

## Der Handelspflicht unterliegende Derivate

Tabelle 1

Tabelle 1

## Auf EUR lautende Fixed-to-float-Zinsswaps

Währungsreine Fixed- to-Float Zinsswaps — EURIBOR EUR 3 und 6 Monate		
Abwicklungswährung	EUR	EUR
Abwicklungsmodus	Spot (T+2)	Spot (T+2)
Option	Nein	Nein
Laufzeit	2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 12, 15, 20, 30 J	2, 3, 4, 5, 6, 7, 10, 15, 20, 30 J
Art des Nominalwerts	Konstanter Nominalwert	Konstanter Nominalwert
Festsatzseite		
Zahlungsrhythmus	Jährlich oder halbjährlich	Jährlich oder halbjährlich
Zinsberechnungsmethode	30/360 oder act/360	30/360 oder act/360
Variable Seite:		
Referenzindex	6-Monats-EURIBOR	3-Monats-EURIBOR
Frequenz der Neufestsetzung	Halbjährlich oder vierteljährlich	Vierteljährlich
Zinsberechnungsmethode	Act/360	Act/360

Tabelle 2

## Auf USD lautende Fixed-to-float-Zinsswaps

Währungsreine Fixed- to-Float Zinsswaps — LIBOR USD 3 Monate		
Abwicklungswährung	USD	USD
Abwicklungsmodus	Spot (T+2)	IMM (kommende zwei IMM-Termine)
Option	Nein	Nein
Laufzeit	2, 3, 4, 5, 6, 7, 10, 12, 15, 20, 30 J	2, 3, 4, 5, 6, 7, 10, 12, 15, 20, 30 J
Art des Nominalwerts	Konstanter Nominalwert	Konstanter Nominalwert
Festsatzseite		
Zahlungsrhythmus	Jährlich oder halbjährlich	Jährlich oder halbjährlich
Zinsberechnungsmethode	30/360 oder act/360	30/360 oder act/360
Variable Seite:		
Referenzindex	LIBOR USD 3 Monate	LIBOR USD 3 Monate
Frequenz der Neufestsetzung	Vierteljährlich	Vierteljährlich
Zinsberechnungsmethode	Act/360	Act/360
Währungsreine Fixed- to-Float Zinsswaps — LIBOR USD 6 Monate		
Abwicklungswährung	USD	USD
Abwicklungsmodus	Spot (T+2)	IMM (kommende zwei IMM-Termine)
Option	Nein	Nein
Laufzeit	2, 3, 4, 5, 6, 7, 10, 12, 15, 20, 30 J	2, 3, 4, 5, 6, 7, 10, 12, 15, 20, 30 J
Art des Nominalwerts	Konstanter Nominalwert	Konstanter Nominalwert
Festsatzseite		

# 1/3/18. DelV Derivate

## Anhang

Zahlungsrhythmus	Jährlich oder halbjährlich	Jährlich oder halbjährlich
Zinsberechnungsmethode	30/360 oder act/360	30/360 oder act/360
<b>Variable Seite:</b>		
Referenzindex	LIBOR USD 6 Monate	LIBOR USD 6 Monate
Frequenz der Neufestsetzung	Vierteljährlich oder halbjährlich	Vierteljährlich oder halbjährlich
Zinsberechnungsmethode	Act/360	Act/360

Tabelle 3

### Auf GBP lautende Fixed-to-float-Zinsswaps

<b>Währungsreine Fixed- to-Float Zinsswaps — LIBOR GBP 3 und 6 Monate</b>		
Abwicklungswährung	<b>GBP</b>	<b>GBP</b>
Abwicklungsmodus	Spot (T+0)	Spot (T+0)
Option	Nein	Nein
Laufzeit	2, 3, 4, 5, 6, 7, 10, 15, 20, 30 J	2, 3, 4, 5, 6, 7, 10, 15, 20, 30 J
Art des Nominalwerts	Konstanter Nominalwert	Konstanter Nominalwert
<b>Festsatzseite</b>		
Zahlungsrhythmus	Vierteljährlich oder halbjährlich	Vierteljährlich oder halbjährlich
Zinsberechnungsmethode	Act/365F	Act/365F
<b>Variable Seite:</b>		
Referenzindex	LIBOR GBP 6 Monate	LIBOR GBP 6 Monate
Frequenz der Neufestsetzung	Halbjährlich oder vierteljährlich	Vierteljährlich
Zinsberechnungsmethode	Act/365F	Act/365F

Tabelle 4

### Index-CDS

Art	Untergruppe	Geografisches Gebiet	Referenzindex	Abwicklungswährung	Serie	Laufzeit
Index-CDS	Nicht tran- chierter Index	Europa	iTraxx Euro- pe Main	EUR	On-the-run- Serie Erste Off-the- run-Serie	5 J
Index-CDS	Nicht tran- chierter Index	Europa	iTraxx Euro- pe Crossover	EUR	On-the-run- Serie Erste Off-the- run-Serie	5 J