

Kapitel VIII der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

# Clearing von OTC-Zinsderivat-Transaktionen, OTC-FX-Transaktionen und OTC-XCCY- Transaktionen

Stand 02.07.2018

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 02.07.2018
	Seite 1

\*\*\*\*\*

## ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

**ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN**

**LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN**

\*\*\*\*\*

[...]

### Abschnitt 3 Clearing von OTC-FX-Transaktionen

[...]

#### 3.2 Produktbezogene Bestimmungen für OTC-FX-Transaktionen

[...]

##### 3.2.1 Zahlungsverpflichtungen

(1) [...]

Vorbehaltlich Ziffer 3.2.2.3 und ~~dieser~~-Ziffer 3.2.1 Absatz (1)(d), sind alle gemäß dieser Ziffer 3.2.1 von dem Clearing-Mitglied an die Eurex Clearing AG zu leistenden Zahlungen (mit Ausnahme von Zahlungen von dem Clearing-Mitglied in Bezug auf den jeweiligen Vorauszahlungsbetrag) in Bezug auf jede Währung des Währungspaars - auf Netto-Basis bis spätestens 7:30 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) (der „**CLS-Zeitpunkt**“) direkt auf das betreffende CLS-Zentralbankkonto über den CLS-CCP-Service zu leisten (die Zeitvorgabe ist hierbei wesentlich). Die Bestimmungen des § 376 Handelsgesetzbuch finden jedoch keine Anwendung.

[...]

(2) [...]

(a) [...]

Haben sich die betreffenden Zahlungsverpflichtungen des Clearing-Mitglieds in Bezug auf OTC-Währungs-Transaktionen nach der Zahlung des betreffenden Vorauszahlungsbetrags verringert, so ist die Eurex Clearing AG nicht

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 02.07.2018
	Seite 2

verpflichtet, den betreffenden Anteil dieses Vorauszahlungsbetrags zurückzuzahlen, sondern wird den betreffenden vollen Vorauszahlungsbetrag mit den Zahlungsverpflichtungen des Clearing-Mitglieds in Bezug auf OTC-Währungs-Transaktionen am betreffenden Abwicklungstag verrechnen. Sofern sich die betreffenden Zahlungsverpflichtungen des Clearing-Mitglieds in Bezug auf OTC-Währungs-Transaktionen soweit verringert haben, dass sie unterhalb des betreffenden Vorauszahlungsbetrags liegen, wird die Eurex Clearing AG den Anteil des betreffenden Vorauszahlungsbetrags, der am betreffenden Abwicklungstag nicht mit den betreffenden Zahlungsverpflichtungen des Clearing-Mitglieds in Bezug auf OTC-Währungs-Transaktionen verrechnet werden konnte, ~~durch Zahlung außerhalb des CLS-CCP-Service~~ an den Vorauszahlungsbetrag-Zahler zurückzahlen. Diese Rückzahlung ist in Bezug auf jede Währung der Währungspaare direkt auf das betreffende Währungsprodukte-Geldkonto des Vorauszahlungsbetrag-Zahlers über den CLS-CCP-Service zu leisten.

[...]

## Abschnitt 4 Clearing von OTC-XCCY-Transaktionen

[...]

### 4.2 Allgemeine produktbezogene Bestimmungen für OTC-XCCY-Transaktionen

[...]

#### 4.2.1 Zahlungsverpflichtungen

(1) [...]

Vorbehaltlich ~~Etwaige gemäß~~ Ziffer 4.2.2.3 und ~~dieser~~ Ziffer 4.2.1 Absatz (1)(d), sind alle gemäß dieser Ziffer 4.2.1 von dem Clearing-Mitglied an die Eurex Clearing AG zu leistenden~~n~~ Zahlungen (mit Ausnahme von Zahlungen von dem Clearing-Mitglied in Bezug auf den jeweiligen Vorauszahlungsbetrag) ~~sind bis zum CLS-Zeitpunkt~~ – in Bezug auf jede Währung der Währungspaare – auf Nettobasis bis spätestens zum CLS-Zeitpunkt ~~und~~ direkt auf das betreffende CLS-Zentralbankkonto über den CLS-CCP-Service zu leisten (die Zeitvorgabe ist hierbei wesentlich). Die Bestimmungen des § 376 Handelsgesetzbuch finden jedoch keine Anwendung.

[...]

[...]

\*\*\*\*\*