

Kapitel II der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

Transaktionen an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

(Eurex-Börsen)

Stand 08.12.2017

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 08.12.2017
	Seite 2

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

2.3 Clearing von Fixed Income Futures-Kontrakten

[...]

2.3.4 Erfüllung, Lieferung

- (1) Eine Lieferverpflichtung aus einer Short-Position in einem Euro-Fixed Income Futures-Kontrakt kann nur durch von der Eurex Clearing AG bestimmte Schuldverschreibungen erfüllt werden. Zur Lieferung können in EUR denominierte Schuldverschreibungen mit einem fixen Kupon Deutschlands (für Euro-Schatz-, Euro-Bobl-, Euro-Bund- und Euro-Buxl-Futures-Kontrakte), der Republik Italien (für Short term Euro-BTP-Futures-Kontrakte, Mid term Euro-BTP-Futures-Kontrakte und Euro-BTP-Futures-Kontrakte), der Republik Frankreich (für Euro-OAT-Futures-Kontrakte und Mid-Term-Euro-OAT Futures-Kontrakte) sowie des Königreichs Spanien (für Euro-BONO-Futures-Kontrakte) gewählt werden, die am Liefertag eine unkündbare Restlaufzeit
- von 1,75 bis 2,25 Jahren und eine ursprüngliche Laufzeit von nicht länger als 11 Jahren für Euro-Schatz-Futures-Kontrakte
 - von 4,5 bis 5,5 Jahren und eine ursprüngliche Laufzeit von nicht länger als 11 Jahren für Euro-Bobl-Futures-Kontrakte
 - von 8,5 bis 10,5 Jahren und eine ursprüngliche Laufzeit von nicht länger als 11 Jahren für Euro-Bund-Futures-Kontrakte
 - von 24 bis 35 Jahren für Euro-Buxl[®]-Futures-Kontrakte
 - von 2 bis 3,25 Jahren für Short-term Euro-BTP-Futures-Kontrakte
 - von 4,5 bis 6 Jahren und eine ursprüngliche Laufzeit von nicht länger als 16 Jahren für Mid-term Euro-BTP-Futures-Kontrakte
 - von 8,5 bis 11 Jahren und eine ursprüngliche Laufzeit von nicht länger als 16 Jahren für Euro-BTP-Futures-Kontrakte

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 08.12.2017
	Seite 3

- von 8,5 bis 10,5 Jahren und eine ursprüngliche Laufzeit von nicht länger als 17 Jahren für Euro-OAT-Futures-Kontrakte
- von 4,5 bis 5,5 Jahren und eine ursprüngliche Laufzeit von nicht länger als 17 Jahren für Mid-Term Euro-OAT-Futures-Kontrakte
- von 8,5 bis 10,5 Jahren und eine ursprüngliche Laufzeit von nicht länger als 20 Jahren für alle Euro-BONO-Futures-Kontrakte, die vor September 2018 verfallen, haben. Bei allen Euro-BONO-Futures-Kontrakten, die ab September 2018 (einschließlich) verfallen, beträgt die ursprüngliche Laufzeit nicht länger als 15 Jahre.

Die Schuldverschreibungen müssen ein Mindestemissionsvolumen von EUR 5 Milliarden aufweisen. Schuldverschreibungen der Republik Italien und des Königreich Spanien müssen bereits zehn Börsentage vor dem letzten Handelstag des aktuellen Fälligkeitsmonats (Ziffer 1.2.4 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich) ein Mindestemissionsvolumen von EUR 5 Milliarden aufweisen, anderenfalls sind sie bis zum Liefertag des aktuellen Fälligkeitsmonats nicht lieferbar.

[...]
