

\*\*\*\*\*  
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 1**

##### **Allgemeine Bestimmungen**

[...]

#### **Abschnitt 2**

##### **Clearing von Futures-Kontrakten**

Die nachfolgenden Bestimmungen regeln das Clearing von Transaktionen in den in Ziffer 1 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Futures-Kontrakte („**Eurex-Kontraktsspezifikationen**“).

#### **2.1**

##### **Teilabschnitt**

##### **Allgemeine Bestimmungen**

Die „Allgemeinen Bestimmungen“ gemäß dieser Ziffer 2.1 gelten für alle Futures-Kontrakte, sofern nicht für die einzelnen Futures-Kontrakte spezifische oder gegenüber den „Allgemeinen Bestimmungen“ abweichende Regelungen gemäß Ziffer 2.2 bis 2.18 gelten.

[...]

#### **2.10**

##### **Teilabschnitt**

##### **Clearing von Index-Dividenden-Futures-Kontrakten**

Die nachfolgenden Bestimmungen regeln das Clearing von Transaktionen in den in Ziffer 1.9 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Index-Dividenden-Futures-Kontrakte.

### 2.10.1 Verfahren bei Zahlung

Alle Zahlungen erfolgen an dem Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.9.4 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich) folgenden Geschäftstag. Alle Clearing-Mitglieder haben ihre Zahlungsfähigkeit am Fälligkeitstag durch entsprechende Guthaben auf dem RTGS-Konto oder dem euroSIC-Konto sicherzustellen.

### 2.10.2 Schlussabrechnungspreis

Der Schlussabrechnungspreis der Index-Dividenden-Futures-Kontrakte wird von der Eurex Clearing AG am Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.9.4 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich) eines Kontrakts festgelegt.

- (1) Maßgeblich für ~~die~~ EURO STOXX 50<sup>®</sup> Index-Dividenden-Futures-Kontrakte, ~~und die~~ EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend~~en~~ 30 Index-Dividenden-Futures-Kontrakte, ~~die~~ EURO STOXX<sup>®</sup> Sector Index-Dividenden-Futures-Kontrakte und die STOXX<sup>®</sup> Europe 600 Sector Index-Dividenden-Futures-Kontrakte ist der von STOXX Limited in Indexpunkten berechnete Wert der gesamten Dividendenzahlungen während der Laufzeit des Index-Dividenden-Futures-Kontrakt.

STOXX Limited legt dabei nach ihren Regeln fest, welche Dividenden in die Berechnung des Index einbezogen werden. Weiterhin bestimmt STOXX Limited die Höhe der zu berücksichtigenden Dividende, den Zeitpunkt der Berücksichtigung der Dividendenzahlung und die Umrechnung der Dividende in Indexpunkte.

Bei außergewöhnlichen Umständen, insbesondere wenn aufgrund technischer Probleme keine Daten von STOXX Limited verfügbar sind, oder wenn eine Bestimmung eines Schlussabrechnungspreises aus anderen Gründen nicht möglich ist, kann die Eurex Clearing AG den Schlussabrechnungspreis mittels eines anderen Verfahrens berechnen. Dieses muss dem Verfahren der STOXX Limited möglichst weitestgehend entsprechen.

- (2) Maßgeblich für DAX<sup>®</sup> Kursindex Index Dividend Futures und DivDAX<sup>®</sup> Index Dividend Futures Kontrakte ist der von Deutsche Börse AG in Indexpunkten berechnete Wert der gesamten Dividendenzahlungen während der Laufzeit des Index-Dividenden-Futures-Kontrakt.

Die Deutsche Börse AG legt dabei gemäß ihren Regeln fest, welche Dividenden in die Berechnung des Index einbezogen werden. Weiterhin bestimmt sie die Höhe der zu berücksichtigenden Dividende, den Zeitpunkt der Berücksichtigung der Dividendenzahlung und die Umrechnung der Dividende in Indexpunkte.

Bei außergewöhnlichen Umständen, insbesondere wenn aufgrund technischer Probleme keine Daten der Deutsche Börse AG verfügbar sind, oder wenn eine Bestimmung eines Schlussabrechnungspreises durch die Deutsche Börse AG aus anderen Gründen nicht möglich ist, kann die Eurex Clearing AG den

Schlussabrechnungspreis mittels eines anderen Verfahrens berechnen. Dieses muss dem Verfahren der Deutsche Börse AG möglichst weitestgehend entsprechen.

- (3) Maßgeblich für den SMI<sup>®</sup> Index Dividend Futures Kontrakte ist der von SIX Swiss Exchange in Indexpunkten berechnete Wert der gesamten Dividendenzahlungen während der Laufzeit des Index-Dividenden-Futures-Kontrakt.

SIX Swiss Exchange legt dabei gemäß ihren Regeln fest, welche Dividenden in die Berechnung des Index einbezogen werden. Weiterhin bestimmt sie die Höhe der zu berücksichtigenden Dividende, den Zeitpunkt der Berücksichtigung der Dividendenzahlung und die Umrechnung der Dividende in Indexpunkte.

Bei außergewöhnlichen Umständen, insbesondere wenn aufgrund technischer Probleme keine Daten der SIX Swiss Exchange verfügbar sind, oder wenn eine Bestimmung eines Schlussabrechnungspreises aus anderen Gründen nicht möglich ist, kann die Eurex Clearing AG den Schlussabrechnungspreis mittels eines anderen Verfahrens berechnen. Dieses muss dem Verfahren der SIX Swiss Exchange möglichst weitestgehend entsprechen.

### **2.10.3 Erfüllung, Lieferung**

Offene Positionen vom letzten Handelstag eines Kontrakts werden am Schlussabrechnungstag durch einen Differenzbetrag ausgeglichen, der dem internen Geldkonto des Clearing-Mitglieds gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 4.3 gutgeschrieben oder belastet wird. Der Buchungsbetrag berechnet sich aus der Differenz zwischen dem Schlussabrechnungspreis eines Kontrakts und dessen täglichem Abrechnungspreis vom Geschäftsvortag. Für am letzten Handelstag eröffnete Positionen berechnet sich der Buchungsbetrag aus der Differenz zwischen dem Schlussabrechnungspreis und dem Handelspreis.

[...]