

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 1

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

## Kapitel I Allgemeine Bedingungen

### Abschnitt 1 ALLGEMEINE CLEARING-BESTIMMUNGEN

#### 1 Allgemeine Vorschriften

##### 1.1 Anwendungsbereich

[...]

1.1.6 Ein Unternehmen kann eine CLEARING-VEREINBARUNG in der diesen CLEARING-BEDINGUNGEN als Anhang 2, Anhang 3 oder Anhang 8 beigefügten Form oder eine ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG (wie in den INDIVIDUAL-CLEARINGMODELL-BESTIMMUNGEN definiert) in der diesen CLEARING-BEDINGUNGEN als Anhang 4 beigefügten Form mit einem CLEARING-MITGLIED und der Eurex Clearing AG als REGISTRIERTER KUNDE (jeweils ein „REGISTRIERTER KUNDE“) nach Maßgabe und unter Berücksichtigung der folgenden Bedingungen abschließen:

(1) bei dem betreffenden Unternehmen muss es sich um

- (i) eine juristische Person- (mit Ausnahme der in (ii) genannten juristischen Personen);
- (ii) einene Investmentfonds mit eigener Rechtspersönlichkeit in Form einer nach den Open-Ended Investment Companies Regulations 2001 von England und Wales (SI 2001/1228) errichteten authorised investment company with variable capital („**OEIC**“), einer nach Part XIII des irischen Companies Act 1990 errichteten investment company („**IC**“) in Irland, ~~es sei denn, die IC ist als Umbrella-Fonds ausgestaltet,~~ einer société d'investissement à capital variable in Luxemburg („**LUX SICAV**“), ~~oder einer~~ société d'investissement à capital fixe in Luxemburg („**LUX SICAF**“), ~~es sei denn, die Lux SICAV oder Lux SICAF ist als Umbrella-Fonds ausgestaltet,~~ einer société d'investissement à capital variable in Frankreich („**FRANZÖSISCHE SICAV**“), einer nach Artikel 36 ff. des schweizerischen

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 2

Bundesgesetzes vom 23. Juni 2006 über die kollektiven Kapitalanlagen errichteten *Investmentgesellschaft mit variablem Kapital* in der Schweiz („**SCHWEIZERISCHE SICAV**“) oder einer nach Artikel 110 ff. des schweizerischen Bundesgesetzes vom 23. Juni 2006 über die kollektiven Kapitalanlagen errichteten *Investmentgesellschaft mit festem Kapital* in der Schweiz („**SCHWEIZERISCHE SICAF**“) oder eine als *mutual fund company* operierende Gesellschaft nach dem Cayman Islands Mutual Funds Law (2013 Revision) („**CC**“) (jede der in diesem Absatz (ii) aufgeführten Fonds-Arten, ein „**FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM**“) es sei denn, die ~~FRANZÖSISCHE SICAV~~ dieser **FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM** ist als Umbrella-Fonds ausgestaltet,

(iii) einen Investmentfonds in Form einer nach dem irischen Investment Limited Partnerships Act 1994 errichteten *investment limited partnership* („**ILP**“) in Irland, einer *société en commandite spéciale* in Luxemburg („**SCP**“), einer nach Artikel 98 ff. des schweizerischen Bundesgesetzes vom 23. Juni 2006 über die kollektiven Kapitalanlagen errichteten *Kommanditgesellschaft für kollektive Kapitalanlagen* in der Schweiz („**SCPC**“) oder einer als *mutual fund* operierende *limited partnership* nach dem Cayman Islands Mutual Funds Law (2013 Revision) („**LP**“) (jede der in diesem Absatz (iii) aufgeführten Fonds-Arten, eine „**PARTNERSHIP**“);

(iv) ~~\_\_\_\_\_~~ einen Investmentfonds in Vertragsform ohne eigene Rechtspersönlichkeit in Form eines *Sondervermögens* im Sinne des deutschen Investmentgesetzes („**InvG**“) bzw. des deutschen Kapitalanlagegesetzbuches („**KAGB**“), eines nach Part 2 des irischen Investment Funds, Companies and Miscellaneous Provisions Act 2005 errichteten *common contractual fund* („**CCF**“) in Irland, eines *fonds commun de placement* in Luxemburg („**Lux FCP**“), eines *fonds commun de placement* in Frankreich („**FRANZÖSISCHER FCP**“) oder einen *vertraglichen Anlagefonds* in der Schweiz im Sinne von Artikel 25 ff. Kollektivanlagengesetz („**CF**“) (jede der in diesem Absatz (iv) aufgeführten Fonds-Arten, ein „**FONDS IN VERTRAGSFORM**“);

(v) einen *unit trust* in Form eines *authorised unit trust scheme* in England und Wales (wie in section 237 des *Financial Services and Markets Act* definiert) („**AUT**“), eines nach dem irischen Unit Trust Act 1990 errichteten *unit trust* in Irland („**UT**“) oder eines als *mutual fund* operierender *unit trust* nach dem Cayman Islands Mutual Funds Law (2013 Revision) („**CUT**“) (jede der in diesem Absatz (v) aufgeführten Fonds-Arten, ein „**UNIT TRUST**“);

(vi) ~~einschließlich eines~~es Teilfonds (a) eines **FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM** in Form einer LUX SICAV, einer Lux SICAF, einer FRANZÖSISCHEN SICAV, einer IRISCHEN IC oder einer SCHWEIZERISCHEN SICAV, (b) eines **FONDS IN VERTRAGSFORM** in Form eines *Sondervermögens* im Sinne des deutschen InvG oder des deutschen KAGB, eines Lux FCP oder eines FRANZÖSISCHEN FCP, eines CCF oder eines schweizerischen CF oder (c) eines **UNIT TRUST** in Form eines **UT** oder eines **CUT**, wobei die in diesem Absatz (vi) unter (a), (b) oder (c) aufgeführten Fonds-Arten jeweils Umbrella-Fonds eines solchen Teilfonds sind (jeweils ein „**TEILFONDS**“); oder

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 3

~~im Sinne des § 34 Abs. 2 InvG bzw. eines Teilsondervermögens im Sinne des 96 Abs. 2 KAGB, (iv) ein Fonds-Segment eines solchen Sondervermögens, welches (jeweils im Falle (iii) und (iv)) von einer Kapitalanlagegesellschaft („KAG“) im Sinne des InvG bzw. einer Kapitalverwaltungsgesellschaft („KVG“) im Sinne des KAGB verwaltet wird, (v) ein *authorised unit trust scheme* in England und Wales (wie in section 237 des Financial Services and Markets Act definiert) („AUT“), (vi) ein nach dem irischen Unit Trust Act 1990 errichteter *unit trust* („UT“) in Irland, (vii) ein nach Part 2 des irischen Investment Funds, Companies and Miscellaneous Provisions Act 2005 errichteter *common contractual fund* („CCF“) in Irland, (viii) eine nach dem irischen Investment Limited Partnerships Act 1994 errichtete *investment limited partnership* („ILP“) in Irland, (ix) einen *fonds commun de placement* in Luxemburg („LUX FCP“), (x) einen *fonds commun de placement* in Frankreich („FRANZÖSISCHER FCP“), (xi)~~

~~(vii) ein Fonds-Segment (d.h. eine buchhalterisch und abwicklungstechnisch getrennte Zusammenfassung von Vermögenswerten eines Fonds und von für Rechnung dieses Fonds eingegangenen Verpflichtungen) (a) eines FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM in Form einer Lux SICAV, einer Lux SICAF, (b) eines FONDS IN VERTRAGSFORM in Form eines *Sondervermögens* im Sinne des deutschen InvG oder des deutschen KAGB oder eines Lux FCP oder (c) ein Fonds-Segment eines TEILFONDS eines FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM in Form einer Lux SICAV oder einer Lux SICAF oder eines FONDS IN VERTRAGSFORM in Form eines Lux FCP (jeweils ein („FONDS-SEGMENT“); eines Lux SICAV oder Lux SICAF, (xii) ein Fonds-Segment eines Lux FCP bzw. (xiii) ein Teilfonds einer bzw. eines als Umbrella-Fonds ausgestalteten Lux SICAV oder Lux SICAF, FRANZÖSISCHEN SICAV, Lux FCP, FRANZÖSISCHEN FCP, IC, UT oder eines CCF, (xiv) ein Fonds-Segment eines Teilfonds eines Lux SICAV or Lux SICAF, (xv) ein Fonds-Segment eines Teilfonds eines Lux FCP,~~

~~handeln, wobei in jedem dieser Fälle (ii) bis (xvii) das Unternehmen nur eine CLEARING-VEREINBARUNG oder ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG in der diesen CLEARING-BEDINGUNGEN als Anhang 3 bzw. Anhang 4 beigefügten Form abschließen kann;~~

~~(2) die in vorstehendem Absatz (1) aufgeführten FONDS IN VERTRAGSFORM, PARTNERSHIPS, UNIT TRUSTS, TEILFONDS und FONDS-SEGMENTE, welche keine eigene Rechtspersönlichkeit haben, schließen mithilfe einer Verwaltungsgesellschaft, eines General Partners, eines Treuhänders bzw. eines FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM (im Falle der vorstehenden Absätze (1)(vi) oder (vii)), der für Rechnung des entsprechenden aufgeführten FONDS IN VERTRAGSFORM, der PARTNERSHIP, des UNIT TRUSTS, TEILFONDS oder FONDS-SEGMENTS handelt, eine CLEARING-VEREINBARUNG, ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG oder EINBEZOGENE TRANSAKTIONEN ab, (jede(r) solche Verwaltungsgesellschaft, General Partner, Treuhänder und FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM, die bzw. der jeweils im Namen und für Rechnung eines FONDS IN VERTRAGSFORM, einer PARTNERSHIP, eines UNIT TRUSTS, TEILFONDS oder FONDS-SEGMENTS handelt, wird als „FONDS-PARTEI“ bezeichnet).~~

~~(2)(3) die CLEARING-VEREINBARUNG bezieht sich auf das Clearing ein oder mehrerer der folgenden Transaktionsarten: EUREX-TRANSAKTIONEN, EEX-TRANSAKTIONEN,~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 4

OTC-KREDITDERIVAT-TRANSAKTIONEN und OTC-ZINSDERIVAT-TRANSAKTIONEN (jeweils eine „**RK-ELIGIBLE TRANSAKTIONSART**“); dies gilt mit der Maßgabe, dass

[...]

- (34) das jeweilige Unternehmen hat eine technische Anbindung an die Systeme der Eurex Clearing AG und den Vertrag über die technische Anbindung an die Clearing-EDV der Eurex Clearing AG (Anschlussvertrag) unter Einbeziehung der Allgemeinen Geschäftsbedingungen über die technische Anbindung an die Clearing-EDV der Eurex Clearing AG abgeschlossen.

[...]

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 5

### 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 einer Kapitalanlagegesellschaft bzw. Kapitalverwaltungsgesellschaft 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, einer Kapitalanlagegesellschaft („**KAG**“) im Sinne des Investmentgesetzes („**InvG**“) bzw. einer Kapitalverwaltungsgesellschaft („**KVG**“) im Sinne des Kapitalanlagegesetzbuches („**KAGB**“):

##### 1 **Begriffsbestimmungen und Auslegung**

~~Im Sinne dieser VEREINBARUNG ist ein „**SONDERVERMÖGEN**“ ein von der KAG verwaltetes Sondervermögen im Sinne des § 2 Abs. 2 InvG bzw. ein von der KVG verwaltetes Sondervermögen im Sinne des § 1 Abs. 10 KAGB, einschließlich eines Teilfonds im Sinne des § 34 Abs. 2 InvG bzw. eines Teilsondervermögens im Sinne des § 96 Abs. 2 KAGB.~~

~~Im Sinne dieser VEREINBARUNG ist ein „**FONDS-SEGMENT**“ eines SONDERVERMÖGENS eine buchhalterisch und abwicklungstechnisch getrennte Zusammenfassung von Vermögenswerten eines SONDERVERMÖGENS und von für Rechnung dieses SONDERVERMÖGENS eingegangenen Verpflichtungen.~~

1.1 Jede Bezugnahme in dieser VEREINBARUNG auf einen „**ICM-KUNDEN**“ oder einen „**REGISTRIERTEN KUNDEN**“ ist als Bezugnahme auf einen bestimmten BETREFFENDEN FONDS bzw. ein bestimmtes BETREFFENDES FONDS-SEGMENT die KAG/KVG jeweils handelnd durch die FONDS-PARTEI für Rechnung eines bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 4 genannten SONDERVERMÖGENS bzw. FONDS-SEGMENTS eines von der KAG/KVG verwalteten SONDERVERMÖGENS als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEN KUNDEN zu verstehen.

1.2 In diesem Abschnitt 4:

(i) wird Jedesjede(r) in der Anlage zu diesem Abschnitt 4 genannte betreffende FONDS IN VERTRAGSFORM, PARTNERSHIP, UNIT TRUST oder TEILFONDS SONDERVERMÖGEN, für dessen Rechnung die KAG/KVG diese VEREINBARUNG abschließt oder

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 6

~~TRANSAKTIONEN tätig, wird in diesem Abschnitt 4 als das ein „BETREFFENDER FONDS-SEGMENT“~~ bezeichnet; ~~SONDERVERMÖGENS~~ bezeichnet;.

~~(ii)1.3 Jedes wird jedes in der Anlage zu diesem Abschnitt 4 genannte betreffende FONDS-SEGMENT für dessen Rechnung die KAG/KVG diese VEREINBARUNG abschließt oder TRANSAKTIONEN tätig, wird in diesem Abschnitt 4 als ein das „BETREFFENDES FONDS-SEGMENT“ bezeichnet; und-~~

~~(iii) ist „FONDS-PARTEI“ der jeweiligen Manager, General Partner, Treuhänder oder FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM, der auf Rechnung eines BETREFFENDEN FONDS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS handelt.~~

1.3 ~~Bezugnahmen in dieser VEREINBARUNG auf einen UNIT TRUST, der durch eine FONDS-PARTEI eine CLEARING VEREINBARUNG oder eine EINBEZOGENE TRANSAKTION „abschließt“, beziehen sich jeweils auf die FONDS-PARTEI als Treuhänder dieses UNIT TRUSTS, der diese CLEARING VEREINBARUNG oder EINBEZOGENE TRANSAKTION abschließt. Darüber hinaus beziehen sich in diesem Abschnitt 4 Bezugnahmen auf einen UNIT TRUST, der durch eine FONDS-PARTEI „handelt“ auf die FONDS-PARTEI, die als Treuhänder dieses UNIT TRUSTS handelt.~~

## 2 **Einbezogene Transaktionen für bestimmte Arten von FONDS IN VERTRAGSFORM**

Abweichend von Abschnitt 3 dieser VEREINBARUNG können ausschließlich OTC-KREDITDERIVAT-TRANSAKTIONEN gemäß Kapitel VIII Abschnitt 2 und OTC-ZINSDERIVAT-TRANSAKTIONEN gemäß Kapitel VIII Abschnitt 3 in das CLEARING für FONDS IN VERTRAGSFORM in Form eines Sondervermögens im Sinne des deutschen Investmentgesetzes oder des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs oder eines TEILFONDS oder FONDS-SEGMENTS eines solchen einbezogen werden.

## 3 **Informationspflichten, Abschluss von EINBEZOGENEN TRANSAKTIONEN und GRUNDLAGENVEREINBARUNGEN**

3.1 ~~Die KAG/KVG-Die FONDS-PARTEI~~ wird der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING-MITGLIED bei Abschluss jeder EINBEZOGENEN TRANSAKTION für Rechnung eines BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS mitteilen, für Rechnung welches BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS ~~die KAG/KVG-diese~~ EINBEZOGENE TRANSAKTION eingehengegangen wird.

3.2 Unbeschadet der Regelung in Abschnitt 1 Ziffer 2.1 dieser VEREINBARUNG gilt für jeden BETREFFENDEN Fonds bzw. jedes BETREFFENDE FONDS-SEGMENT, dass

~~(i) a~~ Alle Rechte und Pflichten zwischen dem CLEARING-MITGLIED und ~~der für ein bestimmtesdiesem~~ BETREFFENDENs FONDSsONDERVERMÖGEN bzw. für ein BETREFFENDENs FONDS-SEGMENT-als ICM-KUNDEN, handelnd durch die FONDS-PARTEI, handelnden KAG/KVG in Bezug auf KORRESPONDIERENDE EINBEZOGENE TRANSAKTIONEN auf der Grundlage dieser VEREINBARUNG bilden für Zwecke dieser VEREINBARUNG jeweils eine gesonderte GRUNDLAGENVEREINBARUNG darstellen; und dass

~~(ii) alle Rechte und Pflichten zwischen der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING-MITGLIED in Bezug auf EINBEZOGENE TRANSAKTIONEN, die zu den oben in Absatz (i)~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 7

genannten KORRESPONDIERENDEN EINBEZOGENEN TRANSAKTIONEN korrespondieren auf der Grundlage dieser VEREINBARUNG jeweils eine gesonderte GRUNDLAGENVEREINBARUNG darstellen.-

- 3.3 ~~Eine GRUNDLAGENVEREINBARUNG gilt jeweils ausschließlich (a) für die zwischen dem CLEARING-MITGLIED und der KAG/KVG, handelnd für Rechnung des BETREFFENDEN SONDERVERMÖGENS bzw. des BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS abgeschlossenen EINBEZOGENEN TRANSAKTIONEN bzw. (b) für die entsprechenden, zwischen der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING-MITGLIED abgeschlossenen EINBEZOGENEN TRANSAKTIONEN. Die Keine solche GRUNDLAGENVEREINBARUNGEN in Absatz 3.2 -haben keinen~~ Einfluss auf ein zwischen der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING-MITGLIED bzw. dem CLEARING-MITGLIED und ~~der KAG/KVG für Rechnung eines~~ anderen ~~SONDERVERMÖGENS BETREFFENDEN FONDS~~ bzw. ~~eines~~ anderen ~~BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT begründetes~~ ~~Rechtsverhältnis~~ ~~FONDS-SEGMENTS begründetes~~ ~~Rechtsverhältnis.~~
- 3.4 Die jeweiligen Positionen und Margin-Sicherheiten aus EINBEZOGENEN TRANSAKTIONEN werden von der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING-MITGLIED für ~~jedes~~ ~~BETREFFENDE~~ ~~FONDS~~ ~~SONDERVERMÖGEN~~ bzw. jedes BETREFFENDE FONDS-SEGMENTS, ~~für dessen Rechnung die KAG/KVG handelt, jeweils~~ gesondert erfasst.
- 4 Wiederbegründung von TRANSAKTIONEN**
- 4.1 ~~Die KAG/KVG~~ ~~Die FONDS-PARTEI~~ kann für ~~jedes~~ ~~BETREFFENDE~~ ~~FONDS~~ ~~SONDERVERMÖGEN separat~~ ~~gesondert~~ entscheiden, ob ~~sie für dieses BETREFFENDE SONDERVERMÖGEN~~ eine WAHL DER INTERIM-TEILNAHME bzw. die Auswahl DER UNMITTELBAREN WIEDERBEGRÜNDUNG nach Kapitel I Abschnitt 3 Unterabschnitt B Ziffer 5 der CLEARING-BEDINGUNGEN erklärt wird.
- 4.2 In Bezug auf die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE eines ~~einzelnen~~ ~~SONDERVERMÖGENS~~ ~~bestimmten~~ ~~FONDS~~ ~~IN~~ ~~GESELLSCHAFTSFORM~~, ~~FONDS~~ ~~IN~~ ~~VERTRAGSFORM~~ oder eines ~~TEILFONDS~~, kann ~~die KAG/KVG~~ ~~die FONDS-PARTEI~~ nur einheitlich für alle diese BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE entscheiden, ob ~~sie~~ eine WAHL DER INTERIM-TEILNAHME bzw. die AUSWAHL DER UNMITTELBAREN WIEDERBEGRÜNDUNG nach Kapitel I Abschnitt 3 Unterabschnitt B Ziffer 5 der CLEARING-BEDINGUNGEN erklärt wird.
- 5 Aufrechnung**
- Die Aufrechnung von Ansprüchen eines ~~ICM-KUNDEN~~ ~~BETREFFENDEN~~ ~~FONDS~~ oder ~~BETREFFENDEN~~ ~~FONDS-SEGMENTS~~, ~~jeweils handelnd durch die FONDS-PARTEI~~, mit ~~oder gegen~~ Ansprüche(n) anderer ICM-KUNDEN oder anderen Ansprüchen ist ausgeschlossen.
- 6 Kein Wechsel des CLEARING-Modells**
- ~~Der~~ ~~Der~~ durch die FONDS-PARTEI handelnde jeweilige BETREFFENDE FONDS oder das ~~jeweilige~~ ~~BETREFFENDE~~ ~~FONDS-SEGMENT~~ ~~ICM-KUNDE~~ kann eine CLEARING-VEREINBARUNG bzw. ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG nur in der diesen CLEARING-BEDINGUNGEN als Anhang 3 oder Anhang 4 beigefügten Form abschließen. Ein Wechsel des CLEARING-Modells ist nicht möglich.

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 8

## **7 Zusicherungen und Verpflichtungserklärungen ~~Bestätigung~~ gegenüber EUREX CLEARING AG**

- 7.1 Das CLEARING-MITGLIED und die FONDS-PARTEI, die für Rechnung des jeweiligen BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS handelt, sichert für jeden BETREFFENDEN FONDS bzw. für jedes BETREFFENDE FONDS-SEGMENT jeweils einzeln im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieversprechens gegenüber der Eurex Clearing AG zu, dass:
- (i) die FONDS-PARTEI die erforderliche rechtliche Befugnis hat, die MASSGEBLICHE ICM-DOKUMENTATION und jedes weiteres Dokument im Zusammenhang mit der MASSGEBLICHEN ICM-DOKUMENTATION für Rechnung dieses BETREFFENDEN FONDS oder dieses BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS abzuschließen;
  - (ii) dieser BETREFFENDE FONDS bzw. dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT rechtlich existent ist und in Übereinstimmung mit dem geltenden Recht errichtet wurde;
  - (iii) dieser BETREFFENDE FONDS bzw. dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT und/oder seine FONDS-PARTEI, sofern erforderlich, der Registrierung und/oder Regulierung in seiner bzw. ihrer entsprechenden Rechtsordnung unterliegt und durch die zuständigen Aufsichtsbehörden in seinem bzw. ihrem Herkunftsstaat beaufsichtigt wird und/oder deren Befugnissen unterliegt;
  - (iv) weder der Abschluss noch die Erfüllung der Verpflichtungen aus der MASSGEBLICHEN ICM-DOKUMENTATION und jedem weiteren Dokument im Zusammenhang mit der MASSGEBLICHEN ICM-DOKUMENTATION durch diesen BETREFFENDEN FONDS oder dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT, handelnd durch die betreffende FONDS-PARTEI, den jeweils geltenden Gesetzen oder Verordnungen, insbesondere die für diesen BETREFFENDEN FONDS, dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT oder die FONDS-PARTEI geltenden Investmentgesetzen und Verordnungen, Bestimmungen der konstitutiven Dokumente dieses BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS, einer Verfügung oder einem Urteil eines Gerichts oder einer Behörde, an die bzw. an das dieser BETREFFENDE FONDS, dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT oder die FONDS-PARTEI oder einer seiner bzw. ihrer Vermögensgegenstände gebunden ist, oder einem Vertrag oder Instrument, an den bzw. an das dieser BETREFFENDE FONDS, dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT oder die FONDS-PARTEI gebunden ist oder der bzw. das die Vermögenswerte dieses BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS betrifft, widerspricht; und
  - (v) die FONDS-PARTEI, soweit dieser BETREFFENDE FONDS ein UNIT TRUST darstellt, in Bezug auf jede Verpflichtung, die sie auf der Grundlage der MASSGEBLICHEN ICM-DOKUMENTATION für Rechnung des BETREFFENDEN FONDS eingeht bzw. eingehen wird, das Recht hat, aus dem Vermögen des BETREFFENDEN FONDS Ausgleich zu erhalten.
- 7.2 Für jedes BETREFFENDE FONDS SEGMENT sichert die FONDS-PARTEI, die für Rechnung dieses BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS handelt, jeweils im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieversprechens gegenüber der EUREX CLEARING AG zu, dass



	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 9

- (i) sie die Anleger des Fonds, zu dem dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gehört, über die vertragliche Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN im Zusammenhang mit dem CLEARING und alle möglichen wirtschaftlichen Nachteile des Abschlusses dieser VEREINBARUNG für dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gegenüber einem einheitlichen Abschluss der VEREINBARUNG mit dem Fonds aufgeklärt hat und die Anleger des Fonds, zu dem dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gehört, bereit sind, die mit dem Abschluss der VEREINBARUNG mit diesem BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT verbundenen möglichen wirtschaftlichen Risiken und Nachteile zu tragen,
- (ii) soweit einschlägig, der relevante Fondsprospekt eine entsprechende Offenlegung der vertraglichen Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN und allen möglichen wirtschaftlichen Risiken einer solchen vertraglichen Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN wie oben (i) dargestellt enthält.

~~Soweit die KAG/KVG für Rechnung eines BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS eines von der KAG/KVG verwalteten SONDERVERMÖGENS als REGISTRIERTEM KUNDEN handelt, sichert sie jeweils im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieversprechens gegenüber der EUREX CLEARING AG zu, dass sie die Anleger des SONDERVERMÖGENS, zu dem die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE gehören, über mögliche wirtschaftliche Nachteile des Abschlusses dieser VEREINBARUNG für ein BETREFFENDES FONDS-SEGMENT gegenüber einem einheitlichen Abschluss der VEREINBARUNG mit dem SONDERVERMÖGEN aufgeklärt hat und die Anleger des Sondervermögens, zu dem die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE gehören, bereit sind, die mit dem Abschluss der VEREINBARUNG mit den BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTEN verbundenen möglichen wirtschaftlichen Risiken und Nachteile zu tragen.~~

## 8 Änderungen, Laufzeit und Kündigung

- 8.1 In Abweichung von Abschnitt 1 Ziffer 13 dieser VEREINBARUNG kann die Anlage zu Abschnitt 4 dieser VEREINBARUNG im Falle einer Neuaufnahme, der Umbenennung oder des Ausscheidens eines ~~BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS~~ bzw. ~~BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS~~ oder der Verschmelzung von ~~BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGEN~~ bzw. ~~BETREFFENDEN~~ FONDS-SEGMENTEN durch den Austausch der durch alle PARTEIEN gegengezeichneten ergänzten Ausfertigung der Anlage zu Abschnitt 4 dieser VEREINBARUNG geändert werden.
- 8.2 Eine solche Änderungsvereinbarung der Anlage zu Abschnitt 4 dieser VEREINBARUNG infolge der Neuaufnahme eines ~~BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS~~ bzw. ~~BETREFFENDEN~~ FONDS-SEGMENTS oder der Verschmelzung durch Neugründung eines ~~BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS~~ bzw. ~~BETREFFENDEN~~ FONDS-SEGMENTS begründet den Abschluss einer neuen gesonderten GRUNDLAGENVEREINBARUNG mit ~~der KAG/KVG handelnd für das dem~~ jeweils neu hinzugekommenen n durch die FONDS-PARTEI handelnden BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGEN bzw. ~~BETREFFENDEN~~ FONDS-SEGMENT oder im Rahmen der Verschmelzung neugegründeten BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGEN bzw. ~~BETREFFENDEN~~ FONDS-SEGMENT.
- 8.3 Abweichend von Abschnitt 1 Ziffer 10 dieser VEREINBARUNG kann eine Beendigung dieser durch ~~die KAG/KVG die~~ FONDS-PARTEI für Rechnung ~~eines eines~~ BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS bzw. ~~eines~~ BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS geschlossenen VEREINBARUNG gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 13.2.1 i.V.m. Ziffer 13.1.1 der CLEARING

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 10

BEDINGUNGEN auch durch eine der Eurex Clearing AG und dem CLEARING-MITGLIED durch ~~die KAG/KVG die FONDS-PARTEI~~ mitgeteilte Änderung der Anlage zu Abschnitt 4 dieser VEREINBARUNG, die die Löschung ~~dieseses~~ BETREFFENDEN ~~FONDS SONDERVERMÖGENS~~ bzw. des BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS vorsieht, erfolgen.

- 8.4 Jede Bezugnahme in dieser VEREINBARUNG auf die Anlage zu Abschnitt 4 dieser VEREINBARUNG ist eine Bezugnahme auf die betreffende Anlage 4 dieser VEREINBARUNG in der jeweils gültigen Fassung.

**Anlage zu Abschnitt 4**

Legal Name of the Relevant Fund				
Name of the asset pool (fund)				
<del>Member code of the CM</del>				
<del>Member code of the RC</del>				
Specified Multiplier for calculation Margin Requirement				
<del>Unique reference for the asset pool</del>				
CBF/GS Securities Margin account				
CBF/GS Main account of CM				
CBF Int 6-series Securities Margin account				
CBF Int 6-series Main account of CM				
<del>Pool ID</del>				
<del>Netting Parameter</del>				
<del>Clearing Currency</del>				
<del>Approved Trade System ID of asset pool (single fund)</del>				
<del>Request type</del>				
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)				
Jurisdiction (ISO code)				

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 12

\_\_\_\_\_  
(Ort) \_\_\_\_\_ (Datum)

\_\_\_\_\_  
(als CLEARING-MITGLIED)

\_\_\_\_\_  
Name: \_\_\_\_\_ Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion: \_\_\_\_\_ Funktion:

\_\_\_\_\_  
(~~KAG/KVG-FONDS-PARTEI~~ handelnd für Rechnung der in Anlage zu Abschnitt 4 jeweils genannten BETREFFENDEN  
~~FONDSSONDERVERMÖGEN~~ bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE)

\_\_\_\_\_  
Name: \_\_\_\_\_ Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion: \_\_\_\_\_ Funktion:

### **Eurex Clearing Aktiengesellschaft**

\_\_\_\_\_  
(EUREX CLEARING AG)

\_\_\_\_\_  
Name: \_\_\_\_\_ Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion: \_\_\_\_\_ Funktion:

Referenz	Beschreibung
Legal Name of the Relevant Fund	<p>Rechtliche Bezeichnung des BETREFFENDEN <del>FONDS SONDERVERMÖGENS</del> bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS.</p> <p>Im Falle eines TEILFONDS bzw. TEILSONDERVERMÖGENS ist der <u>FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM, FONDS IN VERTRAGSFORM oder UNIT TRUST</u> auf den sich der TEILFONDS bzw. das TEILSONDERVERMÖGEN bezieht, mit anzugeben.</p> <p>Im Fall der Angabe eines BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS ist für Zwecke der eindeutigen Zuordnung immer auch die rechtliche Bezeichnung des <u>FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM, FONDS IN VERTRAGSFORM oder TEILFONDS SONDERVERMÖGENS</u> mit anzugeben, zu dem das BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gehört (Format: &lt;Name des <u>FondsSONDERVERMÖGENS</u>&gt;-&lt;Name des BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS&gt;).</p>
Name of the asset pool (fund)	<del>Name-Kontobezeichnung des einzelnen segregierten Kontos des BETREFFENDEN <u>FONDS SONDERVERMÖGENS</u>/BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS (book_name).</del>
<del>Member code of the CM</del>	<del>Eurex Clearing Mitglieds-ID (<i>Eurex Clearing Member ID</i>) des CLEARING-MITGLIEDS (CM).</del>
<del>Member code of the RC</del>	<del>Eurex Clearing Mitglieds-ID (<i>Eurex Clearing Member ID</i>) des FONDS-MANAGERS / KAG bzw. KVG handelnd für Rechnung des BETREFFENDEN <u>SONDERVERMÖGENS</u> bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS.</del>
Specified Multiplier for calculation Margin Requirement	Der vereinbarte Multiplikator zur Bestimmung der Höhe der MARGIN-VERPFLICHTUNG sollte größer oder gleich 1,0000 sein.
<del>Unique reference for the asset pool</del>	<del>Mittels dieser eindeutigen 4-stelligen alphanumerischen Kundenreferenz-ID (<i>Client reference ID</i>) werden Wertpapiersicherheiten dem segregierten BETREFFENDEN <u>FONDS SONDERVERMÖGEN</u> bzw. segregierten BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT zugeordnet. Die auf Ebene des CLEARING-MITGLIEDS eindeutige Referenz-ID muss bei der Übertragung von Wertpapiersicherheiten in der SWIFT-Nachricht angegeben werden.</del>
CBF/GS Securities Margin account	CBF-Unterkonto des CLEARING-MITGLIEDS nach Kunden segregiert.
CBF/GS Main account of CM	Festgelegtes Konto für Rücklieferung von Margin in Form von WERTPAPIEREN. Das festgelegte Creation Hauptkonto (Creation Main Account) kann bei CBF entweder im Namen des CLEARING-MITGLIEDS oder des Verwahrers des ICM-KUNDEN geführt werden.
CBF Int 6-series Securities Margin account	Wertpapier-Margin-Konto ( <i>Creation-Account</i> ) des CLEARING-MITGLIEDS nach Kunden segregiert.
CBF Int 6-series Main account	Festgelegtes Konto für Rücklieferung von MARGIN in Form von

Referenz	Beschreibung
of Clearing Member	WERTPAPIEREN. Das festgelegte Creation Hauptkonto (Creation Main Account) kann bei CBF entweder im Namen des CLEARING-MITGLIEDS oder des Verwahrers des ICM-KUNDEN geführt werden.
<del>Pool ID</del>	<del>Feld wird automatisch ausgefüllt. Struktur des Feldes „&lt;Member Code of the RC&gt;X&lt; &lt;Member Code of the CM&gt; &lt;Unique reference for the asset pool&gt;“.</del>
<del>Netting Parameter</del>	<del>Netting Parameters — festgelegt pro Positionskonto/segregiertem BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGEN/segregiertem BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT:  — „O“ (die Grundeinstellung): Eligible, mit demselben Netting String gekennzeichnete Geschäfte werden zusammen verrechnet. Wird „Y“ für die Verrechnung in EurexOTC Clear GUI eingestellt, werden eligible Geschäfte im nächsten EOD-Verfahren verrechnet.  — „Y“: Eligible Geschäfte mit demselben Netting String werden zusammen verrechnet. Eligible Geschäfte ohne Netting String werden ebenfalls zusammen im nächsten EOD-Verfahren verrechnet.  — „N“: Auf diesem Positionskonto erfolgt keine Verrechnung.</del>
<del>Clearing Currency</del>	<del>CLEARING-WÄHRUNG des CLEARING-MITGLIEDS (EUR oder CHF).</del>
<del>Approved Trade System ID of asset pool (single fund)</del>	<del>Kennung des BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS/BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS im Anerkannten Trade Source System.</del>
<del>Request type</del>	<del>Die folgenden Auftragsarten sind erlaubt: „hinzufügen (add)“ und „löschen (delete)“. Für jede Auftragsart ist ein eigenes technisches Formular (upload sheet) einzureichen.  Zusätzlich ist eine aktualisierte Anlage, die alle BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGEN bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE aufführt, einzureichen.</del>
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)	Durch anerkannte Anbieter gemäß ISO Standard 17442 vergebener Legal Entity Identifier / Vorläufer Legal Entity Identifier des BETREFFENDEN <u>FONDS</u> SONDERVERMÖGENS
Jurisdiction (ISO code)	ISO Code der Länderkennung des BETREFFENDEN <u>FONDS</u> SONDERVERMÖGENS

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 15

## **~~Abschnitt 5 – Besondere Bestimmungen für das CLEARING von TRANSAKTIONEN mit bestimmten anderen Formen von Investmentfonds ohne Rechtspersönlichkeit oder einem Teilfonds~~**

~~Die nachfolgenden besonderen Bestimmungen gelten für das CLEARING von TRANSAKTIONEN mit einem der folgenden Investmentfonds ohne Rechtspersönlichkeit bzw. einem der unter (vii) genannten Teilfonds bzw. unter (viii) genannten FONDS-SEGMENTE (d.h. eine buchhalterisch und abwicklungstechnisch getrennte Zusammenfassung von Vermögenswerten eines FONDS und von für Rechnung dieses FONDS eingegangenen Verpflichtungen) als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN:~~

- ~~(i) – AUT,~~
- ~~(ii) – Lux FCP,~~
- ~~(iii) – FRANZÖSISCHER FCP,~~
- ~~(iv) – UT,~~
- ~~(v) – CCF,~~
- ~~(vi) – ILP,~~
- ~~(vii) – ein Teilfonds einer bzw. eines als Umbrella-Fonds ausgestalteten Lux SICAV oder Lux SICAF, FRANZÖSISCHEN SICAV, LUX FCP, FRANZÖSISCHEN FCP, IC, UT oder CCF („TEILFONDS“), oder~~
- ~~(viii) – ein Fonds-Segment einer bzw. eines LUX SICAV, LUX SICAF oder LUX FCP, einschließlich eines Fonds-Segments eines Teilfonds dieser bzw. dieses LUX SICAV, LUX SICAF oder LUX FCP („FONDS-SEGMENT“).~~

## **~~7 – Begriffsbestimmungen~~**

~~Jede Bezugnahme in dieser VEREINBARUNG auf einen „ICM-KUNDEN“ oder einen „REGISTRIERTEN KUNDEN“ ist als Bezugnahme auf~~

- ~~(i) – im Falle eines AUT, den betreffenden Fondstreuhänder (*trustee*) (einschließlich eines etwaigen Fondsmanagers (*fund manager*), der für diesen Fondstreuhänder als Vertreter handelt) (der „AUT-FONDSTREUHÄNDER“), handelnd ausschließlich für einen bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten AUT als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
- ~~(ii) – im Falle eines Lux FCP, einen bestimmten, in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten Lux FCP, vertreten durch seine Fondsverwaltungsgesellschaft (*société de gestion*) (die „LUX FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“) bzw. durch einen von dieser beauftragten Investment Manager (der „LUX INVESTMENT MANAGER“), als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
- ~~(iii) – im Falle eines FRANZÖSISCHEN FCP, einen bestimmten, in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten FRANZÖSISCHEN FCP, vertreten durch seine Fondsverwaltungsgesellschaft (*société de gestion*) (die „FRANZÖSISCHE FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“) bzw. durch einen von diesem beauftragten~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 16

~~Investment Manager (der „FRANZÖSISCHE INVESTMENT MANAGER“ und zusammen mit dem LUX INVESTMENT MANAGER, ein „INVESTMENT MANAGER“), als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~

- ~~(iv) im Falle eines UT, den betreffenden Fondstrehänder (trustee) (einschließlich eines etwaigen Fondsmanagers (fund manager), der für diesen Fondstrehänder als Vertreter handelt) (der „UT-FONDSSTREUHÄNDER“ und zusammen mit einem AUT-FONDSSTREUHÄNDER ein „FONDSSTREUHÄNDER“), handelnd ausschließlich für einen bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten UT-ICM-KUNDEN als REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
- ~~(v) im Falle eines CCF, die betreffende Fondsverwaltungsgesellschaft (die „CCF-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“ und zusammen mit einer Lux FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT und einer FRANZÖSISCHEN FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT eine „VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“), handelnd ausschließlich für einen bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten CCF als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN;~~
- ~~(vi) im Falle einer ILP, der betreffende General Partner (einschließlich eines etwaigen Investment Managers, der für diesen General Partner als Vertreter handelt) (der „GENERAL PARTNER“), handelnd ausschließlich für Rechnung einer bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten ILP als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN, bzw.~~
- ~~(vii) im Falle eines TEILFONDS, jeweils~~
  - ~~(a) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS der betreffenden Lux SICAV bzw. Lux SICAF, als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN, bzw.~~
  - ~~(b) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS der betreffenden FRANZÖSISCHEN SICAV, als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
  - ~~(c) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS eines Lux FCP, vertreten durch die Lux FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder den Lux INVESTMENT MANAGER als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
  - ~~(d) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS eines FRANZÖSISCHEN FCP, vertreten durch die FRANZÖSISCHE FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder den FRANZÖSISCHEN INVESTMENT MANAGER als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
  - ~~(e) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS eines IC als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
  - ~~(f) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS eines UT, vertreten durch den FONDSSTREUHÄNDER, als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN, bzw.~~



	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 17

~~(g) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS eines CCF, vertreten durch die Verwaltungsgesellschaft, als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~

~~(viii) im Falle eines FONDS-SEGMENTS, jeweils~~

~~(a) das bestimmte in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannte FONDS-SEGMENT einer LUX SICAV oder eines TEILFONDS einer LUX SICAV oder LUX SICAF als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~

~~(b) das bestimmte in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannte FONDS-SEGMENT eines LUX FCP oder eines TEILFONDS eines LUX FCP als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~

~~zu verstehen:~~

~~Jede bzw. jedes~~

~~(i) AUT, für den der betreffende FONDSTREUHÄNDER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(ii) Lux FCP, für den die betreffende VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder der betreffende INVESTMENT MANAGER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt, (iii) FRANZÖSISCHE FCP, für den die betreffende VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder der betreffende INVESTMENT MANAGER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(iv) UT, für den der betreffende FONDSTREUHÄNDER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(v) CCF, für den die betreffende VERWALTUNGSGESELLSCHAFT diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(vi) ILP, für den der betreffende GENERAL PARTNER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt, bzw.~~

~~(vii) TEILFONDS, für den die betreffende LUX SICAV, LUX SICAF, FRANZÖSISCHE SICAV, der IC, der FONDSTREUHÄNDER, die VERWALTUNGSGESELLSCHAFT bzw. der INVESTMENT MANAGER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~wird in diesem Abschnitt 5 als der „BETREFFENDE FONDS“ bezeichnet.~~

~~Jedes~~

~~(i) FONDS-SEGMENT, für das die betreffende LUX SICAV oder LUX SICAF diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(ii) FONDS-SEGMENT, für das die betreffende LUX FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder der betreffende LUX INVESTMENT MANAGER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~wird in diesem Abschnitt 5 als das „BETREFFENDE FONDS-SEGMENT“ bezeichnet.~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 18

~~1.4 Sofern dieser Abschnitt 5 auf eine VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder einen INVESTMENT MANAGER handelnd für eine bestimmte FRANZÖSISCHE FCP Bezug nimmt, ist eine solche Bezugnahme als eine Bezugnahme auf diese FRANZÖSISCHE FCP als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN zu verstehen. Gleichmaßen, sofern dieser Abschnitt 5 auf eine FRANZÖSISCHE SICAV, VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder einen INVESTMENT MANAGER handelnd für einen bestimmten TEILFOND Bezug nimmt, ist eine solche Bezugnahme als eine Bezugnahme auf diesen TEILFOND als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN zu verstehen.~~

## ~~8 Informationspflichten, Abschluss von TRANSAKTIONEN und GRUNDLAGENVEREINBARUNGEN~~

~~Jeder FONDSTREUHÄNDER, jede VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, jeder INVESTMENT MANAGER, jede Lux SICAV oder Lux SICAF, jede FRANZÖSISCHE SICAV, jeder IC und jeder GENERAL PARTNER wird der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING MITGLIED bei Abschluss jeder EINBEZOGENEN TRANSAKTION mitteilen, für Rechnung welches BETREFFENDEN FONDS und ggf. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS als ICM-KUNDEN die EINBEZOGENE TRANSAKTION eingegangen wird.~~

~~Alle Rechte und Pflichten zwischen dem CLEARING MITGLIED und dem/der jeweils für einen bestimmten BETREFFENDEN FONDS oder ein bestimmtes BETREFFENDES FONDS-SEGMENT als ICM-KUNDEN handelnden FONDSTREUHÄNDER, VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, INVESTMENT MANAGER, Lux SICAV bzw. Lux SICAF, FRANZÖSISCHE SICAV, IC oder GENERAL PARTNER in Bezug auf KORRESPONDIERENDE EINBEZOGENE TRANSAKTIONEN bilden für Zwecke dieser VEREINBARUNG jeweils eine gesonderte GRUNDLAGENVEREINBARUNG.~~

~~Eine GRUNDLAGENVEREINBARUNG gilt jeweils ausschließlich (a) für die zwischen dem CLEARING MITGLIED und dem FONDSTREUHÄNDER, der VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, dem INVESTMENT MANAGER, der Lux SICAV bzw. Lux SICAF, der FRANZÖSISCHEN SICAV, IC oder dem GENERAL PARTNER jeweils handelnd für den BETREFFENDEN FONDS oder das BETREFFENDE FONDS-SEGMENT als ICM-KUNDEN, abgeschlossenen KORRESPONDIERENDEN EINBEZOGENEN TRANSAKTIONEN und (b) für die korrespondierenden, zwischen der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING MITGLIED abgeschlossenen EINBEZOGENEN TRANSAKTIONEN. Keine solche GRUNDLAGENVEREINBARUNG hat Einfluss auf ein zwischen der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING MITGLIED bzw. dem CLEARING MITGLIED und dem FONDSTREUHÄNDER, der VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, dem INVESTMENT MANAGER, der Lux SICAV bzw. Lux SICAF, der FRANZÖSISCHEN SICAV, IC oder dem GENERAL PARTNER jeweils handelnd für einen anderen BETREFFENDEN FONDS oder ein anderes BETREFFENDES FONDS-SEGMENT als ICM-KUNDEN begründetes Rechtsverhältnis.~~

~~Die jeweiligen Positionen und Margin-Sicherheiten aus EINBEZOGENEN TRANSAKTIONEN werden von der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING MITGLIED für jeden BETREFFENDEN FONDS oder jedes BETREFFENDE FONDS-SEGMENT, für den/das der FONDSTREUHÄNDER, die VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, der INVESTMENT MANAGER, die Lux SICAV bzw. Lux SICAF, die FRANZÖSISCHE SICAV, IC oder der GENERAL PARTNER jeweils handelt, gesondert erfasst.~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 19

## **9 ~~Wiederbegründung von TRANSAKTIONEN~~**

~~Der FONDSTREUHÄNDER, die VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, der INVESTMENT MANAGER, die betreffende Lux SICAV oder Lux SICAF, die FRANZÖSISCHE SICAV, die IC bzw. der GENERAL PARTNER entscheidet für jeden BETREFFENDEN FONDS als ICM-KUNDEN separat, ob eine WAHL DER INTERIM-TEILNAHME bzw. die AUSWAHL DER UNMITTELBAREN WIEDERBEGRÜNDUNG nach Kapitel I Abschnitt 3 Unterabschnitt B Ziffer 5 der CLEARING-BEDINGUNGEN erklärt wird.~~

~~In Bezug auf die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE eines einzelnen Fonds, kann die Lux FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, der LUX INVESTMENT MANAGER, die Lux SICAV oder Lux SICAF nur für alle BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE zusammen entscheiden, ob eine WAHL DER INTERIM-TEILNAHME bzw. die AUSWAHL DER UNMITTELBAREN WIEDERBEGRÜNDUNG nach Kapitel I Abschnitt 3 Unterabschnitt B Ziffer 5 der CLEARING-BEDINGUNGEN erklärt wird.~~

## **10 ~~Aufrechnung~~**

~~Die Aufrechnung von Ansprüchen eines ICM-KUNDEN mit Ansprüchen anderer ICM-KUNDEN oder anderen Ansprüchen ist ausgeschlossen.~~

## **11 ~~Kein Wechsel des CLEARING-MODELLS~~**

~~Der ICM-KUNDE kann eine Clearing-Vereinbarung oder eine ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG nur in der diesen CLEARING-BEDINGUNGEN als Anhang 3 oder Anhang 4 beigefügten Form abschließen. Ein Wechsel des CLEARING-MODELLS ist nicht möglich.~~

## **12 ~~Bestätigung gegenüber der Eurex Clearing AG~~**

6.1 ~~Soweit die Lux SICAV / Lux SICAF oder die bestimmte VERWALTUNGSGESELLSCHAFT bzw. der bestimmte INVESTMENT MANAGER eines LUX FCP für Rechnung eines BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS einer Lux SICAV / Lux SICAF bzw. eines LUX FCP als ICM-KUNDEN handelt, sichert sie/er jeweils im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieversprechens gegenüber der Eurex Clearing AG zu, dass sie/er die Anleger der Lux SICAV / Lux SICAF oder des LUX FCP zu der/dem die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE gehören, über die vertragliche Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN im Zusammenhang mit dem Clearing und alle mögliche wirtschaftliche Nachteile des Abschlusses dieser VEREINBARUNG für ein BETREFFENDES FONDS-SEGMENT gegenüber einem einheitlichen Abschluss der VEREINBARUNG mit der Lux SICAV / Lux SICAF bzw. dem LUX FCP aufgeklärt hat und die Anleger der Lux SICAV / Lux SICAF, LUX FCP bzw. eines TEILFONDS hiervon zu der/dem die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE gehören, bereit sind, die mit dem Abschluss der Vereinbarung mit den BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTEN verbundenen möglichen wirtschaftlichen Risiken und Nachteilen zu tragen.~~

6.2 ~~Die Lux SICAV / Lux SICAF oder die bestimmte VERWALTUNGSGESELLSCHAFT bzw. der bestimmte INVESTMENT MANAGER eines LUX FCP sichert ferner jeweils im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieverprechens gegenüber der Eurex Clearing AG zu, dass der von den zuständigen Aufsichtsbehörden gebilligte relevante Fondsprospekt eine entsprechende Offenlegung der vertraglichen Segregation zwischen Fonds-Segmenten im Zusammenhang mit dem CLEARING und aller möglichen~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 20

wirtschaftlichen Risiken einer solchen vertraglichen Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN wie in 6.1 oben dargestellt enthält.

### **13 ~~Änderungen, Laufzeit und Kündigung~~**

~~In Abweichung von Abschnitt 1 Ziffer 13 dieser VEREINBARUNG kann die Anlage zu Abschnitt 5 dieser VEREINBARUNG im Falle einer Neuaufnahme, der Umbenennung oder des Ausscheidens eines BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS oder der Verschmelzung BETREFFENDER FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS durch den Austausch der durch alle PARTEIEN gegengezeichneten ergänzten Ausfertigung der Anlage zu Abschnitt 5 dieser VEREINBARUNG geändert werden.~~

~~Eine solche Änderungsvereinbarung der Anlage zu Abschnitt 5 dieser VEREINBARUNG infolge der Neuaufnahme eines BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS oder der Verschmelzung durch Neugründung eines BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS begründet den Abschluss einer neuen gesonderten GRUNDLAGENVEREINBARUNG mit dem FONDSTREUHÄNDER, der VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, dem INVESTMENT MANAGER, der LUX SICAV oder LUX SICAF, der FRANZÖSISCHEN SICAV, der IC bzw. dem GENERAL PARTNER jeweils handelnd für den/das jeweils neu hinzugekommene(n) BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDE FONDS-SEGMENT als ICM-KUNDEN oder im Rahmen der Verschmelzung neugegründete(n) BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDE FONDS-SEGMENT als ICM-KUNDEN.~~

~~Abweichend von Abschnitt 1 Ziffer 10 dieser VEREINBARUNG kann eine Beendigung dieser für einen BETREFFENDEN FONDS oder ein BETREFFENDES FONDS-SEGMENT geschlossenen VEREINBARUNG gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 13.2.1 i.V.m. Ziffer 13.1.1 der CLEARING-BEDINGUNGEN auch durch eine der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING-MITGLIED durch den FONDSTREUHÄNDER, die VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, den INVESTMENT MANAGER, die betreffende LUX SICAV oder LUX SICAF, die FRANZÖSISCHE SICAV, die IC bzw. dem GENERAL PARTNER mitgeteilte Änderung der Anlage zu Abschnitt 5 dieser VEREINBARUNG, die die Löschung des BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS vorsieht, erfolgen.~~

~~Jede Bezugnahme in dieser VEREINBARUNG auf die Anlage zu Abschnitt 5 dieser VEREINBARUNG ist eine Bezugnahme auf die betreffende Anlage 5 dieser VEREINBARUNG in der jeweils gültigen Fassung.~~

**Anlage zu Abschnitt 5**

Legal Name of the Relevant Fund				
Name of the asset pool (fund)				
Member code of the CM				
Member code of the RC				
Specified Multiplier for calculation Margin Requirement				
Unique reference for the asset pool				
CBF/GS Securities Margin account				
CBF/GS Main account of CM				
CBF Int 6-series Securities Margin account				
CBF Int 6-series Main account of CM				
Pool ID				
Netting Parameter				
Clearing Currency				
Approved Trade System ID of asset pool (single fund)				
Request type				
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)				
Jurisdiction (ISO code)				

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 22

---

(Ort) (Datum)

---

(als CLEARING-MITGLIED)

---

Name: Name:  
Funktion: Funktion:

---

~~{{FONDSTREUHÄNDER/VERWALTUNGSGESELLSCHAFT/INVESTMENT MANAGER/LUX-SICAV/LUX-SICAF/FRANZÖSISCHE SICAV/IC/GENERAL PARTNER} jeweils handelnd für die in Anlage zu Abschnitt 5 jeweils genannten BETREFFENDEN FONDS [oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE]-als-ICM-KUNDEN)~~

---

Name: Name:  
Funktion: Funktion:

---

**Eurex Clearing Aktiengesellschaft**

(EUREX-CLEARING-AG)

---

Name: Name:  
Funktion: Funktion:

Referenz	Beschreibung
Legal Name of the Relevant Fund	Rechtliche Bezeichnung des BETREFFENDEN FONDS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS. Im Falle eines TEILFONDS ist der UMBRELLA-FONDS, dem der TEILFONDS zugehört, mit anzugeben. Im Fall der Angabe eines BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS ist für Zwecke der eindeutigen Zuordnung immer auch die rechtliche Bezeichnung des FONDS mit anzugeben, zu dem das BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gehört (Format: <Name des FONDS><Name des BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS>).
Name of the asset pool (fund)	Name des einzelnen BETREFFENDEN FONDS/BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS (book_name).
Member code of the CM	Eurex Clearing Mitglieds-ID (Eurex Clearing Member ID) des CLEARING-MITGLIEDS.
Member code of the RC	Eurex Clearing Mitglieds-ID (Eurex Clearing Member ID) des betreffenden FONDSTREUHÄNDERS, der betreffenden VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, des betreffenden INVESTMENT MANAGERS, der betreffenden Lux SICAV/Lux SICAF, FRANZÖSISCHEN SICAV, der betreffenden IC bzw. des betreffenden GENERAL PARTNERS handelnd auf Rechnung des BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS.
Specified Multiplier for calculation Margin Requirement	Der vereinbarte Multiplikator zur Bestimmung der Höhe der MARGIN-VERPFLICHTUNG sollte größer oder gleich 1,0000 sein.
Unique reference for the asset pool	Mittels dieser eindeutigen 4-stelligen alphanumerischen Kundenreferenz-ID (Client reference ID) werden Wertpapiersicherheiten dem segregierten BETREFFENDEN FONDS oder segregierten BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT zugeordnet. Die auf Ebene des CLEARING-MITGLIEDS eindeutige Referenz-ID muss bei der Übertragung von Wertpapiersicherheiten in der SWIFT-Nachricht angegeben werden.
CBF/GS Securities Margin account	CBF-Unterkonto des Clearing-Mitglieds nach Kunden segregiert. (z. B. 79990520).
CBF/GS Main account of CM	Festgelegtes Konto für Rücklieferung von Margin in Form von WERTPAPIEREN. Das festgelegte Hauptkonto kann bei CBF entweder im Namen des CLEARING-MITGLIEDS oder des Verwahrers des ICM-KUNDEN geführt werden.
CBF Int 6-series Securities Margin account	Wertpapier-Margin-Konto (Creation Account) des CLEARING-MITGLIEDS nach Kunden segregiert.
CBF Int 6-series Main account of CM	Festgelegtes Konto für Rücklieferung von Margin in Form von WERTPAPIEREN. Das festgelegte Creation Hauptkonto (Creation Main Account) kann bei CBF entweder im Namen des CLEARING-

Referenz	Beschreibung
	<del>MITGLIEDS oder des Verwahrers des ICM-KUNDEN geführt werden.</del>
Pool ID	<del>Feld wird automatisch ausgefüllt. Struktur des Feldes „&lt;Member Code of the RC&gt;X&lt; Member Code of the CM&gt; &lt;Unique reference for the asset pool&gt;“.</del>
Netting Parameter	<p><del>Netting Parameters — festgelegt pro Positionskonto/segregiertem BETREFFENDEN FONDS/segregiertem BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT:</del></p> <p><del>— „O“ (die Grundeinstellung): Eligible, mit demselben Netting String gekennzeichnete Geschäfte werden zusammen verrechnet. Wird „Y“ für die Verrechnung in EurexOTC-Clear GUI eingestellt, werden eligible Geschäfte im nächsten EOD-Verfahren verrechnet.</del></p> <p><del>— „Y“: Eligible Geschäfte mit demselben Netting String werden zusammen verrechnet. Eligible Geschäfte ohne Netting String werden ebenfalls zusammen im nächsten EOD-Verfahren verrechnet.</del></p> <p><del>— „N“: Auf diesem Positionskonto erfolgt keine Verrechnung.</del></p>
Clearing Currency	<del>CLEARING-WÄHRUNG des CLEARING-MITGLIEDS (EUR oder CHF).</del>
Approved Trade System ID of asset pool (single fund)	<del>Kennung des BETREFFENDEN FONDS/BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS im Anerkannten Trade Source System.</del>
Request type	<p><del>Die folgenden Auftragsarten sind erlaubt: „hinzufügen (add)“ und „löschen (delete)“. Für jede Auftragsart ist ein eigenes technisches Formular (upload sheet) einzureichen.</del></p> <p><del>Zusätzlich ist eine aktualisierte Anlage, die alle BETREFFENDEN FONDS bzw. BETREFFENDE FONDS-SEGMENTE aufführt, einzureichen.</del></p>
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)	<del>Durch anerkannte Anbieter gemäß ISO Standard 17442 vergebener Legal Entity Identifier / Vorläufer Legal Entity Identifier des BETREFFENDEN FONDS.</del>
Jurisdiction (ISO code)	<del>ISO Code der Länderkennung des BETREFFENDEN FONDS.</del>



	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 25

**UNTERSCHRIFTEN**  
**zur Clearing-Vereinbarung**

\_\_\_\_\_  
(Ort)

\_\_\_\_\_  
(Datum)

\_\_\_\_\_  
(als CLEARING-MITGLIED)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
(als ICM-KUNDE)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

**Eurex Clearing Aktiengesellschaft**

(EUREX CLEARING AG)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 26

## 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 ~~einer Kapitalanlagegesellschaft bzw. einer Kapitalverwaltungsgesellschaft 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, ~~einer Kapitalanlagegesellschaft („KAG“) im Sinne des Investmentgesetzes („InvG“) bzw. einer Kapitalverwaltungsgesellschaft („KVG“) im Sinne des Kapitalanlagegesetzbuches („KAGB“):~~

#### **1 Begriffsbestimmungen und Auslegung**

~~Im Sinne dieser VEREINBARUNG ist ein „SONDERVERMÖGEN“ ein von der KAG verwaltetes Sondervermögen im Sinne des § 2 Abs. 2 InvG bzw. ein von der KVG verwaltetes Sondervermögen im Sinne des § 1 Abs. 10 KAGB, einschließlich eines Teilfonds im Sinne des § 34 Abs. 2 InvG bzw. eines Teilsondervermögens im Sinne des § 96 Absatz 2 KAGB.~~

~~Im Sinne dieser VEREINBARUNG ist ein „FONDS-SEGMENT“ eines SONDERVERMÖGENS eine buchhalterisch und abwicklungstechnisch getrennte Zusammenfassung von Vermögenswerten eines SONDERVERMÖGENS und von für Rechnung dieses SONDERVERMÖGENS eingegangenen Verpflichtungen.~~

1.1 Jede Bezugnahme in dieser VEREINBARUNG auf einen „**ICM-KUNDEN**“ oder einen „**REGISTRIERTEN KUNDEN**“ ist als Bezugnahme auf einen bestimmten BETREFFENDEN FONDS bzw. ein bestimmtes BETREFFENDES FONDS-SEGMENT die KAG/KVG jeweils handelnd durch die FONDS-PARTEI für Rechnung eines bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 4 genannten SONDERVERMÖGENS bzw. FONDS-SEGMENTS eines von der KAG/KVG verwalteten SONDERVERMÖGENS als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEN KUNDEN zu verstehen.

1.2 In diesem Abschnitt 4:

(i) wird jede(r) in der Anlage zu diesem Abschnitt 4 genannte Jedesbetreffende FONDS IN VERTRAGSFORM, PARTNERSHIP, UNIT TRUST oder TEILFONDS SONDERVERMÖGEN, für dessen Rechnung die KAG/KVG diese VEREINBARUNG abschließt oder TRANSAKTIONEN tätigt, wird in diesem Abschnitt 4 als das ein „BETREFFENDER FONDS SONDERVERMÖGEN“ bezeichnet.

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 27

~~(ii) 4-3 wird jedes in der Anlage zu diesem Abschnitt 4 genannte betreffende Jedes FONDS-SEGMENT für dessen Rechnung die KAG/KVG diese VEREINBARUNG abschließt oder TRANSAKTIONEN tätigt, wird in diesem Abschnitt 4 als ein das „BETREFFENDES FONDS-SEGMENT“ bezeichnet.~~

~~(iii) ist „FONDS-PARTEI“ der jeweiligen Manager, General Partner, Treuhänder oder FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM, der im Namen und auf Rechnung des BETREFFENDEN FONDS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS handelt.~~

1.3 Bezugnahmen in dieser VEREINBARUNG auf einen UNIT TRUST, der durch eine FONDS-PARTEI eine CLEARING VEREINBARUNG, ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG oder EINBEZOGENE TRANSAKTION „abschließt“, beziehen sich jeweils auf die FONDS-PARTEI als Treuhänder dieses UNIT TRUSTS, der diese CLEARING VEREINBARUNG, ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG oder EINBEZOGENE TRANSAKTION abschließt. Darüber hinaus beziehen sich in diesem Abschnitt 4 Bezugnahmen auf einen UNIT TRUST, der durch eine FONDS-PARTEI „handelt“ auf die FONDS-PARTEI, die als Treuhänder dieses UNIT TRUSTS handelt.

## **2 Einbezogene Transaktionen für bestimmte Arten von FONDS IN VERTRAGSFORM**

Abweichend von Abschnitt 3 dieser VEREINBARUNG können ausschließlich OTC-KREDITDERIVAT-TRANSAKTIONEN gemäß Kapitel VIII Abschnitt 2 und OTC-ZINSDERIVAT-TRANSAKTIONEN gemäß Kapitel VIII Abschnitt 3 in das CLEARING für FONDS IN VERTRAGSFORM in Form eines Sondervermögens im Sinne des deutschen Investmentgesetzes oder des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs oder eines TEILFONDS oder FONDS-SEGMENTS eines solchen einbezogen werden~~einbezogen werden.~~

## **3 Informationspflichten, Abschluss von TRANSAKTIONEN und GRUNDLAGENVEREINBARUNGEN**

3.1 Die FONDS-PARTEI ~~Die KAG/KVG~~ wird der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING-MITGLIED bei Abschluss jeder EINBEZOGENEN TRANSAKTION für Rechnung eines BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS mitteilen, für Rechnung welches BETREFFENDEN ~~SONDERVERMÖGEN~~FONDSS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS ~~die KAG/KVG die~~se EINBEZOGENE TRANSAKTION eingegangen ~~wirde~~geht.

3.2 Zusätzlich zu den Bestimmungen in Unterabschnitt D Ziffer 2.1.2 der INDIVIDUAL-CLEARING-MODELL-BESTIMMUNGEN gilt, dass die betreffende KUNDEN-CLEARING-VEREINBARUNGEN eine gesonderte KUNDEN-CLEARING VEREINBARUNG zwischen dem CLEARING-MITGLIED und ~~der KAG/KVG dem jeweiligen~~handelnd für Rechnung eines bestimmten BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS jeweils handelnd durch die FONDS-PARTEI als ICM-KUNDE darstellt~~ist~~ und dass eine solche gesonderte KUNDEN-CLEARING-VEREINBARUNG zwischen dem CLEARING-MITGLIED und dem jeweilig~~der~~ KAG/KVG handelnd für Rechnung eines bestimmten BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT jeweils handelnd durch die FONDS-PARTEI~~s~~ den Anforderungen eines GEEIGNETEN-KUNDEN-CLEARING-VEREINBARUNGSTYPUS entspricht.

3.3 Die oben in Absatz 3.2 genannten gesonderte ~~Keine solche gesonderte~~ KUNDEN-CLEARING-VEREINBARUNGEN haben darf~~k~~ einen Einfluss auf ein zwischen der Eurex

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 28

Clearing AG, dem CLEARING-MITGLIED und ~~der KAG/KVG für Rechnung eines~~ms anderen ~~SONDERVERMÖGENSBETREFFENDEN FONDS~~ bzw. einesms anderen ~~BETREFFENDEN~~ FONDS-SEGMENTS~~\_begründetes~~an Rechtsverhältnis ~~haben~~.

3.43 Die jeweiligen Positionen und Margin-Sicherheiten aus EINBEZOGENEN TRANSAKTIONEN werden von der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING-MITGLIED für jedens BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGEN bzw. jedes BETREFFENDE FONDS-SEGMENTS, ~~für dessen Rechnung die KAG/KVG handelt~~, gesondert erfasst.

#### 4 **Wiederbegründung von TRANSAKTIONEN**

4.1 ~~Die FONDS-PARTEI Die KAG/KVG~~ kann für jedens BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGEN ~~gesondert separat~~ entscheiden, ob ~~sie für dieses BETREFFENDE SONDERVERMÖGEN~~ eine WAHL DER INTERIM-TEILNAHME bzw. die AUSWAHL DER UNMITTELBAREN WIEDERBEGRÜNDUNG nach Kapitel I Abschnitt 3 Unterabschnitt B Ziffer 5 der CLEARING-BEDINGUNGEN erklärt wird.

4.2 In Bezug auf die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE eines bestimmten FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM, FONDS IN VERTRAGSFORM oder eines TEILFONDS~~einzelnen SONDERVERMÖGENS~~, kann ~~die KAG/KVG die FONDS-PARTEI~~ nur einheitlich für alle diese BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE entscheiden, ob ~~sie~~ eine WAHL DER INTERIM-TEILNAHME bzw. die AUSWAHL DER UNMITTELBAREN WIEDERBEGRÜNDUNG nach Kapitel I Abschnitt 3 Unterabschnitt B Ziffer 5 der CLEARING-BEDINGUNGEN erklärt wird.

#### 5 **Aufrechnung**

Die Aufrechnung von Ansprüchen eines BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS, handelnd durch die FONDS-PARTEI, ICM-KUNDEN mit oder gegen Ansprüche(n) anderer ICM-KUNDEN oder anderen Ansprüchen ist ausgeschlossen.

#### 6 **Kein Wechsel des CLEARING-Modells**

Der durch die FONDS-PARTEI handelnde jeweilige BETREFFENDE FONDS oder das jeweilige BETREFFENDE FONDS-SEGMENT ~~Der ICM-KUNDE~~ kann eine CLEARING-VEREINBARUNG bzw. ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG nur in der diesen CLEARING-BEDINGUNGEN als Anhang 3 oder Anhang 4 beigefügten Form abschließen. Ein Wechsel des CLEARING-MODELLS ist nicht möglich.

#### 7 **Zusicherungen und Verpflichtungserklärungen Bestätigung gegenüber Eurex Clearing AG**

7.1 Das CLEARING-MITGLIED und die FONDS-PARTEI, die für Rechnung des jeweiligen BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS handelt, sichert für jeden BETREFFENDEN FONDS bzw. jedes BETREFFENDE FONDS-SEGMENT jeweils einzeln im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieversprechens gegenüber der Eurex Clearing AG zu, dass:

(i) die FONDS-PARTEI die erforderliche rechtliche Befugnis hat, die MASSGEBLICHE ICM-DOKUMENTATION und jedes weiteres Dokument im Zusammenhang mit der MASSGEBLICHEN ICM-DOKUMENTATION für Rechnung dieses BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS abzuschließen;

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 29

- (ii) dieser BETREFFENDE FONDS bzw. dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT rechtlich existent ist und in Übereinstimmung mit dem geltenden Recht errichtet wurde;
- (iii) dieser BETREFFENDE FONDS bzw. dieses BETREFFENDE FONDS SEGMENT und/oder seine FONDS-PARTEI, sofern erforderlich, der Regulierung in seiner bzw. ihrer entsprechenden Rechtsordnung unterliegt und durch die zuständigen Aufsichtsbehörden in seinem bzw. ihrem Herkunftsstaat beaufsichtigt wird und/oder deren Befugnissen unterliegt;
- (iv) weder der Abschluss noch die Erfüllung der Verpflichtungen aus der MASSGEBLICHEN ICM-DOKUMENTATION und jedem weiteren Dokument im Zusammenhang mit der MASSGEBLICHEN ICM-DOKUMENTATION durch diesen BETREFFENDEN FONDS oder dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT, handelnd durch die betreffende FONDS-PARTEI, den jeweils geltenden Gesetzen oder Verordnungen, insbesondere für diesen BETREFFENDEN FONDS, dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT oder die FONDS-PARTEI geltenden Investmentgesetzen und Verordnungen, Bestimmungen der konstitutiven Dokumente dieses BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS, einer Verfügung oder einem Urteil eines Gerichts oder einer Behörde, an die bzw. an das dieser BETREFFENDE FONDS, dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT oder die FONDS-PARTEI oder einer seiner bzw. ihrer Vermögensgegenstände gebunden ist, oder einem Vertrag oder Instrument, an den bzw. an das dieser BETREFFENDE FONDS, dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT oder die FONDS-PARTEI gebunden ist oder der bzw. das die Vermögenswerte dieses BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS betrifft, widerspricht; und
- (v) die FONDS-PARTEI, soweit dieser BETREFFENDE FONDS ein UNIT TRUST darstellt, in Bezug auf jede Verpflichtung, die sie auf der Grundlage der MASSGEBLICHEN ICM-DOKUMENTATION für Rechnung des BETREFFENDEN FONDS eingeht bzw. eingehen wird, das Recht hat, aus dem Vermögen des BETREFFENDEN FONDS Ausgleich zu erhalten.

7.2 Für jedes BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT sichert die FONDS-PARTEI, die für Rechnung dieses BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS handelt, jeweils im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieversprechens gegenüber der EUREX CLEARING AG zu, dass

- (i) sie die Anleger des Fonds, zu dem dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gehört, über die vertragliche Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN im Zusammenhang mit dem CLEARING und alle möglichen wirtschaftlichen Nachteile des Abschlusses dieser VEREINBARUNG für dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gegenüber einem einheitlichen Abschluss der VEREINBARUNG mit dem Fonds aufgeklärt hat und die Anleger des Fonds zu dem dieses BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gehört, bereit sind, die mit dem Abschluss der VEREINBARUNG mit diesem BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT verbundenen möglichen wirtschaftlichen Risiken und Nachteile zu tragen.
- (ii) soweit einschlägig, der relevante Fondsprospekt eine entsprechende Offenlegung der vertraglichen Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN und aller möglichen wirtschaftlichen Risiken einer solchen vertraglichen Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN wie oben in (i) dargestellt enthält.

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 30

~~Soweit die KAG/KVG für Rechnung eines BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS eines von der KAG/KVG verwalteten SONDERVERMÖGENS als REGISTRIERTEM KUNDEN handelt, sichert sie jeweils im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieversprechens gegenüber der EUREX CLEARING AG zu, dass sie die Anleger des SONDERVERMÖGENS, zu dem die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE gehören, über mögliche wirtschaftliche Nachteile des Abschlusses dieser VEREINBARUNG für ein BETREFFENDES FONDS-SEGMENT gegenüber einem einheitlichen Abschluss der VEREINBARUNG mit dem SONDERVERMÖGEN aufgeklärt hat und die Anleger des SONDERVERMÖGENS, zu dem die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE gehören, bereit sind, die mit dem Abschluss der VEREINBARUNG mit den BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTEN verbundenen möglichen wirtschaftlichen Risiken und Nachteile zu tragen.~~

## 8 Änderungen, Laufzeit und Kündigung

- 8.1 In Abweichung von Abschnitt 1 Ziffer 10 dieser VEREINBARUNG kann die Anlage zu Abschnitt 4 dieser VEREINBARUNG im Falle einer Neuaufnahme, der Umbenennung oder des Ausscheidens eines BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS oder der Verschmelzung von BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGEN bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTEN durch den Austausch der durch alle PARTEIEN gegengezeichneten ergänzten Ausfertigung der Anlage zu Abschnitt 4 dieser VEREINBARUNG geändert werden.
- 8.2 Eine solche Änderungsvereinbarung der Anlage zu Abschnitt 4 dieser VEREINBARUNG infolge der Neuaufnahme eines BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS oder der Verschmelzung durch Neugründung eines BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS begründet den Abschluss einer neuen gesonderten GRUNDLAGENVEREINBARUNG mit ~~der~~ KAG/KVG handelnd für das dem jeweils neu hinzugekommenen durch die FONDS-PARTEI handelnden BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGEN bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT oder im Rahmen der Verschmelzung neugegründeten BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGEN bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT.
- 8.3 Abweichend von Abschnitt 1 Ziffer 9 dieser VEREINBARUNG kann eine Beendigung dieser durch ~~die KAG/KVG~~ die FONDS-PARTEI für Rechnung ~~eines eines~~ BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS bzw. eines BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS geschlossenen VEREINBARUNG gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 13.2.1 i.V.m. Ziffer 13.1.1 der CLEARING BEDINGUNGEN auch durch eine der Eurex Clearing AG und dem CLEARING-MITGLIED durch die FONDS-PARTEI die KAG/KVG mitgeteilte Änderung der Anlage zu Abschnitt 4 dieser VEREINBARUNG, die die Löschung ~~dieseses~~ BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS bzw. ~~des~~ BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS vorsieht, erfolgen.
- 8.4 Jede Bezugnahme in dieser VEREINBARUNG auf die Anlage zu Abschnitt 4 dieser VEREINBARUNG ist eine Bezugnahme auf die betreffende Anlage 4 dieser VEREINBARUNG in der jeweils gültigen Fassung.
- 8.5 In jeden der in dieser Ziffer 78 beschriebenen Fälle gilt, dass zuvor der Eurex Clearing AG eine entsprechende Änderung oder Ersetzung der KUNDEN-CLEARING-VEREINBARUNG, die mit den ICM-CCD-BESTIMMUNGEN vereinbar ist, zu ihrer vollen Zufriedenheit dargelegt wird.

**Anlage zu Abschnitt 4**

Legal Name of the Relevant Fund				
Name of the asset pool (fund)				
<del>Member code of the CM</del>				
<del>Member code of the RC</del>				
Specified Multiplier for calculation Margin Requirement				
<del>Unique reference for the asset pool</del>				
CBF/GS Securities Margin account				
CBF/GS Main account of CM				
CBF Int 6-series Securities Margin account				
CBF Int 6-series Main account of Clearing Member				
<del>Pool ID</del>				
<del>Netting Parameter</del>				
<del>Clearing Currency</del>				
<del>Approved Trade System ID of asset pool (single fund)</del>				
<del>Request type</del>				
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)				
Jurisdiction (ISO code)				

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 32

(Ort)

(Datum)

(als CLEARING-MITGLIED)

Name:

Name:

Funktion:

Funktion:

(~~FONDS-PARTEI KAG/KVG~~ handelnd für Rechnung der in Anlage zu Abschnitt 4 jeweils genannten BETREFFENDEN  
~~SONDERVERMÖGEN-FONDS~~ bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE)

Name:

Name:

Funktion:

Funktion:

### **Eurex Clearing Aktiengesellschaft**

(EUREX CLEARING AG)

Name:

Name:

Funktion:

Funktion:



Referenz	Beschreibung
Legal Name of the Relevant Fund	<p>Rechtliche Bezeichnung des BETREFFENDEN <del>FONDS SONDERVERMÖGENS</del> bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS.</p> <p>Im Falle eines TEILFONDS <del>bzw. TEILSONDERVERMÖGENS</del> ist der <del>FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM</del> <del>FONDS</del>, <del>FONDS IN VERTRAGSFORM</del> oder <del>UNIT TRUST</del> auf den sich der TEILFONDS <del>bzw. das TEILSONDERVERMÖGEN</del> bezieht, mit anzugeben.</p> <p>Im Fall der Angabe eines BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS ist für Zwecke der eindeutigen Zuordnung immer auch die rechtliche Bezeichnung des <del>FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM</del>, <del>FONDS IN VERTRAGSFORM</del> oder <del>TEILFONDS SONDERVERMÖGENS</del> mit anzugeben, zu dem das BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gehört (Format: &lt;Name des <del>SONDERVERMÖGENS</del>Fonds&gt;-&lt;Name des BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS&gt;).</p>
Name of the asset pool (fund)	<del>Name</del> Kontobezeichnung des <del>einzelnen segregierten</del> Kontos des BETREFFENDEN <del>FONDS SONDERVERMÖGENS</del> /BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS (book_name).
<del>Member code of the CM</del>	<del>Eurex Clearing Mitglieds-ID (Eurex Clearing Member ID) des CLEARING-MITGLIEDS.</del>
<del>Member code of the RC</del>	<del>Eurex Clearing Mitglieds-ID (Eurex Clearing Member ID) des FONDS-MANAGERS / KAG bzw. KVG handelnd für Rechnung des BETREFFENDEN SONDERVERMÖGENS / BETREFFENDEN FONDS.</del>
Specified Multiplier for calculation Margin Requirement	Der vereinbarte Multiplikator zur Bestimmung der Höhe der MARGIN-VERPFLICHTUNG sollte größer oder gleich 1,0000 sein.
<del>Unique reference for the asset pool</del>	<del>Mittels dieser eindeutigen 4-stelligen alphanumerischen Kundenreferenz-ID (Client reference ID) werden Wertpapiersicherheiten dem segregierten BETREFFENDEN SONDERVERMÖGEN bzw. segregierten BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT zugeordnet. Die auf Ebene des CLEARING-MITGLIEDS eindeutige Referenz-ID muss bei der Übertragung von Wertpapiersicherheiten in der SWIFT-Nachricht angegeben werden.</del>
CBF/GS Securities Margin account	CBF-Unterkonto des CLEARING-MITGLIEDS nach Kunden segregiert.
CBF/GS Main account of CM	Festgelegtes Konto für Rücklieferung von Margin in Form von WERTPAPIEREN. Das festgelegte Hauptkonto kann bei CBF entweder im Namen des CLEARING-MITGLIEDS oder des Verwahrers des ICM-KUNDEN geführt werden.
CBF Int 6-series Securities Margin account	Wertpapier-Margin-Konto (Creation-Account) des CLEARING-MITGLIEDS nach Kunden segregiert.
CBF Int 6-series Main account of CM	Festgelegtes Konto für Rücklieferung von Margin in Form von WERTPAPIEREN. Das festgelegte Creation Hauptkonto (Creation

Referenz	Beschreibung
	Main Account) kann bei CBF entweder im Namen des CLEARING-MITGLIEDS oder des Verwahrers des ICM-KUNDEN geführt werden.
<del>Pool ID</del>	<del>Feld wird automatisch ausgefüllt. Struktur des Feldes „&lt;Member Code of the RC&gt;X&lt; Member Code of the CM&gt;&lt;Unique reference for the asset pool&gt;“.</del>
<del>Netting Parameter</del>	<del>Netting Parameters – festgelegt pro Positionskonto/segregiertem BETREFFENDEN FONDS/SONDERVERMÖGEN/segregiertem BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT:  <ul style="list-style-type: none"> <li>— „O“ (die Grundeinstellung): Eligible, mit demselben Netting String gekennzeichnete Geschäfte werden zusammen verrechnet. Wird „Y“ für die Verrechnung in EurexOTC Clear GUI eingestellt, werden eligible Geschäfte im nächsten EOD-Verfahren verrechnet.</li> <li>— „Y“: Eligible Geschäfte mit demselben Netting String werden zusammen verrechnet. Eligible Geschäfte ohne Netting String werden ebenfalls zusammen im nächsten EOD-Verfahren verrechnet.</li> <li>— „N“: Auf diesem Positionskonto erfolgt keine Verrechnung.</li> </ul> </del>
<del>Clearing Currency</del>	<del>CLEARING-WÄHRUNG des CLEARING-MITGLIEDS (EUR oder CHF).</del>
<del>Approved Trade System ID of asset pool (single fund)</del>	<del>Kennung des BETREFFENDEN FONDS/SONDERVERMÖGENS/BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS im Anerkannten Trade Source System.</del>
<del>Request type</del>	<del>Die folgenden Auftragsarten sind erlaubt: „hinzufügen (add)“ und „löschen (delete)“. Für jede Auftragsart ist ein eigenes technisches Formular (upload sheet) einzureichen.  Zusätzlich ist eine aktualisierte Anlage, die alle BETREFFENDEN FONDS/SONDERVERMÖGEN bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE aufführt, einzureichen.</del>
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)	Durch anerkannte Anbieter gemäß ISO Standard 17442 vergebener Legal Entity Identifier / Vorläufer Legal Entity Identifier des BETREFFENDEN <u>FONDS/SONDERVERMÖGENS</u> .
Jurisdiction (ISO code)	ISO Code der Länderkennung des BETREFFENDEN <u>FONDS/SONDERVERMÖGENS</u> .

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 35

## **~~Abschnitt 5 Besondere Bestimmungen für das CLEARING von TRANSAKTIONEN mit bestimmten anderen Formen von Investmentfonds ohne Rechtspersönlichkeit oder einem Teilfonds~~**

~~Die nachfolgenden besonderen Bestimmungen gelten für das CLEARING von TRANSAKTIONEN mit einem der folgenden Investmentfonds ohne Rechtspersönlichkeit bzw. einem der unter (vii) genannten Teilfonds bzw. unter (viii) genannten FONDS-SEGMENTE (d.h. eine buchhalterisch und abwicklungstechnisch getrennte Zusammenfassung von Vermögenswerten eines FONDS und von für Rechnung dieses FONDS eingegangenen Verpflichtungen) als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN:~~

- ~~(i) AUT,~~
- ~~(ii) Lux FCP,~~
- ~~(iii) FRANZÖSISCHER FCP,~~
- ~~(iv) UT,~~
- ~~(v) CCF,~~
- ~~(vi) ILP,~~
- ~~(vii) ein Teilfonds einer bzw. eines als Umbrella-Fonds ausgestalteten LUX SICAV oder LUX SICAF, FRANZÖSISCHEN SICAV, LUX FCP, FRANZÖSISCHEN FCP, IC, UT oder CCF („TEILFONDS“), oder~~
- ~~(viii) ein FONDS-SEGMENT einer LUX SICAV, LUX SICAF bzw. eines LUX FCP, einschließlich eines FONDS-SEGMENTS eines TEILFONDS dieser LUX SICAV, LUX SICAF bzw. dieses LUX FCP („FONDS-SEGMENT“).~~

### **~~9 Begriffsbestimmungen~~**

~~Jede Bezugnahme in dieser VEREINBARUNG auf einen „ICM-KUNDEN“ oder einen „REGISTRIERTEN KUNDEN“ ist als Bezugnahme auf~~

- ~~(i) im Falle eines AUT, den betreffenden Fondstreuhänder (*trustee*) (einschließlich eines etwaigen Fondsmanagers (*fund manager*), der für diesen Fondstreuhänder als Vertreter handelt) (der „AUT-FONDSTREUHÄNDER“), handelnd ausschließlich für einen bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten AUT als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
- ~~(ii) im Falle eines LUX FCP, einen bestimmten, in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten LUX FCP, vertreten durch seine Fondsverwaltungsgesellschaft (*société de gestion*) (die „LUX FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“) bzw. durch einen von dieser beauftragten Investment Manager (der „LUX INVESTMENT MANAGER“) als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
- ~~(iii) im Falle eines FRANZÖSISCHEN FCP, einen bestimmten, in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten FRANZÖSISCHEN FCP, vertreten durch seine Fondsverwaltungsgesellschaft (*société de gestion*) (die „FRANZÖSISCHE FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“) bzw. durch einen von diesem beauftragten~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 36

~~Investment Manager (der „FRANZÖSISCHE INVESTMENT MANAGER“ und zusammen mit dem Lux Investment Manager, ein „INVESTMENT MANAGER“), als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~

- ~~(iv) im Falle eines UT, den betreffenden Fondstreuhandler (trustee) (einschließlich eines etwaigen Fondsmanagers (fund manager), der für diesen Fondstreuhandler als Vertreter handelt) (der „UT-Fondstreuhandler“ und zusammen mit einem AUT-FONDSTREUHÄNDER ein „Fondstreuhandler“), handelnd ausschließlich für einen bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten UT als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
- ~~(v) im Falle eines CCF, die betreffende Fondsverwaltungsgesellschaft (die „CCF-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“ und zusammen mit einer Lux FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT und einer FRANZÖSISCHEN FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT eine „VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“), handelnd ausschließlich für einen bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten CCF als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTER KUNDE bzw.~~
- ~~(vi) im Falle einer ILP, der betreffende General Partner (einschließlich eines etwaigen Investment Managers, der für diesen General Partner als Vertreter handelt) (der „General Partner“), handelnd ausschließlich für eine bestimmte in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten ILP als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTER KUNDE, bzw.~~
- ~~(vii) im Falle eines TEILFONDS, jeweils~~
  - ~~(a) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS der betreffenden Lux SICAV bzw. Lux SICAF als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN, bzw.~~
  - ~~(b) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS der betreffenden FRANZÖSISCHEN SICAV, als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
  - ~~(c) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS eines Lux FCP, vertreten durch die Lux FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder den Lux INVESTMENT MANAGER, als REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
  - ~~(d) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS eines FRANZÖSISCHEN FCP, vertreten durch die FRANZÖSISCHE FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder den FRANZÖSISCHEN INVESTMENT MANAGER als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
  - ~~(e) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS eines IC als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~
  - ~~(f) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS eines UT, vertreten durch den FONDSTREUHÄNDER, als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN, bzw.~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 37

~~(g) den bestimmten in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannten TEILFONDS eines CCF, vertreten durch die Verwaltungsgesellschaft, als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~

~~(viii) im Falle eines FONDS-SEGMENTS, jeweils~~

~~(a) das bestimmte in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannte FONDS-SEGMENT einer LUX SICAV oder eines TEILFONDS einer LUX SICAV oder LUX SICAF als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~

~~(b) das bestimmte in der Anlage zu diesem Abschnitt 5 genannte FONDS-SEGMENT eines LUX FCP oder eines TEILFONDS eines LUX FCP als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN,~~

~~zu verstehen:~~

~~—— Jeder bzw. jedes~~

~~(i) AUT, für den der betreffende FONDSTREUHÄNDER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(ii) LUX FCP, für den die betreffende VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder der betreffende INVESTMENT MANAGER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(iii) FRANZÖSISCHE FCP, für das die betreffende VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder der betreffende INVESTMENT MANAGER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(iv) UT, für den der betreffende FONDSTREUHÄNDER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(v) CCF, für den die betreffende VERWALTUNGSGESELLSCHAFT diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(vi) ILP, für den der betreffende GENERAL PARTNER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt, bzw.~~

~~(vii) TEILFONDS, für den die betreffende Lux SICAV, Lux SICAF, FRANZÖSISCHE SICAV, der IC, der FONDSTREUHÄNDER, die VERWALTUNGSGESELLSCHAFT bzw. der INVESTMENT MANAGER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~—— wird in diesem Abschnitt 5 als der „BETREFFENDE FONDS“ bezeichnet.~~

~~4.3 —— Jedes~~

~~(i) FONDS-SEGMENT, für das die betreffende LUX SICAV oder LUX SICAF diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~(ii) FONDS-SEGMENT, für das die betreffende LUX FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder der betreffende LUX INVESTMENT MANAGER diese VEREINBARUNG oder TRANSAKTIONEN abschließt,~~

~~wird in diesem Abschnitt 5 als das „BETREFFENDE FONDS-SEGMENT“ bezeichnet.~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 38

~~1.4 Sofern dieser Abschnitt 5 auf eine VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder einen INVESTMENT MANAGER handelnd für eine bestimmte FRANZÖSISCHE FCP Bezug nimmt, ist eine solche Bezugnahme als eine Bezugnahme auf diese FRANZÖSISCHE FCP als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN zu verstehen. Gleichmaßen, sofern dieser Abschnitt 5 auf eine FRANZÖSISCHE SICAV, VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder einen INVESTMENT MANAGER handelnd für einen bestimmten TEILFOND Bezug nimmt, ist eine solche Bezugnahme als eine Bezugnahme auf diesen TEILFOND als ICM-KUNDEN oder REGISTRIERTEM KUNDEN zu verstehen.~~

#### ~~10 Informationspflichten, Abschluss von TRANSAKTIONEN und GRUNDLAGENVEREINBARUNGEN~~

~~Jeder FONDSTREUHÄNDER, jede VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, jeder INVESTMENT MANAGER, jede Lux SICAV oder Lux SICAF, jede FRANZÖSISCHE SICAV, jeder IC und jeder GENERAL PARTNER wird der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING MITGLIED bei Abschluss jeder EINBEZOGENEN TRANSAKTION mitteilen, für Rechnung welches BETREFFENDEN FONDS und gegebenenfalls BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS als ICM-KUNDEN die EINBEZOGENE TRANSAKTION eingegangen wird.~~

~~Zusätzlich zu den Bestimmungen in Unterabschnitt D Ziffer 2.1.2 der INDIVIDUAL-CLEARING-MODELL-BESTIMMUNGEN gilt, dass die betreffende KUNDEN-CLEARING-VEREINBARUNGEN eine gesonderte KUNDEN-CLEARING VEREINBARUNG zwischen dem CLEARING MITGLIED und dem/der FONDSTREUHÄNDER, VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, INVESTMENT MANAGER, Lux SICAV bzw. Lux SICAF, FRANZÖSISCHEN SICAV, IC oder GENERAL PARTNER jeweils handelnd für Rechnung eines bestimmten BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS als ICM-KUNDE ist und dass eine solche gesonderte KUNDEN-CLEARING-VEREINBARUNG zwischen dem CLEARING MITGLIED und dem/der FONDSTREUHÄNDER, VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, INVESTMENT MANAGER, LUX SICAV bzw. LUX SICAF, FRANZÖSISCHEN SICAV, IC oder GENERAL PARTNER handelnd für Rechnung eines bestimmten BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS den Anforderungen eines GEEIGNETEN KUNDEN-CLEARING-VEREINBARUNGSTYPS entspricht. Keine solche gesonderte KUNDEN-CLEARING-VEREINBARUNG darf einen Einfluss auf ein zwischen der Eurex Clearing AG und dem CLEARING MITGLIED bzw. dem CLEARING MITGLIED und dem/der FONDSTREUHÄNDER, VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, INVESTMENT MANAGER oder LUX SICAV bzw. LUX SICAF, FRANZÖSISCHEN SICAV, IC oder GENERAL PARTNER jeweils handelnd für Rechnung eines anderen BETREFFENDEN FONDS oder eines anderen BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS begründeten Rechtsverhältnis haben.~~

~~Die jeweiligen Positionen und MARGIN SICHERHEITEN aus EINBEZOGENEN TRANSAKTIONEN werden von der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING MITGLIED für jeden BETREFFENDEN FONDS oder jedes BETREFFENDE FONDS-SEGMENT als ICM-KUNDEN, für den der FONDSTREUHÄNDER, die VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, der INVESTMENT MANAGER, die LUX SICAV bzw. LUX SICAF, die FRANZÖSISCHE SICAF, die IC oder der GENERAL PARTNER jeweils handelt, gesondert erfasst.~~

#### ~~11 Wiederbegründung von TRANSAKTIONEN~~

~~Der FONDSTREUHÄNDER, die VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, der INVESTMENT MANAGER, die betreffende LUX SICAV oder LUX SICAF, die FRANZÖSISCHE SICAV, die IC bzw. der~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 39

~~GENERAL PARTNER entscheidet für jeden BETREFFENDEN FONDS als ICM-KUNDEN separat, ob eine WAHL DER INTERIM-TEILNAHME bzw. die AUSWAHL DER UNMITTELBAREN WIEDERBEGRÜNDUNG nach Kapitel I Abschnitt 3 Unterabschnitt B Ziffer 5 der CLEARING-BEDINGUNGEN erklärt wird.~~

~~In Bezug auf die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE eines einzelnen FONDS, kann die Lux FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, der LUX INVESTMENT MANAGER, die Lux SICAV oder Lux SICAF nur für alle BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE zusammen entscheiden, ob eine WAHL DER INTERIM-TEILNAHME bzw. die AUSWAHL DER UNMITTELBAREN WIEDERBEGRÜNDUNG nach Kapitel I Abschnitt 3 Unterabschnitt B Ziffer 5 der CLEARING-BEDINGUNGEN erklärt wird.~~

## ~~12 — Aufrechnung~~

~~Die Aufrechnung von Ansprüchen eines ICM-KUNDEN mit Ansprüchen anderer ICM-KUNDEN oder anderen Ansprüchen ist ausgeschlossen.~~

## ~~13 — Kein Wechsel des CLEARING-Modells~~

~~Der ICM-KUNDE kann eine CLEARING-VEREINBARUNG bzw. ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG nur in der diesen CLEARING-BEDINGUNGEN als Anhang 3 oder Anhang 4 beigefügten Form abschließen. Ein Wechsel des CLEARING-Modells ist nicht möglich.~~

## ~~14 — Bestätigung gegenüber der Eurex Clearing AG~~

~~6.1 — Soweit die LUX SICAV / LUX SICAF oder die bestimmte VERWALTUNGSGESELLSCHAFT bzw. der bestimmte INVESTMENT MANAGER eines LUX FCP für Rechnung eines BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS einer LUX SICAV / LUX SICAF bzw. eines LUX FCP als ICM-KUNDEN handelt, sichert sie/er jeweils im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieversprechens gegenüber der Eurex Clearing AG zu, dass sie/er die Anleger der LUX SICAV / LUX SICAF oder des LUX FCP zu der/dem die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE gehören, über die vertragliche Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN im Zusammenhang mit dem Clearing und alle mögliche wirtschaftliche Nachteile des Abschlusses dieser VEREINBARUNG für ein BETREFFENDES FONDS-SEGMENT gegenüber einem einheitlichen Abschluss der VEREINBARUNG mit der LUX SICAV / LUX SICAF bzw. dem LUX FCP aufgeklärt hat und die Anleger der LUX SICAV / LUX SICAF, LUX FCP bzw. eines TEILFONDS hiervon zu der/dem die BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE gehören, bereit sind, die mit dem Abschluss der Vereinbarung mit den BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTEN verbundenen möglichen wirtschaftlichen Risiken und Nachteilen zu tragen.~~

~~6.2 — Die LUX SICAV / LUX SICAF oder die bestimmte VERWALTUNGSGESELLSCHAFT bzw. der bestimmte INVESTMENT MANAGER eines LUX FCP sichert ferner jeweils im Wege eines selbständigen, verschuldensunabhängigen Garantieversprechens gegenüber der Eurex Clearing AG zu, dass der von den zuständigen Aufsichtsbehörden gebilligte relevante Fondsprospekt eine entsprechende Offenlegung der vertraglichen Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN im Zusammenhang mit dem CLEARING und aller möglichen wirtschaftlichen Risiken einer solchen vertraglichen Segregation zwischen FONDS-SEGMENTEN wie in 6.1 oben dargestellt enthält.~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 40

## **15 ~~Änderungen, Laufzeit und Kündigung~~**

~~In Abweichung von Abschnitt 1 Ziffer 10 dieser VEREINBARUNG kann die Anlage zu Abschnitt 5 dieser VEREINBARUNG im Falle einer Neuaufnahme, der Umbenennung oder des Ausscheidens eines BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS oder der Verschmelzung BETREFFENDER FONDS oder BETREFFENDER FONDS-SEGMENTE durch den Austausch der durch alle PARTEIEN gegengezeichneten ergänzten Ausfertigung der Anlage zu Abschnitt 5 dieser VEREINBARUNG geändert werden.~~

~~Eine solche Änderungsvereinbarung der Anlage zu Abschnitt 5 dieser VEREINBARUNG infolge der Neuaufnahme eines BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS oder der Verschmelzung durch Neugründung eines BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS begründet den Abschluss einer neuen gesonderten GRUNDLAGENVEREINBARUNG mit dem FONDSTREUHÄNDER, der VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, dem INVESTMENT MANAGER, der LUX SICAV oder LUX SICAF, der FRANZÖSISCHEN SICAV, der IC bzw. dem GENERAL PARTNER, jeweils handelnd für den/das jeweils neu hinzugekommene(n) BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDE FONDS-SEGMENT als ICM-KUNDEN oder im Rahmen der Verschmelzung neugegründete(n) BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDE FONDS-SEGMENT als ICM-KUNDEN.~~

~~Abweichend von Abschnitt 1 Ziffer 9 dieser VEREINBARUNG kann eine Beendigung dieser für einen BETREFFENDEN FONDS oder ein BETREFFENDES FONDS-SEGMENT geschlossenen VEREINBARUNG gemäß Kapitel I Abschnitt 1 Ziffer 13.2.1 i.V.m. Ziffer 13.1.1 der CLEARING BEDINGUNGEN auch durch eine der EUREX CLEARING AG und dem CLEARING-MITGLIED durch den FONDSTREUHÄNDER, die VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, den INVESTMENT MANAGER, die betreffende LUX SICAV oder LUX SICAF, FRANZÖSISCHE SICAV, der IC bzw. dem GENERAL PARTNER mitgeteilte Änderung der Anlage zu Abschnitt 5 dieser VEREINBARUNG, die die Löschung des BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS vorsieht, erfolgen.~~

~~Jede Bezugnahme in dieser VEREINBARUNG auf die Anlage zu Abschnitt 5 dieser VEREINBARUNG ist eine Bezugnahme auf die betreffende Anlage 5 dieser VEREINBARUNG in der jeweils gültigen Fassung.~~

~~In jeden der in dieser Ziffer 7 beschriebenen Fälle gilt, dass zuvor der Eurex Clearing AG eine entsprechende Änderung oder Ersetzung der KUNDEN-CLEARING-VEREINBARUNG, die mit den ICM-CCD-BESTIMMUNGEN vereinbar ist, zu ihrer vollen Zufriedenheit dargelegt wird.~~



**Anlage zu Abschnitt 5**

Legal Name of the Relevant Fund				
Name of the asset pool (fund)				
Member code of the CM				
Member code of the RC				
Specified Multiplier for calculation Margin Requirement				
Unique reference for the asset pool				
CBF/GS Securities Margin account				
CBF/GS Main account of CM				
CBF Int 6-series Securities Margin account				
CBF Int 6-series Main account of CM				
Pool ID				
Netting Parameter				
Clearing Currency				
Approved Trade System ID of asset pool (single fund)				
Request type				
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)				
Jurisdiction (ISO code)				

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 42

---

(Ort)

---

(Datum)

---

(als CLEARING-MITGLIED)

---

Name:

---

Name:

---

Funktion:

---

Funktion:

---

{{FONDSTREUHÄNDER/VERWALTUNGSGESELLSCHAFT/INVESTMENT MANAGER/LUX-SICAV/LUX-SICAF/FRANZÖSISCHE SICAF/IC/GENERAL PARTNER} jeweils handelnd für die in Anlage zu Abschnitt 5 jeweils genannten BETREFFENDEN FONDS [-bzw.- BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE]-als-ICM-KUNDEN)

---

Name:

---

Name:

---

Funktion:

---

Funktion:

---

### **Eurex Clearing Aktiengesellschaft**

(EUREX-CLEARING-AG)

---

Name:

---

Name:

---

Funktion:

---

Funktion:

Referenz	Beschreibung
Legal Name of the Relevant Fund	Rechtliche Bezeichnung des BETREFFENDEN FONDS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS. Im Falle eines TEILFONDS ist der UMBRELLA-FONDS, dem der TEILFONDS zugehört, mit anzugeben. Im Fall der Angabe eines BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS ist für Zwecke der eindeutigen Zuordnung immer auch die rechtliche Bezeichnung des FONDS mit anzugeben, zu dem das BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gehört (Format: <Name des FONDS><Name des BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS>).
Name of the asset pool (fund)	Name des einzelnen BETREFFENDEN FONDS/BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS (book_name).
Member code of the CM	Eurex Clearing Mitglieds-ID (Eurex Clearing Member ID) des CLEARING-MITGLIEDS.
Member code of the Registered Customer	Eurex Clearing Mitglieds-ID (Eurex Clearing Member ID) des betreffenden FONDSTREUHÄNDERS, der betreffenden VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, des betreffenden INVESTMENT MANAGERS, der betreffenden LUX SICAV/LUX SICAF, FRANZÖSISCHEN SICAV, der betreffenden IC bzw. des betreffenden GENERAL PARTNERS handelnd auf Rechnung des BETREFFENDEN FONDS oder BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS.
Specified Multiplier for calculation Margin Requirement	Der vereinbarte Multiplikator zur Bestimmung der Höhe der MARGIN-VERPFLICHTUNG sollte größer oder gleich 1,0000 sein.
Unique reference for the asset pool	Mittels dieser eindeutigen 4-stelligen alphanumerischen Kundenreferenz-ID (Client reference ID) werden Wertpapiersicherheiten dem segregierten BETREFFENDEN FONDS-zugeordnet. Die auf Ebene des CLEARING-MITGLIEDS eindeutige Referenz-ID muss bei der Übertragung von Wertpapiersicherheiten in der SWIFT-Nachricht angegeben werden.
CBF/GS Securities Margin account	CBF-Unterkonto des CLEARING-MITGLIEDS nach Kunden segregiert.
CBF/GS Main account of Clearing Member	Festgelegtes Konto für Rücklieferung von Margin in Form von WERTPAPIEREN. Das festgelegte Hauptkonto kann bei CBF entweder im Namen des CLEARING-MITGLIEDS oder des Verwahrers des ICM-KUNDEN geführt werden.
CBF Int 6-series Securities Margin account	Wertpapier-Margin-Konto (Creation Account) des CLEARING-MITGLIEDS nach Kunden segregiert. (z. B. 67955).
CBF Int 6-series Main account of CM	Festgelegtes Konto für Rücklieferung von Margin in Form von WERTPAPIEREN. Das festgelegte Creation Hauptkonto (Creation Main Account) bei CBF kann entweder im Namen des CLEARING-MITGLIED oder des Verwahrers des ICM-KUNDEN geführt werden.

Referenz	Beschreibung
Pool ID	<del>Feld wird automatisch ausgefüllt. Struktur des Feldes „&lt;Member Code of the RC&gt;X&lt; Member Code of the CM&gt;&lt;Unique reference for the asset pool&gt;„</del>
Netting Parameter	<p><del>Netting Parameters — festgelegt pro Positionskonto/segregiertem BETREFFENDEN FONDS/segregiertem BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT:</del></p> <p><del>—— „O“ (die Grundeinstellung): Eligible, mit demselben Netting String gekennzeichnete Geschäfte werden zusammen verrechnet. Wird „Y“ für die Verrechnung in EurexOTC Clear GUI eingestellt, werden eligible Geschäfte im nächsten EOD-Verfahren verrechnet.</del></p> <p><del>—— „Y“: Eligible Geschäfte mit demselben Netting String werden zusammen verrechnet. Eligible Geschäfte ohne Netting String werden ebenfalls zusammen im nächsten EOD-Verfahren verrechnet.</del></p> <p><del>—— „N“: Auf diesem Positionskonto erfolgt keine Verrechnung.</del></p>
Clearing Currency	<del>CLEARING-WÄHRUNG des CLEARING-MITGLIEDS (EUR oder CHF).</del>
Approved Trade System ID of asset pool (single fund)	<del>Kennung des BETREFFENDEN FONDS/BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS im Anerkannten Trade Source System.</del>
Request type	<p><del>Die folgenden Auftragsarten sind erlaubt: „hinzufügen (add)“ und „löschen (delete)“. Für jede Auftragsart ist ein eigenes technisches Formular (upload sheet) einzureichen.</del></p> <p><del>Zusätzlich ist eine aktualisierte Anlage, die alle BETREFFENDEN FONDS bzw. BETREFFENDE FONDS-SEGMENTE aufführt, einzureichen.</del></p>
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)	<del>Durch anerkannte Anbieter gemäß ISO Standard 17442 vergebener Legal Entity Identifier / Vorläufer Legal Entity Identifier des BETREFFENDEN FONDS</del>
Jurisdiction (ISO code)	<del>ISO Code der Länderkennung des BETREFFENDEN FONDS.</del>

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 45

**UNTERSCHRIFTEN**  
**zur ICM-Teilnahmevereinbarung**

\_\_\_\_\_  
(Ort)

\_\_\_\_\_  
(Datum)

\_\_\_\_\_  
(als CLEARING-MITGLIED)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
(als ICM-KUNDE)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

**Eurex Clearing Aktiengesellschaft**

(EUREX CLEARING AG)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 46

## Anhang 5 zu den Clearing-Bedingungen: Übertragungsvertrag für einen Interim-Teilnehmer an ein Clearing-Mitglied

[...]

### 1 Definitionen

[...]

1.1 Wird diese Vereinbarung mit einer ~~FONDS-PARTEI~~ ~~KAG im Sinne des Investmentgesetzes („InvG“)~~ bzw. einer KVG im Sinne des Kapitalanlagegesetzbuches („KAGB“), handelnd für Rechnung eines oder mehrere FONDS IN VERTRAGSFORM, eine PARTNERSHIP, eines UNIT TRUST, eines TEILFONDS oder für FONDS-SEGMENTE ~~SONDERVERMÖGEN bzw. ein oder mehrere FONDS-SEGMENTE,~~ jeweils im Sinne des Abschnitts 4 der ~~CLEARING-VEREINBARUNG oder ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG,~~ abgeschlossen, (i) so gilt jede Bezugnahme in dieser VEREINBARUNG auf den „REGISTRIERTEN KUNDEN“ als Bezugnahme auf die KAG/KVG jeweils handelnd für Rechnung eines bestimmten einen bestimmten in der Anlage zu diesem ~~Anhang 5~~ VERTRAG genannten FONDS IN VERTRAGSFORM, PARTNERSHIP, UNIT TRUSTS, TEILFONDS oder FONDS-SEGMENTS jeweils handelnd durch die FONDS-PARTEI ~~SONDERVERMÖGENS bzw. FONDS-SEGMENTS;~~ (ii) jede(r) ~~s~~ FONDS IN VERTRAGSFORM, PARTNERSHIP, UNIT TRUST, TEILFONDS oder jedes FONDS-SEGMENT ~~SONDERVERMÖGEN bzw. FONDS-SEGMENTS,~~ für dessen Rechnung die KAG/KVG die FONDS-PARTEI diesen ~~VEREINBARUNG-VERTRAG~~ abschließt, wird in diesem ~~Anhang 5~~ VERTRAG als ~~das-der~~ „**BETREFFENDE FONDS**“ ~~SONDERVERMÖGEN~~“ bzw. das „**BETREFFENDE FONDS-SEGMENT**“ bezeichnet.

1.2 In dieser Vereinbarung meint „**FONDS-PARTEI**“ den jeweiligen Manager, General Partner, Treuhänder oder FONDS IN GESELLSCHAFTSFORM, der für Rechnung des jeweiligen BETREFFENDEN FONDS bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS handelt.

1.3 Bezugnahmen in dieser VEREINBARUNG auf einen UNIT TRUST, der durch eine FONDS-PARTEI eine CLEARING VEREINBARUNG, ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG, RELEVANTE DIREKT EINBEZOGENE TRANSAKTION, KORRESPONDIERENDE EINBEZOGENE TRANSAKTION oder korrespondierende KUNDEN-CLEARING-TRANSAKTION „abschließt“, beziehen sich jeweils auf die FONDS-PARTEI als Treuhänder dieses UNIT TRUSTS, der diese CLEARING VEREINBARUNG, ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG, RELEVANTE DIREKT EINBEZOGENE TRANSAKTION, KORRESPONDIERENDE EINBEZOGENE TRANSAKTION oder korrespondierende KUNDEN-CLEARING-TRANSAKTION „abschließt“. Darüber hinaus beziehen sich in diesem Abschnitt 4 Bezugnahmen auf einen UNIT TRUST, der durch eine FONDS-PARTEI „handelt“ auf die FONDS-PARTEI, die als Treuhänder dieses UNIT TRUSTS handelt.

~~Wird dieser VERTRAG mit~~

~~(a) einem Fondstreuhänder (trustee) (einschließlich eines etwaigen Fondsmanagers (fund manager), der für diesen Fondstreuhänder als Vertreter handelt) (der „AUT-~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 47

~~FONDSTREUHÄNDER“), handelnd für einen oder mehrere AUT im Sinne des Abschnitts 5 der CLEARING-VEREINBARUNG bzw. der ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG, geschlossen, so gilt jede Bezugnahme in diesem VERTRAG auf den „REGISTRIERTEN KUNDEN“ als Bezugnahme auf den AUT-FONDSTREUHÄNDER handelnd für einen bestimmten in der Anlage zu diesem VERTRAG genannten AUT als REGISTRIERTEM KUNDEN;~~

~~(b) einer Luxemburger Fondsverwaltungsgesellschaft (*société de gestion*) (die „LUX FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“) bzw. durch einen von dieser beauftragten Investment Manager (der „LUX INVESTMENT MANAGER“), handelnd für einen oder mehrere LUX FCP im Sinne des Abschnitts 5 der CLEARING-VEREINBARUNG bzw. der ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG geschlossen, so gilt jede Bezugnahme in diesem VERTRAG auf den „REGISTRIERTEN KUNDEN“ als Bezugnahme auf die LUX FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT bzw. den LUX INVESTMENT MANAGER, handelnd für einen bestimmten in der Anlage zu diesem VERTRAG genannten LUX FCP als REGISTRIERTEM KUNDEN;~~

~~(c) einer französischen Fondsverwaltungsgesellschaft (*société de gestion*) (die „FRANZÖSISCHE FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“) bzw. durch einen von dieser beauftragten Investment Manager (der „FRANZÖSISCHE INVESTMENT MANAGER“), handelnd für einen oder mehrere FRANZÖSISCHE FCP im Sinne des Abschnitts 5 der CLEARING-VEREINBARUNG bzw. der ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG geschlossen, so gilt jede Bezugnahme in diesem VERTRAG auf den „REGISTRIERTEN KUNDEN“ als Bezugnahme auf die FRANZÖSISCHE FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT bzw. den FRANZÖSISCHEN INVESTMENT MANAGER, handelnd für einen bestimmten in der Anlage zu diesem VERTRAG genannten FRANZÖSISCHEN FCP als REGISTRIERTEM KUNDEN;~~

~~(d) einem Fondstreuhandler (trustee) (einschließlich eines etwaigen Fondsmanagers (*fund manager*), der für diesen Fondstreuhandler als Vertreter handelt) (der „UT-FONDSTREUHÄNDER“ und zusammen mit einem AUT-FONDSTREUHÄNDER ein „FONDSTREUHÄNDER“), handelnd für einen oder mehrere UT im Sinne des Abschnitts 5 der CLEARING-VEREINBARUNG bzw. der ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG, geschlossen, so gilt jede Bezugnahme in diesem VERTRAG auf den „REGISTRIERTEN KUNDEN“ als Bezugnahme auf den UT-FONDSTREUHÄNDER handelnd für einen bestimmten in der Anlage zu diesem VERTRAG genannten UT als REGISTRIERTEM KUNDEN;~~

~~(e) einer Fondsverwaltungsgesellschaft (die „CCF-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“ und zusammen mit einer Lux FCP-Verwaltungsgesellschaft und einer FRANZÖSISCHEN FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT eine „VERWALTUNGSGESELLSCHAFT“), handelnd für einen oder mehrere CCF im Sinne des Abschnitts 5 der CLEARING-VEREINBARUNG bzw. der ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG geschlossen, so gilt jede Bezugnahme in diesem VERTRAG auf den „REGISTRIERTEN KUNDEN“ als Bezugnahme auf die CCF-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT handelnd für einen bestimmten in der Anlage zu diesem VERTRAG genannten CCF als REGISTRIERTEM KUNDEN;~~

~~(f) einem General Partner (einschließlich eines etwaigen Investment Managers, der für diesen General Partner als Vertreter handelt) (der „GENERAL PARTNER“), handelnd für eine oder mehrere ILP im Sinne des Abschnitts 5 der CLEARING-VEREINBARUNG bzw. der ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG geschlossen, so gilt jede Bezugnahme in~~

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 48

~~diesem VERTRAG auf den „REGISTRIERTEN KUNDEN“ als Bezugnahme auf den General Partner handelnd für Rechnung einer bestimmten in der Anlage zu diesem VERTRAG genannten ILP als REGISTRIERTEM KUNDEN;~~

~~(g) einer LUX SICAV, LUX SICAF, FRANZÖSISCHEN SICAV, IC, VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder einem FONDSSTREUHÄNDER, jeweils handelnd für einen oder mehrere TEILFONDS im Sinne des Abschnitts 5 der CLEARING-VEREINBARUNG bzw. der ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG, geschlossen, so gilt jede Bezugnahme in diesem VERTRAG auf den „REGISTRIERTEN KUNDEN“ als Bezugnahme auf die betreffende Lux SICAV, Lux SICAF, FRANZÖSISCHEN SICAV, IC, VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder den betreffenden FONDSSTREUHÄNDER, handelnd für einen bestimmten in der Anlage zu diesem VERTRAG genannten TEILFONDS als REGISTRIERTEM KUNDEN.~~

~~(h) einer LUX SICAV, LUX SICAF, LUX FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder einem LUX INVESTMENT MANAGER, jeweils handelnd für ein oder mehrere FONDS-SEGMENT(E) im Sinne des Abschnitts 5 der CLEARING-VEREINBARUNG bzw. der ICM-TEILNAHMEVEREINBARUNG, geschlossen, so gilt jede Bezugnahme in diesem VERTRAG auf den „REGISTRIERTEN KUNDEN“ als Bezugnahme auf die/den betreffende(n) Lux SICAV, Lux SICAF, LUX FCP-VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder LUX INVESTMENT MANAGER, handelnd für ein bestimmtes in der Anlage zu diesem VERTRAG genanntes FONDS-SEGMENT als REGISTRIERTEM KUNDEN.~~

~~Jeder AUT, Lux FCP, FRANZÖSISCHE FCP, UT, CCF, jede ILP und jeder TEILFONDS, für den dieser VERTRAG abgeschlossen wird, wird in diesem VERTRAG als der „BETREFFENDE FONDS“ bezeichnet und jedes FONDS-SEGMENT einer LUX SICAV, LUX SICAF oder LUX FCP für das dieser VERTRAG abgeschlossen wird, wird in diesem VERTRAG als das „BETREFFENDE FONDS-SEGMENT“ bezeichnet.~~

~~Sofern dieser VERTRAG auf eine VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder einen INVESTMENT MANAGER handelnd für eine bestimmte FRANZÖSISCHE FCP Bezug nimmt, ist eine solche Bezugnahme als eine Bezugnahme auf diese FRANZÖSISCHE FCP als REGISTRIERTEM KUNDEN zu verstehen. Gleichmaßen, sofern dieser VERTRAG auf eine FRANZÖSISCHE SICAV, VERWALTUNGSGESELLSCHAFT oder einen INVESTMENT MANAGER handelnd für einen bestimmten TEILFOND Bezug nimmt, ist eine solche Bezugnahme als eine Bezugnahme auf diesen TEILFOND als REGISTRIERTEM KUNDEN zu verstehen~~

1.2 Zur Klarstellung: dieser VERTRAG gilt für sämtliche REGISTRIERTE KUNDEN, die aus der Anlage zu diesem VERTRAG ersichtlich sind.

[...]



**Anlage**

Legal Name of the Relevant Fund				
Name of the asset pool (fund)				
<del>Member code of the CM</del>				
<del>Member code of the RC</del>				
Specified Multiplier for calculation Margin Requirement				
<del>Unique reference for the asset pool</del>				
CBF/GS Securities Margin account				
CBF/GS Main account of CM				
CBF Int 6-series Securities Margin account				
CBF Int 6-series Main account of CM				
<del>Pool ID</del>				
<del>Netting Parameter</del>				
<del>Clearing Currency</del>				
<del>Approved Trade System ID of asset pool (single fund)</del>				
<del>Request type</del>				
Legal Entity Identifier (LEI/preLEI)				
Jurisdiction (ISO code)				

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 50

\_\_\_\_\_  
(Ort) \_\_\_\_\_ (Datum)

\_\_\_\_\_  
(als CLEARING-MITGLIED)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
~~([KAG/KVG-FONDS-PARTEI] handelnd für Rechnung der in der Anlage zu diesem Vertrag jeweils genannten BETREFFENDEN SONDERVERMÖGEN-FONDS [bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE] als REGISTRIERTEM KUNDEN) [[FONDS-TREUHÄNDER/VERWALTUNGSGESELLSCHAFT/INVESTMENT-MANAGER/LUX-SICAV/LUX-SICAF/FRANZÖSISCHE SICAVIC/General Partner] jeweils handelnd für die in der Anlage zu diesem Vertrag jeweils genannten BETREFFENDEN FONDS [bzw. BETREFFENDEN FOND-SEGMENTE] als REGISTRIERTEM KUNDEN)~~

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

### **Eurex Clearing Aktiengesellschaft**

\_\_\_\_\_  
(EUREX CLEARING AG)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

Referenz	Beschreibung
Legal Name of the Relevant Fund	<p>Rechtliche Bezeichnung des BETREFFENDEN <u>FONDS SONDERVERMÖGENS</u> bzw. BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS <del>bzw. des BETREFFENDEN FONDS.</del></p> <p>Im Falle eines TEILFONDS <del>bzw. TEILSONDERVERMÖGENS</del>, ist der <del>1</del> <u>FONDS IN VERTRAGSFORM, die PARTNERSHIP oder der UNIT TRUST FONDS</u> auf den sich der TEILFONDS <del>bzw. das</del> <u>TEILSONDERVERMÖGEN</u> bezieht, mit anzugeben.</p> <p>Im Fall der Angabe eines BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS ist für Zwecke der eindeutigen Zuordnung immer auch die rechtliche Bezeichnung des <u>FONDS IN VERTRAGSFORM, der PARTNERSHIP, des UNIT TRUSTS oder TEILFONDS SONDERVERMÖGENS</u> mit anzugeben, zu dem das BETREFFENDE FONDS-SEGMENT gehört (Format: &lt;Name des <u>SONDERVERMÖGENS/Fonds</u>&gt;-&lt;Name des BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS&gt;).</p>
Name of the asset pool (fund)	<u>Kontobezeichnung des Kontos Name</u> des <u>einzelnen segregierten</u> BETREFFENDEN <u>FONDS SONDERVERMÖGENS</u> /BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS <del>/BETREFFENDEN FONDS-</del> (book_name).
<del>Member code of the CM</del>	<del>Eurex Clearing Mitglieds-ID (Eurex Clearing Member ID) des CLEARING-MITGLIEDS.</del>
<del>Member code of the RC</del>	<del>Eurex Clearing Mitglieds-ID (Eurex Clearing Member ID) des FONDS-MANAGERS / KAG bzw. KVG, des betreffenden FONDSTREUHÄNDERS, der betreffenden VERWALTUNGSGESELLSCHAFT, des betreffenden INVESTMENT MANAGERS, der betreffenden Lux SICAV/Lux SICAF oder FRANZÖSISCHEN SICAV, der betreffenden IC bzw. des betreffenden General Partners handelnd für auf Rechnung des BETREFFENDEN FONDS SONDERVERMÖGENS bzw. segregiertem BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS bzw. BETREFFENDEN FONDS als REGISTRIERTEM KUNDEN.</del>
Specified Multiplier for calculation Margin Requirement	Der vereinbarte Multiplikator zur Bestimmung der Höhe der MARGIN-VERPFLICHTUNG sollte größer oder gleich 1,0000 sein.
<del>Unique reference for the asset pool</del>	<del>Mittels dieser eindeutigen 4-stelligen alphanumerischen Kundenreferenz-ID (Client reference ID) werden Wertpapiersicherheiten dem segregierten BETREFFENDEN SONDERVERMÖGENS bzw. segregiertem BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT bzw. BETREFFENDEN FONDS zugeordnet. Die auf Ebene des CLEARING-MITGLIEDS eindeutige Referenz-ID muss bei der Übertragung von Wertpapiersicherheiten in der SWIFT-Nachricht angegeben werden.</del>
CBF/GS Securities Margin	CBF-Unterkonto des CLEARING-MITGLIEDS nach Kunden

Referenz	Beschreibung
account	segregiert.
CBF/GS Main account of CM	Festgelegtes Konto für Rücklieferung von Margin in Form von WERTPAPIEREN. Das festgelegte Hauptkonto bei CBF kann entweder im Namen des CLEARING-MITGLIEDS oder des Verwahrers des <del>REGISTRIERTEN ICM</del> -KUNDEN geführt werden.
CBF Int 6-series Securities Margin account	Wertpapier-Margin-Konto ( <i>Creation-Account</i> ) des CLEARING-MITGLIEDS nach Kunden segregiert.
CBF Int 6-series Main account of CM	Festgelegtes Konto für Rücklieferung von Margin in Form von WERTPAPIEREN. Das festgelegte Creation Hauptkonto (Creation Main Account) kann bei CBF entweder im Namen des CLEARING-MITGLIEDS oder des Verwahrers des <del>REGISTRIERTEN ICM</del> -KUNDEN geführt werden.
<del>Pool ID</del>	<del>Feld wird automatisch ausgefüllt. Struktur des Feldes „&lt;Member Code of the RC&gt;X&lt; &lt;Member Code of the CM&gt; &lt;Unique reference for the asset pool&gt;“.</del>
<del>Netting Parameter</del>	<del>Netting Parameters — festgelegt pro Positionskonto/segregiertem BETREFFENDEN SONDERVERMÖGENS/BETREFFENDEN FONDS/segregiertem/ BETREFFENDEN FONDS-SEGMENT:  — „O“: (die Grundeinstellung): Eligible, mit demselben Netting String gekennzeichnete Geschäfte werden zusammen verrechnet. Wird „Y“ für die Verrechnung in EurexOTC Clear GUI eingestellt, werden eligible Geschäfte im nächsten EOD-Verfahren verrechnet.  — „Y“: Eligible Geschäfte mit demselben Netting String werden zusammen verrechnet. Eligible Geschäfte ohne Netting String werden ebenfalls zusammen im nächsten EOD-Verfahren verrechnet.  — „N“: Auf diesem Positionskonto erfolgt keine Verrechnung.</del>
<del>Clearing Currency</del>	<del>CLEARING-WÄHRUNG des CLEARING-MITGLIEDS (EUR oder CHF).</del>
<del>Approved Trade System ID of asset pool (single fund)</del>	<del>Kennung des BETREFFENDEN SONDERVERMÖGENS, des BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTS bzw. des BETREFFENDEN FONDS im Anerkannten Trade Source System.</del>
<del>Request type</del>	<del>Die folgenden Auftragsarten sind erlaubt: „hinzufügen (add)“ und „löschen (delete)“. Für jede Auftragsart ist ein eigenes technisches Formular (upload sheet) einzureichen.  Zusätzlich ist eine aktualisierte Anlage, die alle BETREFFENDEN SONDERVERMÖGEN bzw. für das BETREFFENDEN FONDS-SEGMENTE bzw. für den BETREFFENDEN FONDS aufführt, einzureichen.</del>
Legal Entity Identifier	Durch anerkannte Anbieter gemäß ISO Standard 17442 vergebener Legal Entity Identifier / Vorläufer Legal Entity Identifier

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 53

Referenz	Beschreibung
(LEI/preLEI)	<del>des BETREFFENDEN SONDERVERMÖGENS bzw.</del> des BETREFFENDEN FONDS
Jurisdiction (ISO code)	ISO Code der Länderkennung <del>des BETREFFENDEN SONDERVERMÖGENS bzw.</del> des <del>BETREFFENDEN</del> FONDS

	Eurex04
Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG	Stand 05.06.2014
	Seite 54

**UNTERSCHRIFTEN  
zum Übertragungsvertrag**

\_\_\_\_\_  
(Ort)

\_\_\_\_\_  
(Datum)

\_\_\_\_\_  
(als NEUES CLEARING-MITGLIED)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
(als NICHT-CLEARING-MITGLIED/REGISTRIERTER KUNDE)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

**Eurex Clearing Aktiengesellschaft**

\_\_\_\_\_  
(EUREX CLEARING AG)

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Name:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\_\_\_\_\_  
Funktion:

\*\*\*\*\*