglieds, hat das Clearing-Mitglied eine Vertragsstrafe in Höhe von 0,025 Prozent des jeweils ungezahlten fälligen Betrags, jedoch mindestens EUR 2.500 – oder den entsprechenden Gegenwert in CHFFeiner durch die Eurex Clearing AG festgelegten anderen Clearingwährung – pro Kalendertag

auf Anweisung der Eurex Clearing AG zu zahlen, jedoch höchstens EUR 25.000 oder den entsprechenden Gegenwert in ~~CHF~~einer durch die Eurex Clearing AG festgelegten anderen Clearingwährung. Übersteigt der aus dem vorstehenden Prozentsatz errechnete Betrag EUR 25.000, so wird die Höhe der Vertragsstrafe – ungeachtet der Bestimmungen in Satz 1 – nach einem Prozentsatz des jeweils ungezahlten fälligen Betrags berechnet, wobei dieser Prozentsatz durch die Eurex Clearing AG im Voraus festgelegt und mitgeteilt wurde. Dieser Prozentsatz basiert auf dem jeweils für die betreffende Clearingwährung geltenden Tageszinssatz.

[...]

[...]

\*\*\*\*\*