

---

## VERÖFFENTLICHUNGEN ZU AGB

---

Die CCP Austria Abwicklungsstelle für Börsengeschäfte GmbH veröffentlicht im Veröffentlichungsorgan auf Grundlage der §§ 31 Abs. 1, 32 Abs. 2, 35 Abs. 7, 36 Abs. 3, 38 Abs. 1, 39 Abs. 1 bis 3, 40 Abs. 6, 43 Abs. 3, 49 Abs. 3, 51 Abs. 5 und 52 Abs. 3 der Allgemeinen Geschäftsbedingungen der CCP Austria mit Veröffentlichung des Börseunternehmens Wiener Börse AG vom 19. März 2018 folgende ergänzende Festlegungen:

### I. Begriffsdefinitionen

ad § 32 Abs. 2:

**Abwicklungstag**

ist jeder Tag, an dem die Clearing Systeme der Abwicklungsstelle zur Abwicklung zur Verfügung stehen (siehe § 32 Abs. 1), wobei jeder Handelstag an der Wiener Börse (geregelter Markt und MTF) als Abwicklungstag gilt

**Geschäftstag**

ist der jeweilige Handelstag an der Wiener Börse AG (geregelter Markt und MTF)

**Erfüllungstag**

ist der zweite Abwicklungstag nach dem Tag des Geschäftsabschlusses

**Handelszeitraum**

ist ein Geschäftstag

**Abrechnungszeitraum**

ist der Zeitraum zwischen dem Tag des Geschäftsabschlusses (**T**) und dem Erfüllungstag (**S**) (siehe § 27 Abs. 3) und beträgt zwei Tage

### **Absonderungstage**

(siehe § 38)

**a) CCP-fähige Wertpapiere im Geregeltten Markt sowie Aktien im Dritten Markt, deren Haupthandelsplatz in der Europäischen Union liegt**

zwischen dem Erfüllungstag (S) und S+4

**b) Andere CCP-fähige Wertpapiere im Dritten Markt (Bonds, ETFs, Zertifikate und Warrants sowie Aktien, deren Haupthandelsplatz in einem Drittland liegt (Artikel 16 Verordnung (EU) Nr. 236/2012)**

zwischen dem Erfüllungstag (S) und S+7

### **Tag des Cash Settlement**

(siehe § 40)

für alle CCP-fähigen Wertpapiere im Geregeltten Markt sowie für Aktien im Dritten Markt, sofern ihr Haupthandelsplatz in der EU liegt, wird der nicht erfüllte Saldo an S+4 ausgesondert und an S+5 in Geld abgewickelt.

Für alle anderen CCP-fähigen Wertpapiere wird der nicht erfüllte Saldo an S+7 ausgesondert und an S+8 in Geld abgewickelt.

## **II. Festsetzung von Fristen**

*ad § 31 Abs. 1 und 35 Abs. 7:* **Hinterlegung der Abwicklungssicherheiten**

- ⇒ Ein Besicherungsverzug eines Clearingmitglieds liegt vor, wenn die Hinterlegung der von der CCP Austria am Ende eines Abwicklungstages oder nach erfolgter Verwertung ermittelten und vorgeschriebenen Sicherheitenanforderungen (margin calls) nicht bis spätestens 10:00 Uhr am nächsten Abwicklungstag am Sicherheitenkonto oder Sicherheitendepot erfolgt.<sup>1</sup>

*ad § 36 Abs. 3:* **Lieferverzug**

- ⇒ Ein Lieferverzug eines Clearingmitglieds liegt vor, wenn sein Abwicklungsdepot oder das eines Abwicklungs-Agenten für die ihm zugeordneten Clearingmitglieder am Abwicklungstag nach dem Erfüllungstag bis 16:00 Uhr keine ausreichende Deckung für

---

<sup>1</sup> Bezüglich der Hinterlegung von Abwicklungssicherheiten ist insbesondere auch § 31 Abs. 3 zu beachten.

die Erfüllung der Lieferverpflichtungen aufweist oder die Abwicklung durch eine Liefersperre verhindert wird.

ad 39 Abs 1 bis 3: **Deckungsverfahren**

a) **CCP-fähige Wertpapiere im Geregeltten Markt sowie Aktien im Dritten Markt, deren Haupthandelsplatz in der Europäischen Union liegt**

- ⇒ Das im Lieferverzug befindliche Clearingmitglied hat, wenn es nicht selbst für nachträgliche Deckung sorgt, bis 16:00 Uhr am zweiten Abwicklungstag nach Beginn des Absonderungsverfahrens (S+2) einen schriftlichen Auftrag zur Eindeckung mit den Fehlmengen bei der CCP Austria zu stellen.
- ⇒ Das im Lieferverzug befindliche Clearingmitglied hat bis 16:00 Uhr am dritten Abwicklungstag nach Beginn des Absonderungsverfahrens (S+3) für nachträgliche Eindeckung auf dem Abwicklungsdepot zu sorgen, um das Deckungsverfahren erfolgreich abzuschließen.
- ⇒ Das Ende des Deckungsverfahrens ist um 16 Uhr am vierten Abwicklungstag (S+4) nach Beginn des Absonderungsverfahrens.

b) **Andere CCP-fähige Wertpapiere im Dritten Markt (Bonds, ETFs, Zertifikate und Warrants sowie Aktien, deren Haupthandelsplatz in einem Drittland liegt (Artikel 16 Verordnung (EU) Nr. 236/2012)**

- ⇒ Das im Lieferverzug befindliche Clearingmitglied hat, wenn es nicht selbst für nachträgliche Deckung sorgt, bis 16:00 Uhr am fünften Abwicklungstag nach Beginn des Absonderungsverfahrens (S+5) einen schriftlichen Auftrag zur Eindeckung mit den Fehlmengen bei der CCP Austria zu stellen.
- ⇒ Das im Lieferverzug befindliche Clearingmitglied hat bis 16:00 Uhr am sechsten Abwicklungstag nach Beginn des Absonderungsverfahrens (S+6) für nachträgliche Eindeckung auf dem Abwicklungsdepot zu sorgen, um das Deckungsverfahren erfolgreich abzuschließen.
- ⇒ Das Ende des Deckungsverfahrens ist um 16 Uhr am siebten Abwicklungstag (S+7) nach Beginn des Absonderungsverfahrens.

ad § 43 Abs. 3: **Zahlungsverzug**

- ⇒ Ein Zahlungsverzug eines Clearingmitglieds liegt vor, wenn sein Abwicklungskonto, das seines Abwicklungs-Agenten oder das seines Payment-Agenten bis 16:00 Uhr am Erfüllungstag keine ausreichende Deckung durch Guthaben oder Kreditgewährung für die Erfüllung der Zahlungsverpflichtungen aufweist.

ad § 49 Abs. 3: **Hinterlegung Ausfallfonds (variable Komponente)**

- ⇒ Ein Besicherungsverzug eines Clearingmitglieds liegt vor, wenn die Hinterlegung der von der CCP Austria ermittelten und vorgeschriebenen variablen Komponente des Ausfallfonds nicht bis spätestens 16:00 Uhr am dritten Abwicklungstag (S+3) am von der CCP Austria genannten Konto erfolgt.

### III. Sonstige Fristen

ad § 38 Abs. 1: **Absonderungsverfahren**

- a) **CCP-fähige Wertpapiere im Regelmärkte Markt sowie Aktien im Dritten Markt, deren Haupthandelsplatz in der Europäischen Union liegt**

Das Absonderungsverfahren beginnt im ersten Buchungslauf am Erfüllungstag und dauert längstens vier Abwicklungstage nach dem gemäß §§ 24 und 27 festgelegten Erfüllungstag.

- b) **Andere CCP-fähige Wertpapiere im Dritten Markt (Bonds, ETFs, Zertifikate und Warrants sowie Aktien, deren Haupthandelsplatz in einem Drittland liegt (Artikel 16 Verordnung (EU) Nr. 236/2012)**

Das Absonderungsverfahren beginnt im ersten Buchungslauf am Erfüllungstag und dauert längstens sieben Abwicklungstage nach dem gemäß §§ 24 und 27 festgelegten Erfüllungstag.

ad § 40 Abs. 6: **Cash Settlement**

- ⇒ Der vom säumigen Verkäufer zu bezahlende Cash Settlement Betrag wird **am ersten Abwicklungstag nach Beendigung der Absonderungsperiode** auf Anweisung durch die CCP Austria von der Abwicklungsbank vom Abwicklungskonto des Verkäufers zuzüglich Bearbeitungsentgelt gemäß der Gebührenordnung der CCP Austria abgebucht und den Abwicklungskonten der betroffenen Käufer abzüglich des Bearbeitungsentgelts gutgeschrieben. Im Fall von Bezugsrechten erfolgt dies am **ersten** Abwicklungstag nach Verfügbarkeit des letzten Preises gemäß § 40 Abs. 4.

ad § 51 Abs. 5: **Verwertung Ausfallfonds**

- ⇒ **Ab dem fünften Abwicklungstag** nach Eintritt des Verzuges ist die CCP Austria berechtigt, die Beiträge des in Verzug befindlichen Clearingmitglieds zum Ausfallfonds zu verwerten.

ad § 52 Abs. 3: **Inanspruchnahme Ausfallfonds**

- ⇒ Verwertete Beiträge zum Ausfallfonds sind von den einzelnen Clearingmitgliedern **innerhalb einer Frist von 10 (zehn) Banktagen** zu erbringen, es sei denn, das Clearingmitglied zeigt **spätestens am fünften Banktag** nach der Inanspruchnahme seiner Beiträge zum Ausfallfonds gegenüber der CCP Austria die Zurücklegung der Clearingmitgliedschaft am Abwicklungssystem an.

Wien, am 19. März 2018

CCP Austria Abwicklungsstelle für Börsengeschäfte GmbH

---

**Wolfgang Aubrunner**  
Mitglied der Geschäftsführung

---

**Mag. Kalina Jarova Müller**  
Prokuristin