

Kapitel VIII der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG

Clearing von OTC-Zinsderivat-Transaktionen, OTC-FX-Transaktionen und OTC-XCCY- Transaktionen

Stand 06.08.2018

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 06.08.2018
	Seite 1

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:
ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN,
LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN.

[...]

Abschnitt 2 Clearing von OTC-Zinsderivat-Transaktionen

2.1 Allgemeine Bestimmungen

[...]

2.1.7 Margin-Verpflichtungen

- (1) Die folgenden Bestimmungen finden zusätzlich zu den in Kapitel I beschriebenen allgemeinen Bestimmungen für die Margin-Verpflichtungen Anwendung:
- (2) Die anwendbaren Margin-Arten in Bezug auf CTM-Zinsderivat-Transaktionen sind ~~Additional Margin~~Initial Margin und Variation Margin. Die anwendbare Margin-Art in Bezug auf STM-Zinsderivat-Transaktionen ist ~~Additional Margin~~Initial Margin.

[...]

[...]

Abschnitt 3 Clearing von OTC-FX-Transaktionen

3.1 Allgemeine Bestimmungen

[...]

3.1.7 Margin-Verpflichtungen

Die allgemeinen Bestimmungen für die Margin-Verpflichtungen sind in Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 3 sowie in Kapitel I Abschnitt 2 Ziffern 6 und 7 aufgeführt. Darüber hinaus gelten die folgenden weiteren Bestimmungen:

- (1) Die anwendbaren Margin-Arten in Bezug auf CTM-FX-Transaktionen sind ~~Additional Margin~~Initial Margin, Variation Margin und Abwicklungsausgleich-Margin (wie nachstehend in Absatz (5) definiert), wobei Variation Margin ausschließlich in USD und in bar erbracht werden darf. Die anwendbaren Margin-Arten in Bezug auf STM-

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 06.08.2018
	Seite 2

FX-Transaktionen sind ~~Additional Margin~~Initial Margin und Abwicklungsausgleich-Margin.

[...]

[...]

Abschnitt 4 Clearing von OTC-XCCY-Transaktionen

4.1 Allgemeine Bestimmungen

[...]

4.1.7 Margin-Verpflichtungen

Die allgemeinen Bestimmungen für die Margin-Verpflichtungen sind in Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 3 sowie in Kapitel I Abschnitt 2 Ziffern 6 und 7 aufgeführt. Darüber hinaus gelten die folgenden weiteren Bestimmungen:

- (1) Die anwendbaren Margin-Arten in Bezug auf CTM-XCCY-Transaktionen sind ~~Additional Margin~~Initial Margin, Variation Margin und Abrechnungsausgleich-Margin (wie in Abschnitt 3 Ziffer 3.1.7 Absatz (5) definiert); Variation Margin muss im Wege der Barzahlung in USD geleistet werden. Die anwendbaren Margin-Arten in Bezug auf STM-XCCY-Transaktionen sind ~~Additional Margin~~Initial Margin und Abrechnungsausgleich-Margin.

[...]

[...]
