
ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

2.16 Teilabschnitt **Clearing von Futures-Kontrakten auf Aktiendividenden**

Die nachfolgenden Ziffern regeln das Clearing von Geschäften in Futures-Kontrakten auf Aktiendividenden (Ziffer 1.15 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich). Aktienvertretende Zertifikate (Depositary Receipts) werden wie Aktien behandelt.

2.16.1 Verfahren bei Zahlung

Alle Zahlungen erfolgen an dem dem Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.15.4 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich) folgenden Börsentag. Alle Clearing-Mitglieder haben ihre Zahlungsfähigkeit am Fälligkeitstag durch entsprechende Guthaben auf dem RTGS-Konto oder dem euroSIC-Konto sicherzustellen.

2.16.2 Schlussabrechnungspreis

Der Schlussabrechnungspreis der Futures-Kontrakte wird von der Eurex Clearing AG am Schlussabrechnungstag eines Kontrakts festgelegt. Für einen Futures-Kontrakt wird der Schlussabrechnungswert für den maßgeblichen jährlichen Dividendenzeitraum gemäß der folgenden Formel berechnet:

$$\underline{\text{Anzahl Aktien (N)}} \times \sum_t d_t \quad \underline{\text{auf vier Dezimalstellen gerundet}}$$

Die "Anzahl Aktien (N)" bezieht sich auf die in Annex D aufgeführten Futures-Kontrakte in Abhängigkeit von später vorgenommenen Anpassungen.

"t" bedeutet jeder Geschäftstag während des entsprechenden jährlichen Dividendenzeitraums des Futures;

" d_t " bedeutet (für Referenzaktien der gelisteten Futures-Kontrakte mit Bezug auf den Geschäftstag während des entsprechenden jährlichen Dividendenzeitraums des Futures) die berechnete Dividende;

wenn dieser Tag ein Ex-Dividenden-Tag für die Referenzaktien ist, ist der Betrag gleich der Maßgeblichen Dividende (Ziffer 1.15.10 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich) dieses Ex-Dividenden-Tags, bezogen auf die Anzahl der Aktien der in Anhang D aufgeführten Futures-Kontrakte in Abhängigkeit von späteren Anpassungen, andernfalls null.

wenn der Ex-Dividenden-Tag kein Geschäftstag ist, wird der darauffolgende Geschäftstag als Ex-Dividendendatum für die Schlussabrechnungspreisberechnung herangezogen.

Der Schlussabrechnungspreis für einen Kontrakt gemäß Ziffer 1.15.8 Absatz (10) der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich wird durch alle im jährlichen Dividendenzeitraum angekündigten und bereits bezahlten Dividendenbeträge bestimmt. Die Eurex Clearing AG kann bei der Aufhebung oder Aussetzung der Futures- oder Optionskontrakte auf Referenzaktien von den Eurex-Börsen oder anderen maßgeblichen Börsen verwendete Dividendenberechnungsmethoden berücksichtigen. Dabei kann die Eurex Clearing AG auch sachdienliche Informationsquellen heranziehen.

2.16.3 Erfüllung

Offene Positionen vom letzten Handelstag eines Futures-Kontrakts werden am Schlussabrechnungstag durch einen Differenzbetrag ausgeglichen, der dem internen Geldverrechnungskonto des Clearing-Mitglieds gutgeschrieben oder belastet wird. Der Buchungsbetrag berechnet sich aus der Differenz zwischen dem Schlussabrechnungspreis eines Kontrakts und dessen täglichem Abrechnungspreis vom Börsenvortag. Für am letzten Handelstag eröffnete Positionen berechnet sich der Buchungsbetrag aus der Differenz zwischen dem Schlussabrechnungspreis und dem Handelspreis.

2.16.4 Verzug

Für Verzug bzw. technischen Verzug gelten die Regelungen gemäß Kapitel I Ziffer 7.1 bzw. Ziffer 7.2.

[...]