

FrontLine

Anhang

1.0 Einfaches Preismodell für verspätete/fehlgeschlagene Abwicklungen per 1. März 2009

Die gegenwärtig verrechneten Ansätze für verspätete/fehlgeschlagene Abwicklungen werden ab 1. März 2009 durch ein einfaches, einheitliches Preismodell ersetzt.

Fristgerechte Abwicklungen erhöhen die Settlement-Rate und tragen wesentlich zur Systemsicherheit bei.

Berechnung ab 1. März 2009

Für am Valutatag nicht abgewickelte Transaktionen (verspätete/fehlgeschlagene Abwicklungen) kommt ein einheitlicher, zweistufiger Ansatz zur Anwendung.

Dieser Ansatz gilt jeweils für jede Abwicklung und jeden Tag, wobei der Ansatz mit dem Abwicklungsbetrag multipliziert werden muss. Dabei wird pro Tag und Abwicklung (Settlement) ein Mindestbetrag verrechnet. Bei Abwicklungsbeträgen über CHF 50 Mio. müssen jeweils beide der unten aufgeführten Stufen durchlaufen werden, d.h. der Teil bis CHF 50 Mio. wird mit dem höheren, der Rest mit dem tieferen Ansatz verrechnet.

Bezeichnung	MwSt.	Code
Late/failed settlement (x-clear)	0.00%	11'801, 11'802

Stufe	Prozentsatz	Volumenuntergrenze in CHF	Volumenobergrenze in CHF
1	0.070%	0	50'000'000
2	0.040%	> 50'000'000	
Im Minimum werden CHF 100.00 belastet.			

Es muss beachtet werden, dass SIX x-clear die Kosten für Wertpapierleihe (SLB) zusätzlich weiterverrechnet.

Kompensationen für verspätete Abwicklungen

Die Hälfte des vereinnahmten Betrags gemäss dem oben erwähnten Ansatz wird der betroffenen Gegenpartei automatisch als Kompensation gemäss nachfolgender Tabelle gutgeschrieben, sofern die zeitgerechte Lieferung nicht möglich ist.

Bezeichnung	MwSt.	Code
Compensation late failed settlement (x-clear)	0.00%	11'820

Stufe	Prozentsatz	Volumenuntergrenze in CHF	Volumenobergrenze in CHF
1	0.035%	0	50'000'000
2	0.020%	> 50'000'000	
Im Minimum werden CHF 50.00 gutgeschrieben.			

FrontLine

Anhang

Berechnung bis 28. Februar 2009

Für am Valutatag nicht abgewickelte Transaktionen (verspätete/fehlgeschlagene Abwicklungen) kommen zwei unterschiedliche Ansätze zur Anwendung.

Die nachfolgenden Ansätze gelten jeweils für jede Abwicklung und jeden Tag, wobei der Ansatz mit dem Abwicklungsbetrag multipliziert werden muss. Dabei wird pro Tag und Abwicklung (Settlement) ein Mindestbetrag verrechnet. Bei Abwicklungsbeträgen über CHF 50 Mio. müssen alle drei Stufen durchlaufen werden.

Bezeichnung	MwSt.	Code
Late/failed settlement no SLB (xcl)	0.00%	11'801

Stufe	Prozentsatz	Volumenuntergrenze in CHF	Volumenobergrenze in CHF
1	0.10%	0	50'000'000
2	0.05%	50'000'000	100'000'000
3	0.03%	100'000'000	> 100'000'000
Im Minimum werden CHF 150.00 belastet.			

Reduzierter Ansatz (mit automatischer Wertpapierleihe):

Bezeichnung	MwSt.	Code
Late/failed settlement with SLB (xcl)	0.00%	11'802

Stufe	Prozentsatz	Volumenuntergrenze in CHF	Volumenobergrenze in CHF
1	0.05%	0	50'000'000
2	0.025%	50'000'000	100'000'000
3	0.015%	100'000'000	> 100'000'000
Im Minimum werden CHF 75.00 belastet.			

Bedingungen für den reduzierten Ansatz (mit automatischer Wertpapierleihe):

1. Die Abwicklung (Settlement) muss bei SIX SIS erfolgen.
2. Das betroffene Mitglied muss die automatische Wertpapierleihe (SLB) aufgesetzt haben und alle Bedingungen für die Nutzung derselben erfüllen.
3. Die Abwicklung ist wegen der Nichtverfügbarkeit der Titel fehlgeschlagen, d.h. sie konnte durch das entsprechende Mitglied nicht verhindert werden.

Es muss beachtet werden, dass SIX x-clear die Kosten für Wertpapierleihe (SLB) zusätzlich weiterverrechnet.

FrontLine

Anhang

Kompensationen für verspätete Abwicklungen

Bezeichnung	MwSt.	Code
Compensation late failed settlement (x-clear)	0.00%	11'820

Stufe	Prozentsatz	Volumenuntergrenze in CHF	Volumenobergrenze in CHF
1	0.05%	0	50'000'000
2	0.025%	50'000'000	100'000'000
3	0.015%	100'000'000	> 100'000'000
Im Minimum werden CHF 75.00 gutgeschrieben.			