

Veröffentlichun- gen zu den AGB der CCPA

Wertpapiermarkt

08.05.2024

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, 52 Abs. 3 und 55 der Allgemeinen Geschäftsbedingungen der CCPA mit Veröffentlichung Nr. 1439 des Börseunternehmens Wiener Börse AG vom 06.05.2024 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 (Amtlicher Handel und "Vienna MTF") als Abwicklungstag gilt.

Handelstag ist der jeweilige Handelstag an der Wiener Börse AG (Amtlicher Handel und "Vienna MTF").

Vorgesehener Abwicklungstag ist der zweite Abwicklungstag (T+2) nach dem Tag des Geschäftsabschlusses (T).

Tatsächlicher Abwicklungstag ist der Abwicklungstag, an dem die Übertragungen von Geld und Wertpapieren stattfinden.

Abwicklungszeitraum ist der Zeitraum von zwei Tagen zwischen dem Tag des Geschäftsabschlusses (T) und dem vorgesehenen Abwicklungstag (S) (siehe § 27 Abs. 3).

Verlängerungszeitraum (siehe § 38)

- a) Zwischen dem vorgesehenen Abwicklungstag (S) und S+4:
 - ◆ CCP-fähige Aktien¹, 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 Aktien², 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)

¹ Amtlicher Handel sowie "Vienna MTF".

² Amtlicher Handel sowie "Vienna MTF".

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 CCPA 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.³

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 (Eindeckungsvorgang)

- a) CCP-fähige Aktien⁴, deren Haupthandelsplatz in der Europäischen Union liegt
 - ◆ Der Verlängerungszeitraum beginnt im ersten Buchungslauf am vorgesehenen Abwicklungstag und dauert längstens fünf 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 CCPA zu stellen.
 - ◆ Das im Lieferverzug befindliche Clearingmitglied hat bis 09:00 Uhr am fünften Abwicklungstag nach Beginn des Verlängerungszeitraums (S+5) 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 acht 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 CCPA zu stellen.

³ Bezüglich der Hinterlegung von Abwicklungssicherheiten ist insbesondere auch § 31 Abs. 3 zu beachten.

⁴ Amtlicher Handel sowie „Vienna MTF“

- ◆ Das im Lieferverzug befindliche Clearingmitglied hat bis 09:00 Uhr am achten Abwicklungstag nach Beginn des Verlängerungszeitraums (S+8) 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 CCPA ermittelten und vorgeschriebenen ergänzenden Beiträge zum Ausfallfonds nicht bis spätestens 16:00 Uhr am dritten Abwicklungstag am von der CCPA 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 CCPA von der Abwicklungsbank vom Abwicklungskonto des Verkäufers zuzüglich Bearbeitungsentgelt gemäß der Gebührenordnung der CCPA 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 CCPA 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 CCPA die Zurücklegung der Clearingmitgliedschaft an der Abwicklung an.

ad § 55: Fristen bei Geldbußeneinhebung und -ausschüttung

Die geldmäßige Instruktion ("payment free of delivery") wird von CCP.A am 15. (fünfzehnten) Abwicklungstag eines Kalendermonats erstellt. Die Einhebung der instruierten Geldbußen von den einzelnen Clearingmitgliedern erfolgt am 17. (siebzehnten) Abwicklungstag eines Kalendermonats. Das Clearingmitglied ist verpflichtet die Voraussetzungen für die Einhebung zu schaffen und für ausreichende Deckung auf dem Abwicklungskonto fristgerecht am 17. (siebzehnten) Abwicklungstag zu sorgen. Die Ausschüttung an die vom Scheitern der Abwicklung betroffenen Clearingmitglieder durch CCP.A erfolgt taggleich.

IV Sonderregelungen für Feiertagshandel

An Abwicklungstagen, die auf einen österreichischen gesetzlichen Feiertag gemäß § 7 Abs. 2 Arbeitsruhegesetz fallen, erfolgt die Freigabe von Überdeckungen in Abwicklungssicherheiten gemäß § 47 Abs. 3 sowie die Abwicklung des Barausgleichs gemäß § 40 Abs. 6 am darauffolgenden Abwicklungstag.