
ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Kapitel II

Geschäfte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich (Eurex-Börsen)

[...]

Abschnitt 2

Clearing von Futures-Kontrakten

[...]

2.3 Teilabschnitt Clearing von Fixed Income Futures-Kontrakten

Die nachfolgenden Bestimmungen regeln das Clearing von Transaktionen in den in Ziffer 1.2 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Fixed Income Futures-Kontrakte.

[...]

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 der Bundesrepublik Deutschland (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) und der Republik Frankreich (Euro-OAT-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 haben
- § von 8,5 bis 10,5 Jahren und eine ursprüngliche Laufzeit von nicht länger als 17 Jahren für Euro-OAT-Futures-Kontrakte.

Die Schuldverschreibungen müssen ein Mindestemissionsvolumen von EUR 5 Milliarden aufweisen. Beginnend mit dem Kontraktmonat Juni 2012 müssen Schuldverschreibungen der Republik Italien 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 in Futures-Kontrakten auf kurz-, mittel- und langfristige Schuldverschreibungen der Republik Italien.

Eine Lieferverpflichtung aus einer Short-Position in einem CONF-Futures-Kontrakt kann nur durch von der Eurex Clearing AG bestimmte Anleihen erfüllt werden. Zur Lieferung können in Schweizer Franken denominierte Anleihen der Schweizerischen Eidgenossenschaft mit einer Restlaufzeit von höchstens 13 und mindestens acht Jahren gewählt werden. Bei Anleihen mit vorzeitiger Rückzahlungsmöglichkeit muss der erste und letzte mögliche Rückzahlungstermin zum Lieferzeitpunkt des Kontrakts zwischen acht und 13 Jahren liegen. Die Anleihen müssen ein Mindestemissionsvolumen von CHF 500 Millionen aufweisen.

- (2) Clearing-Mitglieder mit offenen Short-Positionen müssen zwei Geschäftstage vor dem zehnten Kalendertag eines Quartalsmonats (Anzeigetag) der Eurex Clearing AG nach Handelsschluss bis Ende der Post-Trading Full-Periode anzeigen, welche Schuldverschreibungen sie liefern werden. Bereits erfolgte Lieferanzeigen können bis zum Ende der Post-Trading Full-Periode geändert werden. Erfolgt die Lieferanzeige nicht fristgerecht, bestimmt die Eurex Clearing AG die von dem Clearing-Mitglied zu liefernden Schuldverschreibungen. Den tatsächlichen Bestand der notifizierten Schuldverschreibungen haben die Clearing-Mitglieder einen Tag vor Liefertag gegenüber der Eurex Clearing AG schriftlich zu bestätigen.

Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

- (3) Die Eurex Clearing AG ordnet den Clearing-Mitgliedern mit offenen Long-Positionen die zur Lieferung angezeigten Schuldverschreibungen nach Ende der Post-Trading-Periode des Anzeigetags mittels eines die Neutralität des Zuordnungsvorgangs gewährleistenden Auswahlverfahrens zu. Die Clearing-Mitglieder werden über die ihnen zugeordneten Schuldverschreibungen sowie deren Andienungspreise am nächsten Geschäftstag informiert.
- (4) Die Absätze (1) bis (3) gelten für das Rechtsverhältnis zwischen Clearing-Mitgliedern und ihren jeweiligen Nicht-Clearing-Mitgliedern; Absatz (3) gilt für das Rechtsverhältnis zwischen Clearing-Mitgliedern bzw. Nicht-Clearing-Mitgliedern und ihren Kunden entsprechend.

[...]