

Annahmen:

ISIN: AT0000743059 OMV

Geschäft über 1.000 Stück zu Kurs 20,39

Verkäufer: Bank A

Käufer: Bank B

Geschäftstag 30.3.2009

Kassatag 2.4.2009

2.4.2009 (S) Mangels Bestand auf dem Depot der Bank A kann der Saldo weder im 1. noch im 2. Kassatagslauf vom 2.4.2009 beliefert werden

=> es liegt noch kein Lieferverzug vor, d.h. es werden noch keine Strafzinsen berechnet

=> Bank A kann die CCP.A mit der Durchführung eines Deckungskaufes beauftragen

3. - 6.4.2009 (S+1 bis S+2) Mangels Bestand auf dem Depot der Bank A kann der Saldo vom Basiskassatag 2.4.2009 noch immer nicht beliefert werden

=> Lieferverzug liegt vor, d.h. Berechnung von Strafzinsen im Zuge des 2. Kassatagslaufes (**0,3%** pro Tag - mind. EUR 250,00)

=> Bank A kann die CCP.A mit der Durchführung eines Deckungskaufes beauftragen

7.4.2009 (S+3) Mangels Bestand auf dem Depot der Bank A kann der Saldo vom Basiskassatag 2.4.2009 noch immer nicht beliefert werden

=> Lieferverzug liegt vor, d.h. Berechnung von Strafzinsen im Zuge des 2. Kassatagslaufes (**0,3%** pro Tag - mind. EUR 250,00)

=> Die CCP.A versucht nach Abschluß des 2. Kassatagslaufes einen automatischen Deckungskauf durchzuführen

ab 8.4.2009 (S+4) Der Versuch eines automatischen Deckungskaufes durch die CCP.A war nicht erfolgreich

Variante 1): => Aussonderung der offenen Position aus SICS im Zuge des 2. Kassatagslaufes

=> Verrechnung von Verzugszinsen zu Lasten von Bank A und zu Gunsten von Bank B (betroffener Übernehmer)

Variante 2): => In Ausnahmefällen kann die offene Position (als Folge des Nettings offener Positionen)

teilweise oder zur Gänze weiterhin im System bleiben

=> Lieferverzug liegt vor, d.h. Berechnung von Strafzinsen im Zuge des 2. Kassatagslaufes (**0,3%** pro Tag - mind. EUR 250,00)

=> Die CCP.A versucht weiterhin einen automatischen Deckungskauf durchzuführen

ab 9.4.2009 (S+5) Cash Settlement über die ausgesonderte Position

Berechnung Cash Settlement:

Zusatzannahme:

Aufgrund weiterer Geschäfte in obiger WP-Kategorie im Absonderungsverfahren

bzw. aufgrund des Nettings offener Positionen wurde für die auszusondernde Lieferposition ein Mischkurs von 20,35 ermittelt.

	Wert bei		aktueller Wert	Berechnung	Betrag
	Aussonderungsverfahren	Schlusskurs am 8.4.2009		Cash-Settlement	Cash-Settlement
Variante a):	20.350,00	20,75	20.750,00	$20.750 * 1,2 - 20.350$	4.550,00
Variante b):	20.350,00	20,15	20.150,00	$20.350 * 1,2 - 20.350$	4.070,00

=> bei Variante a) wird Bank A mit dem Cash-Settlement-Betrag von EUR 4.550,00 zuzüglich der Manipulationsgebühr von EUR 250,00 belastet - Bank B (betroffener Übernehmer) bekommt EUR 4.550,00 gutgeschrieben

=> bei Variante b) wird Bank A mit dem Cash-Settlement-Betrag von EUR 4.070,00 zuzüglich der Manipulationsgebühr von EUR 250,00 belastet - Bank B (betroffener Übernehmer) bekommt EUR 4.070,00 gutgeschrieben