

Kapitel II der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

Transaktionen an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

(Eurex-Börsen)

Stand 19.09.2017

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 2 Clearing von Futures-Kontrakten

[...]

2.1.2 Täglicher Abrechnungspreis

[...]

(5) Referenzzeiten

Kontrakt	Referenzzeit (MEZ)
[...]	
Alle weiteren Index Dividenden Futures	17:30
Alle weiteren Index-Futures	17:30
CECE® EUR Futures	17:10
CONF-Futures	17:00
ETC-Futures	17:30
Eurex KOSPI-Daily-Futures-Kontrakte	17:30
Fixed Income Futures (in Euro denominiert)	17:15
<u>Bond Index Futures</u>	<u>17:15</u>
FX Futures	17:30 (15:00 an jedem Verfallstag einer Serie / dritten Mittwoch des Verfallsmonats für den verfallenden Kontrakt)
FX Rolling Spot Futures	17:00
[...]	

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 19.09.2017
	Seite 3

[...]

2.23 Clearing von Bond-Index-Futures-Kontrakten

Die nachfolgenden Bestimmungen regeln das Clearing von Transaktionen in den in Ziffer 1.24 der Eurex-Kontraktsspezifikationen benannten Bond-Index-Futures-Kontrakte.

2.23.1 Verfahren bei Zahlung

Alle Zahlungen erfolgen an dem Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.24.4 der Eurex-Kontraktsspezifikationen) folgenden Geschäftstag. Alle Clearing-Mitglieder haben ihre Zahlungsfähigkeit am Fälligkeitstag durch entsprechende Guthaben auf dem RTGS-Konto oder dem euroSIC-Konto sicherzustellen.

2.23.2 Schlussabrechnungspreis

Der Schlussabrechnungspreis der Bond-Index-Futures-Kontrakte wird von der Eurex Clearing AG am Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.24.4 der Eurex-Kontraktsspezifikationen) eines Kontrakts festgelegt.

- (1) Maßgebend für die EURO STOXX 50® Corporate Bond Index Futures-Kontrakte auf Preis-Indizes ist der Schlussstand des Preis-Index am letzten Handelstag.
- (2) Sollten außergewöhnliche Umstände vorliegen, insbesondere (i) wenn aufgrund technischer Probleme der Handel aussetzt, (ii) wenn der ermittelte Schlussabrechnungspreis nicht den tatsächlichen Marktverhältnissen entspricht oder (iii) wenn es aus sonstigen Gründen nicht zu einer Preisfeststellung kommt, kann die Eurex Clearing AG den Schlussabrechnungspreis nach billigem Ermessen festlegen.

2.23.3 Erfüllung, Lieferung

Offene Positionen vom letzten Handelstag eines Kontrakts werden am Schlussabrechnungstag durch einen Differenzbetrag ausgeglichen, der dem internen Geldkonto des Clearing-Mitglieds gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 4.3 gutgeschrieben oder belastet wird. Der Buchungsbetrag berechnet sich aus der Differenz zwischen dem Schlussabrechnungspreis eines Kontrakts und dessen täglichem Abrechnungspreis vom Geschäftsvortag. Für am letzten Handelstag eröffnete Positionen berechnet sich der Buchungsbetrag aus der Differenz zwischen dem Schlussabrechnungspreis und dem Handelspreis.
