

Kapitel I der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

Allgemeine Bedingungen

Stand 27.02.2017

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 27.02.2017
	Seite 1

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

Abschnitt 1 Allgemeine Clearing-Bestimmungen

1 Allgemeine Vorschriften

[...]

1.2.6 Vorgeschriebene Geschäftszeiten

Clearing-Mitglieder, Clearing-Agenten, Nicht-Clearing-Mitglieder, Registrierte Kunden, FCM-Kunden und Basis-Clearing-Mitglieder sind verpflichtet sicherzustellen, dass sie an Geschäftstagen (im Fall von Clearing-Mitgliedern und Clearing-Agenten von 7:00 Uhr bis 23:30 Uhr ~~Ortszeit Frankfurt am Main~~MEZ) zur Durchführung Clearing-bezogenen Geschäfts, insbesondere zur Prüfung von Reports und Mitteilungen gemäß Ziffer 4.6 bereit sind.

Für den Fall, dass Clearing-Mitglieder oder Nicht-Clearing-Mitglieder in das Clearing von Instrumenten involviert sind, die zum Handel an den Eurex-Börsen zugelassen und für den 23h-Handel verfügbar sind, muss sichergestellt werden, dass sie an Geschäftstagen für diese Instrumente von 00:00 Uhr bis 23:00 Uhr MEZ zur Durchführung clearing-bezogenen Geschäfts, insbesondere zur Prüfung von Reports und Mitteilungen gemäß Ziffer 4.6 bereit sind.

1.2.7 Regelungen zu Pflichtverletzungen

[...]

2 Clearing-Mitglieder

[...]

2.1.2 Allgemeine Voraussetzungen für Clearing-Lizenzen

- (1) Einem Antragsteller wird eine Clearing-Lizenz für eine Transaktionsart nur erteilt, wenn er die allgemeinen Voraussetzungen gemäß nachstehenden Absätzen (2) bis (6) sowie die für die betreffende Transaktionsart in Kapitel II-IX aufgeführten

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 27.02.2017
	Seite 2

besonderen Voraussetzungen erfüllt. Sofern in Kapitel I Abschnitt 6 Ziffer 2 nicht abweichend geregelt, findet diese Ziffer 2.1.2 keine Anwendung auf Antragsteller einer Basis-Clearing-Mitglied-Clearing-Lizenz. Ferner findet diese Ziffer 2.1.2 keine unmittelbare Anwendung auf Antragsteller einer Direkt-Clearing-Lizenz; auf die Erteilung einer Direkt-Clearing-Lizenz findet Ziffer 2.1.2 Absätze (1) bis (5) der Basis-Clearing-Mitglied-Bestimmungen entsprechende Anwendung.

[...]

- (5) Der Antragsteller erbringt Nachweise dafür, dass er die folgenden Anforderungen erfüllt:
- (a) Technische Anbindung an die Systeme der Eurex Clearing AG sowie (wenn nicht bereits durch die jeweilige Clearing-Vereinbarung einbezogen) Abschluss des Vertrages über die technische Anbindung an die Clearing-EDV der Eurex Clearing AG (Anschlussvertrag) unter Einbeziehung der Allgemeinen Geschäftsbedingungen über die technische Anbindung an die Clearing EDV der Eurex Clearing AG.

[...]

- (g) Jedes Clearing-Mitglied benennt mindestens einen Mitarbeiter als Ansprechpartner für Notfälle für die Eurex-Clearing AG, der während der üblichen Geschäftszeiten erreichbar ist, um in Notfällen die notwendigen Maßnahmen treffen zu können; dieser ist bei der Eurex Clearing AG zu registrieren. Für den Fall, dass Clearing-Mitglieder oder Nicht-Clearing-Mitglieder in das Clearing von Instrumenten involviert sind, die zum Handel an den Eurex-Börsen zugelassen und für den 23h-Handel verfügbar sind, muss die Erreichbarkeit des Ansprechpartners für Notfälle auch für verlängerte Handelszeiten sichergestellt werden.

- (6) Das Vorliegen der allgemeinen Voraussetzungen gemäß den vorstehenden Absätzen (2) – (5) ist bei Antragstellung nachzuweisen.

[...]

[...]

12 Sonstige Vereinbarungen zwischen Clearing-Mitgliedern und Nicht-Clearing-Mitgliedern im Hinblick auf das Clearing von Eurex-Transaktionen und FWB-Transaktionen

12.1 Auflagen

[...]

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 27.02.2017
	Seite 3

12.2 Limitierung von Aufträgen oder Quotes für Eurex-Transaktionen (Pre-Trade-Limite)

12.2.1 Das Clearing-Mitglied und ein Nicht-Clearing-Mitglied können für Eurex-Transaktionen eine Limitierung der Aufträge oder Quotes vereinbaren, die von diesem Nicht-Clearing-Mitglied oder dem Clearing-Mitglied in die Systeme eines Marktes eingegeben werden dürfen („**Pre-Trade-Limite**“).

12.2.2 Pre-Trade-Limite können einzelne oder mehrere oder eine Kombination der nachfolgend aufgeführten Beschränkungen beinhalten:

(1) [...]

[...]

(3) Maximale Margin-Verpflichtung insgesamt oder maximale Margin-Verpflichtung im Hinblick auf bestimmte Eligible Margin-Vermögenswerte, die das Clearing-Mitglied gemäß den Clearing-Bedingungen infolge des Abschlusses von Transaktionen für das Nicht-Clearing-Mitglied jeweils zu erfüllen hat.

Für den Fall, dass Clearing-Mitglieder oder Nicht-Clearing-Mitglieder in das Clearing von Instrumenten involviert sind, die zum Handel an den Eurex-Börsen zugelassen und für den 23h-Handel verfügbar sind, stehen die hier in Absatz 3 festgesetzten Kriterien für Pre-Trade-Limite zwischen 00:00 Uhr und 7:30 Uhr für eine automatische Limitierung durch das System nicht zur Verfügung.

12.2.3 Ein Nicht-Clearing-Mitglied ist auf Verlangen seines Clearing-Mitglieds verpflichtet, mit diesem Clearing-Mitglied Pre-Trade-Limite zu vereinbaren. In diesem Fall kann das betreffende Clearing-Mitglied die mit seinen jeweiligen Nicht-Clearing-Mitgliedern vereinbarten Pre-Trade-Limite im System hinterlegen.

[...]
