

---

## VERÖFFENTLICHUNGEN zu den Allgemeinen Geschäftsbedingungen der CCP Austria

---

Die CCP Austria Abwicklungsstelle für Börsengeschäfte GmbH verlautbart 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 Nr. 1267 des Börseunternehmens Wiener Börse AG vom 29. Juni 2020 folgende ergänzende Festlegungen:

### I. Begriffsdefinitionen

ad § 32 Abs. 2:

<b><u>Abwicklungstag</u></b>	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 (Amtlicher Handel und "Vienna MTF") als Abwicklungstag gilt
<b><u>Handelstag</u></b>	ist der jeweilige Handelstag an der Wiener Börse AG (Amtlicher Handel und "Vienna MTF")
<b><u>Vorgesehener Abwicklungstag</u></b>	ist der zweite Abwicklungstag ( <b>T+2</b> ) nach dem Tag des Geschäftsabschlusses ( <b>T</b> )
<b><u>Tatsächlicher Abwicklungstag</u></b>	ist der Abwicklungstag, an dem die Übertragungen von Geld und Wertpapieren stattfinden
<b><u>Abwicklungszeitraum</u></b>	ist der Zeitraum von zwei Tagen zwischen dem Tag des Geschäftsabschlusses ( <b>T</b> ) und dem vorgesehenen Abwicklungstag ( <b>S</b> ) (siehe § 27 Abs. 3)

**Verlängerungszeitraum**  
siehe § 38

**a) Zwischen dem vorgesehenen Abwicklungstag (S) und S+4:**

- **CCP-fähige Aktien**<sup>1</sup>, deren Haupthandelsplatz in der Europäischen Union liegt

**b) Zwischen dem vorgesehenen Abwicklungstag (S) und S+7:**

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

**Tag des Cash Settlements**  
siehe § 40

**a) Stornierung des nicht erfüllten Saldos an S+5 und Abrechnung an S+6 in bar**

- **CCP-fähigen Aktien**<sup>2</sup>, deren Haupthandelsplatz in der Europäischen Union liegt

**b) Stornierung des nicht erfüllten Saldos an S+8 und Abrechnung an S+9 in bar**

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

## **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>3</sup>

<sup>1</sup> Amtlicher Handel sowie "Vienna MTF".

<sup>2</sup> Amtlicher Handel sowie "Vienna MTF".

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

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 vorgesehenen Abwicklungstag bis 16:00 Uhr keine ausreichende Deckung für die Erfüllung der Lieferverpflichtungen aufweist oder die Abwicklung durch eine Liefersperre verhindert wird.

ad §§ 38 Abs. 1 und 39 Abs. 1 bis 3:

**Verlängerungszeitraum & Buy-in Prozess (Eindeckungsverfahren)**

**a) CCP-fähige Aktien<sup>4</sup>, deren Haupthandelsplatz in der Europäischen Union liegt**

- ⇒ Der Verlängerungszeitraum beginnt im ersten Buchungslauf am vorgesehenen Abwicklungstag und dauert längstens vier Abwicklungstage nach dem gemäß §§ 24 und 27 festgelegten vorgesehenen Abwicklungstag.
- ⇒ Das im Lieferverzug befindliche Clearingmitglied hat, wenn es nicht selbst für nachträgliche Deckung sorgt, bis 16:00 Uhr am dritten Abwicklungstag nach Beginn des Verlängerungszeitraums (S+3) 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 vierten Abwicklungstag nach Beginn des Verlängerungszeitraums (S+4) für nachträgliche Eindeckung auf dem Abwicklungsdepot zu sorgen, um die Lieferverpflichtung erfolgreich zu erfüllen.
- ⇒ Das Ende des Buy-in Prozesses ist um 16 Uhr am fünften Abwicklungstag (S+5) nach Beginn des Verlängerungszeitraums.

**b) CCP-fähige Aktien, deren Haupthandelsplatz in einem Drittland liegt, sowie andere CCP-fähige Wertpapiere (Bonds, ETFs, Zertifikate und Warrants)**

- ⇒ Der Verlängerungszeitraum beginnt im ersten Buchungslauf am vorgesehenen Abwicklungstag und dauert längstens sieben Abwicklungstage nach dem gemäß §§ 24 und 27 festgelegten vorgesehenen Abwicklungstag.
- ⇒ Das im Lieferverzug befindliche Clearingmitglied hat, wenn es nicht selbst für nachträgliche Deckung sorgt, bis 16:00 Uhr am sechsten Abwicklungstag nach Beginn des Verlängerungszeitraums (S+6) einen schriftlichen Auftrag zur Eindeckung mit den Fehlmengen bei der CCP Austria zu stellen.

<sup>4</sup> Amtlicher Handel sowie "Vienna MTF".

- ⇒ Das im Lieferverzug befindliche Clearingmitglied hat bis 16:00 Uhr am siebten Abwicklungstag nach Beginn des Verlängerungszeitraums (S+7) für nachträgliche Eindeckung auf dem Abwicklungsdepot zu sorgen, um die Lieferverpflichtung erfolgreich zu erfüllen.
- ⇒ Das Ende des Buy-in Prozesses ist um 16 Uhr am achten Abwicklungstag (S+8) nach Beginn des Verlängerungszeitraums.

**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 vorgesehenen Abwicklungstag (S) keine ausreichende Deckung durch Guthaben oder Kreditgewährung für die Erfüllung der Zahlungsverpflichtungen aufweist.

**ad § 49 Abs. 3: Hinterlegung Ausfallfonds (ergänzende Beiträge)**

- ⇒ Ein Besicherungsverzug eines Clearingmitglieds liegt vor, wenn die Hinterlegung der von der CCP Austria ermittelten und vorgeschriebenen ergänzenden Beiträge zum Ausfallfonds nicht bis spätestens 16:00 Uhr am dritten Abwicklungstag am von der CCP Austria genannten Konto erfolgt.

### III. Sonstige Fristen

**ad § 40 Abs. 6: Cash Settlement**

- ⇒ Die vom säumigen Verkäufer zu bezahlende Entschädigung wird am ersten Abwicklungstag nach Ende des Verlängerungszeitraums (S+6 bzw. S+9) 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 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 an der Abwicklung an.

Wien, am 29. June 2020

CCP Austria Abwicklungsstelle für Börsengeschäfte GmbH

**Mag. Kalina Jarova Müller**  
Mitglied der Geschäftsführung

**Wolfgang Aubrunner**  
Mitglied der Geschäftsführung