

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 24.11.2014
	Seite 1

\*\*\*\*\*

Änderungen sind wie folgt kenntlich gemacht:

Ergänzungen sind unterstrichen

Löschungen sind durchgestrichen

\*\*\*\*\*

[...]

## Kapitel II Transaktionen an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich (Eurex-Börsen)

### Abschnitt 1 Allgemeine Bestimmungen

[...]

#### 1.3 Interne Konten

##### 1.3.1 Arten von Transaktionskonten

[...]

- (4) Beantragt ein Clearing-Mitglied Zusätzliche Kundenkonten für NCM-Bezogene-Transaktionen und/oder RK-Bezogene-Transaktionen gemäß Ziffer 1.3.6, wird zur technischen Bereitstellung der Zusätzlichen Kundenkonten ein separates Konto (A8) geführt (jeweils das „**Schnittstellenkonto**“). NCM-Bezogene-Transaktionen und RK-Bezogene-Transaktionen werden über die Schnittstellenkonten auf die Zusätzlichen Kundenkonten übertragen. Mit Ausnahme der in diesem Absatz nachstehend aufgezählten Funktionen sowie Trade Transfers und Position Transfers gemäß Ziffer 1.3.3 Absatz (2), stehen keine weiteren Kontoführungsmöglichkeiten gemäß den Ziffern 1.3.2 bis 1.3.5 für die Schnittstellenkonten zur Verfügung. Wird eine Gattstellungstransaktion (Closing Trade) auf ein Schnittstellenkonto übertragen, wird diese automatisch in eine Eröffnungstransaktion umgewandelt und als solche verbucht. Die Bestätigung der Übernahme einer Transaktion in einem Schnittstellenkonto gemäß Ziffer 1.3.3 Absatz (4) letzter Spiegelstrich und Absatz (5) letzter Spiegelstrich ist nur für Transaktionen des jeweiligen Geschäftstages möglich.

Mit Ausnahme der Ermittlung der Margin-Verpflichtungen für Physische Lieferungen von Anleihen aus Positionen auf Zusätzlichen Kundenkonten stellen die Schnittstellenkonten keine Konten im Sinne der Ziffer 1.2 dar. Diese Ausnahme gilt nicht für Positionen auf Zusätzlichen Kundenkonten die in Bezug auf einen Registrierten Kunden geführt werden, mit dem das Clearing Mitglied eine ICM-

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 24.11.2014
	Seite 2

Clearing-Vereinbarung oder eine ICM-Teilnahmevereinbarung unter Verwendung des Anhangs zu dem jeweiligen Abschnitt 4 abgeschlossen hat.

[...]

### 1.3.6 Zusätzliche Kundenkonten

Ein Clearing-Mitglied kann die Einrichtung Zusätzlicher Kundenkonten in Bezug auf NCM-Bezogene-Transaktionen und RK-Bezogene-Transaktionen beantragen. Soweit nachfolgend nicht abweichend geregelt und anwendbar, gelten für diese Zusätzlichen Kundenkonten die vorstehenden Ziffern 1.3.1 bis 1.3.5.

#### 1.3.6.1 NCM-/RK-Kundenkonten

- (1) Auf Antrag ~~und vorbehaltlich vorstehender Ziffer 1.3.6 Satz 2~~, eröffnet und führt die Eurex Clearing AG zusätzlich zu den Transaktionskonten gemäß Ziffer 1.3.1 Absatz (2)(b) und Absatz (2)(c) für jedes Clearing-Mitglied Zusätzliche Kundenkonten in Bezug auf NCM-Bezogene-Transaktionen und in Bezug auf RK-Bezogene-Transaktionen (jedes Kundenkonto jeweils ein „**Zusätzliches Kundenkonto**“).
- (2) Zur technischen Verbindung der Zusätzlichen Kundenkonten mit den Schnittstellenkonten nach Ziffer 1.3.1 Absatz (4) wird jeweils ein Transfer-Kundenkonto (AAA) geführt (jeweils ein „**Transfer-Kundenkonto**“). Für Transfer-Kundenkonten im Rahmen der Grund-Clearingmodell-Bestimmungen oder Net-Omnibus-Clearingmodell-Bestimmungen gilt: Die Transfer-Kundenkonten dürfen nicht für die dauerhafte Verbuchung von Transaktionen über das Tagesende hinaus genutzt werden. Die Verbuchung der Kundentransaktion auf das betreffende Zusätzliche Kundenkonto ist direkt und ohne schuldhaftes Zögern durchzuführen.
- (3) Jede Bezugnahme in diesen Clearing-Bedingungen auf ein Kundenkonto in Bezug auf NCM- oder RK-Bezogene Transaktionen ist auch als Bezugnahme auf das betreffende Zusätzliche Kundenkonto in Bezug auf NCM-Bezogene-Transaktionen oder RK-Bezogene-Transaktionen zu verstehen.
- (4) Schließt ein Clearing-Mitglied eine ICM-Clearing-Vereinbarung oder eine ICM-Teilnahmevereinbarung unter Verwendung des Anhangs zum jeweiligen Abschnitt 4 mit einem oder mehreren Registerierte(n) Kunden und der Eurex Clearing AG ab, ist das Transaktionskonto im Sinne von Kapitel 1 Abschnitt 1 Ziffer 1.2.2 Absatz (1)(c) für den jeweiligen Registrierten Kunden ausschließlich das für diesen Registrierten Kunden geführte Zusätzliche Kundenkonto. Das Transfer-Kundenkonto ist in diesem Fall ein Kundenkonto gemäß vorstehender Ziffer 1.3.1 Absatz (2)(a). Die Transfer-Kundenkonten dürfen nicht für die dauerhafte Verbuchung von Transaktionen über das Tagesende hinaus genutzt werden. Die Verbuchung der Kundentransaktion auf das betreffende Zusätzliche Kundenkonto ist unmittelbar und ohne schuldhaftes Zögern durchzuführen. Positionsübertragungen von einem oder auf ein Zusätzliches Kundenkonto dürfen nur vorgenommen werden, wenn das mit den betreffenden Registrierten Kunden vereinbart ist.

[...]

## Anhänge zu den Clearing-Bedingungen

[...]

Anhang 2 zu den Clearing-Bedingungen:

## Clearing-Vereinbarung

mit einem Nicht-Clearing-Mitglied  
und/oder Registrierten Kunden  
für das Grund-Clearingmodell

[...]

#### **Abschnitt 4 Besondere Bestimmungen für das Clearing von Transaktionen mit bestimmten Arten von Investmentfonds**

[...]

##### **Anlage zu Abschnitt 4\***

<b>Legal Name of the Relevant Fund</b>				
Name of the asset pool (fund)				
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)				
Jurisdiction (ISO code)				

\* Die Eurex Clearing AG kann diese Anlage zu Abschnitt 4 auch in einem anderen als dem hier abgebildeten Format zur Verfügung stellen.

[...]

Anhang 3 zu den Clearing-Bedingungen:

## Clearing-Vereinbarung

mit einem Nicht-Clearing-Mitglied und/oder Registrierten Kunden  
für das Individual-Clearingmodell  
basierend auf Eurex Clearing AG-Dokumentation

[...]

## Abschnitt 4 Besondere Bestimmungen für das Clearing von Transaktionen mit bestimmten Arten von Investmentfonds

Die nachfolgenden besonderen Bestimmungen gelten für das Clearing von Transaktionen mit Fonds in Vertragsform, Partnerships, Unit Trusts, Teilfonds und Fonds-Segmenten.

### 1 Begriffsbestimmungen und Auslegung

[...]

~~1.4 Falls Eurex Transaktionen für Rechnung eines Betreffenden Fonds oder Betreffenden Fonds-Segments im Rahmen von ICM-ECD geschlossen werden sollen, müssen die betreffende Fonds-Partei, die jeweils für Rechnung dieses Betreffenden Fonds bzw. Betreffenden Fonds-Segments handelt, und das Clearing-Mitglied eine gesonderte Clearing-Vereinbarung mit der Eurex Clearing AG gemäß Anhang 3 der Clearing-Bedingungen hinsichtlich jedes dieser Betreffenden Fonds oder Betreffenden Fonds-Segmente abschließen und mit Abschluss dieser gesonderten Clearing-Vereinbarung wird dieser Betreffende Fonds oder dieses Betreffende Fonds-Segment automatisch aus dem Anhang dieses Abschnitts 4 gelöscht und die Fonds-Partei hat der Eurex Clearing AG und dem Clearing-Mitglied einen geänderten Anhang dieses Abschnitts 4, in welchem dieser Betreffende Fonds oder dieses Betreffenden Fonds-Segment gelöscht sind, zu übermitteln.~~

[...]

#### Anlage zu Abschnitt 4\*

Legal Name of the Relevant Fund				
Name of the asset pool (fund)				
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)				
Jurisdiction (ISO code)				

\* Die Eurex Clearing AG kann diese Anlage zu Abschnitt 4 auch in einem anderen als dem hier abgebildeten Format zur Verfügung stellen.

[...]

Anhang 4 zu den Clearing-Bedingungen:

## Vereinbarung

zur Teilnahme am Individual-Clearingmodell  
basierend auf einer Kunden-Clearing-Dokumentation mit  
einem Nicht-Clearing-Mitglied und/oder Registrierten Kunden



[...]

## Abschnitt 4 Besondere Bestimmungen für das Clearing von Transaktionen mit bestimmten Arten von Investmentfonds

Die nachfolgenden besonderen Bestimmungen gelten für das Clearing von Transaktionen mit Fonds in Vertragsform, Partnerships, Unit Trusts, Teilfonds und Fonds-Segmenten.

### 1 Begriffsbestimmungen und Auslegung

[...]

~~1.4 Falls Eurex Transaktionen für Rechnung eines Betreffenden Fonds oder Betreffenden Fonds-Segments im Rahmen von ICM-CCD geschlossen werden sollen, müssen die betreffende Fonds-Partei, die jeweils für Rechnung dieses Betreffenden Fonds bzw. Betreffenden Fonds-Segments handelt, und das Clearing Mitglied eine gesonderte ICM-Teilnahmevereinbarung mit der Eurex Clearing AG gemäß Anhang 3 der Clearing-Bedingungen hinsichtlich jedes dieser Betreffenden Fonds oder Betreffenden Fonds-Segmente abschließen und mit Abschluss dieser gesonderten ICM-Teilnahmevereinbarung wird dieser Betreffende Fonds oder dieses Betreffende Fonds-Segment automatisch aus dem Anhang dieses Abschnitts 4 gelöscht und die Fonds-Partei hat der Eurex Clearing AG und dem Clearing Mitglied einen geänderten Anhang dieses Abschnitts 4, in welchem dieser Betreffende Fonds oder dieses Betreffenden Fonds-Segment gelöscht sind, zu übermitteln.~~

[...]

#### Anlage zu Abschnitt 4\*

Legal Name of the Relevant Fund				
Name of the asset pool (fund)				
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)				
Jurisdiction (ISO code)				

\* Die Eurex Clearing AG kann diese Anlage zu Abschnitt 4 auch in einem anderen als dem hier abgebildeten Format zur Verfügung stellen.

[...]

Anhang 8 zu den Clearing-Bedingungen:

## Clearing-Vereinbarung

mit einem Net Omnibus Nicht-Clearing-Mitglied  
und/oder einem Net Omnibus Registrierten Kunden  
für das Net Omnibus-Clearingmodell

[...]

#### **Abschnitt 4 Besondere Bestimmungen für das Clearing von Transaktionen mit bestimmten Arten von Investmentfonds**

[...]

##### **Anlage zu Abschnitt 4\***

<b>Legal Name of the Relevant Fund</b>				
Name of the asset pool (fund)				
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)				
Jurisdiction (ISO code)				

\* Die Eurex Clearing AG kann diese Anlage zu Abschnitt 4 auch in einem anderen als dem hier abgebildeten Format zur Verfügung stellen.

[...]