

Kapitel VIII der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

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

Stand 12.11.2018

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 12.11.2018
	Seite 1
Kapitel VIII Abschnitt 1	

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN,

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN.

Abschnitt 1 Allgemeine Bestimmungen

[...]

1.6 US-Reporting für Ursprüngliche OTC-Transaktionen (über Nicht-SEFs)

- 1.6.1 Das betreffende Clearing-Mitglied oder Basis-Clearing-Mitglied, welches einer Meldepflicht nach Abschnitt 45 der CFTC-Regeln unterliegt, erkennt an, dass die Eurex Clearing AG, wie in Abschnitt 45 der CFTC-Regeln vorgesehen, Details der Eigentransaktionen des Clearing-Mitgliedes oder des Basis-Clearing-Mitgliedes und Details von Kundentransaktionen für Kunden-Transaktionskonten seiner Kunden sowie bzgl. Abwicklung, Anpassung und Kündigung solcher Ursprünglichen OTC-Transaktionen an ein Anerkanntes SDR und, soweit nach geltendem Recht erforderlich, an ein oder mehrere Transaktionsregister melden muß.
- 1.6.2 Dieses Clearing-Mitglied muss seine Kunden über die Liste von Anerkannten SDRs der Eurex Clearing AG in Kenntnis setzen sowie von der Tatsache, dass die Eurex Clearing AG Details von Kundentransaktionen lediglich an ein Anerkanntes SDR melden kann.
- 1.6.3 Wenn das betreffende Clearing-Mitglied oder Basis-Clearing-Mitglied, welches einer Meldepflicht nach Abschnitt 45 der CFTC-Regeln unterliegt, einen Transaktionsdatensatz, der Ursprüngliche OTC-Transaktionen enthält über ein ATS, welches kein SEF ist, überträgt, muss das betreffende Clearing-Mitglied oder Basis-Clearing-Mitglied der Eurex Clearing AG den „unique swap identifier“ (wie in den CFTC-Regeln definiert) für jede an die Eurex Clearing AG von oder für das Clearing-Mitglied übertragene Ursprüngliche OTC-Transaktion zusammen mit dem „legal entity identifier“ (wie in den CFTC-Regeln definiert) für das Swap-Daten-Register, an das die Ursprüngliche OTC-Transaktion gemeldet wurde, mitteilen, wenn die Ursprüngliche OTC-Transaktion übertragen wird oder unmittelbar im Anschluss daran. Das Clearing-Mitglied oder Basis-Clearing-Mitglied erkennt an, dass es sämtliche Informationen an die Eurex Clearing AG melden muß, so dass diese ihrerseits entsprechend Abschnitt 45 der CFTC-Regeln rechtzeitig die Aufhebung der Ursprünglichen OTC-Transaktionen an das entsprechende Swap-Daten-Register melden kann. Das betreffende Clearing-Mitglied oder Basis-Clearing-Mitglied muss sicherstellen, dass die Ursprüngliche OTC-Transaktion bei Novation rechtlich wirksam aufgehoben wird.

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 12.11.2018
	Seite 2
Kapitel VIII Abschnitt 1	

4.61.7 Einzelne Begriffsbestimmungen

[...]

“Anerkanntes SDR” bedeutet ein von der Eurex Clearing AG anerkanntes Swap-Daten-Register (Swap Data Register, SDR) für die Übertragung von Swap-Daten in Bezug auf die Novation von Ursprünglichen OTC-Transaktionen.

[...]

“CFTC–Regeln” umfaßt die Regeln, Regularien oder Anordnungen, die von der US Commodity Futures Trading Commission (CFTC) erlassen wurden.

[...]

“SEF” bedeutet ein Handelssystem, welches unter der Aufsicht der CFTC operiert.

[...]
