

Angebotsanfrage-Formblatt für die Clearingdienstleistung zur Abwicklung von OTC- Zinsderivaten

Stand März 2022

..Deka



Angebotsanfrage-Formblatt

Clearingdienstleistung für OTC-Zinsderivate

Inhalt

| | |
|---|------------|
| Abkürzungsverzeichnis | III |
| Einführung | 4 |
| 1. Kundenangaben | 5 |
| 2. Angaben zu den betroffenen OTC-Derivaten und zum Clearing-Vorhaben | 6 |
| 3. Benötigte Unterlagen nach Angebotserstellung zur Durchführung des Onboardings | 8 |
| 4. Wichtige Hinweise und Haftungsausschluss | 9 |

Angebotsanfrage-Formblatt

Clearingdienstleistung für OTC-Zinsderivate

Abkürzungsverzeichnis

| | |
|------------|--|
| CCP | Central Counterparty |
| CRV | Clearing-Rahmenvereinbarung |
| DekaBank | DekaBank Deutsche Girozentrale |
| EMIR | European Market Infrastructure Regulation |
| Eurex | Eurex Clearing AG |
| FC | Financial Counterparty |
| FRA | Forward Rate Agreements |
| FRANDT | Fair, Reasonable, Non-Discriminatory and Transparent |
| IM | Initial Margin |
| ISA | Individual Segregated Account |
| LCH | LCH Ltd |
| LEI | Legal Entity Identifier |
| MTF | Multilateral Trading Facility |
| NFC | Non-Financial Counterparty |
| OIS | Overnight-Index-Swaps |
| OSA | Omnibus Segregated Account |
| OTC | Over the Counter |
| EMIR-Refit | Überarbeitung der europäischen Marktinfrastrukturverordnung EMIR |
| SFG | Sparkassen-Finanzgruppe |

Angebotsanfrage-Formblatt

Clearingdienstleistung für OTC-Zinsderivate

Einführung

Die DekaBank Deutsche Girozentrale (DekaBank) agiert als Wertpapier-Dienstleister innerhalb der Sparkassen-Finanzgruppe (SFG). Damit einhergehend bietet die DekaBank als Verbundpartner und Mitglied des SFG das sog. Clearing außerbörslicher Derivatekontrakte („Over the Counter“ - OTC-Derivate) über zentrale Gegenparteien nach Maßgabe der European Market Infrastructure Regulation¹ (EMIR) an. Die DekaBank ist hierfür ausschließlich für die Clearing-Kategorie „Interest Rate“ als Clearing-Mitglied für das Kunden-Clearing bei den zentralen Gegenparteien („Central Counterparty“ - CCP) Eurex Clearing AG mit Sitz in Frankfurt am Main (Eurex) und LCH Ltd mit Sitz in London (LCH) angebunden.

Mit Artikel 1 Nr. 2 b) der Verordnung (EU) Nr. 2019/834 vom 20. Mai 2019 (EMIR-Refit) werden weiterführende Voraussetzungen festgelegt, unter denen die handelsüblichen Bedingungen von Clearingdiensten für OTC-Derivate als fair, angemessen, diskriminierungsfrei und transparent anzusehen sind (EMIR-FRANDT). Diese Anforderungen wurden im Rahmen einer Delegierten Verordnung vom 2. Juni 2021 präzisiert². Zur Erfüllung dieser Pflichten muss die DekaBank als Clearing-Mitglied/Clearing Broker bei einer zentralen Gegenpartei u.a. ein Formblatt zur Einholung eines Angebots des Clearingdienstleisters zur Aufnahme als Kunde („Angebotsanfrage-Formblatt“) auf der Website veröffentlichen.

Das vorliegende Angebotsanfrage-Formblatt unterstützt potenzielle Kunden bei der Einreichung vorbereiteter und vollständiger Angebotsanfragen. Potenzielle Kunden können frei wählen, ob sie das von der DekaBank veröffentlichte Formblatt verwenden, andere Formen von Angebotsanfragen nutzen oder die DekaBank als Clearingdienstleister auf andere Weise kontaktieren. Das Formblatt der DekaBank ist unter <https://www.deka.de/deka-gruppe/produkte-loesungen/clearingdienstleistungen> abrufbar und enthält – gemäß der regulatorischen Vorgabe – Fragen mit der Bitte um Angaben zu den:

- Stammdaten des potenziellen Kunden,
- Unterlagen, die der potenzielle Kunde der DekaBank nach Angebotsannahme im Rahmen des Onboarding-Prozesses zu übermitteln hat,
- für das Clearing vorgesehenen OTC-Derivaten und zum Clearing-Vorhaben und
- Informationen oder Unterlagen, die der potenzielle Kunde der DekaBank vorzulegen hat, damit die DekaBank ein auf umfassende Informationen gestütztes, ausführliches Angebot erstellen kann.

Nach Übermittlung der Angaben sowie Unterlagen nimmt die DekaBank eine Erstprüfung auf Vollständigkeit vor. Sofern weiterführende Fragen bzw. Rückfragen bestehen, werden diese nach Erstprüfung übermittelt. Auf Basis der vollständigen Informationen prüft die DekaBank inwiefern ein Angebot zur Aufnahme der Clearing-Beziehung erstellt werden kann. Für die detaillierte prozessuale Abfolge der Prüfung und Angebotserstellung wird auf die Beschreibung der Onboarding-Schritte unter <https://www.deka.de/deka-gruppe/produkte-loesungen/clearingdienstleistungen> verwiesen.

¹ Verordnung (EU) Nr. 648/2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister.

² Delegierte Verordnung Nr. 2021/1456.

Angebotsanfrage-Formblatt

Clearingdienstleistung für OTC-Zinsderivate

1. Kundenangaben

Bitte übermitteln Sie uns die folgenden Angaben zum Unternehmen:

- a. Wie ist der vollständige rechtliche Bezeichnung des Unternehmens?
- b. Wie ist der Legal Entity Identifier (LEI) des Unternehmens?
- c. Wie lautet die Kreditnehmereinheit zum Unternehmen?
- d. Handelt es sich beim Unternehmen um eine finanzielle (FC) oder nichtfinanzielle Gegenpartei (NFC) im Sinne des Artikel 1 der Verordnung (EU) Nr. 2019/834 i. V. m. Artikel 2 der EMIR?
- e. In welchem Sektor ist das Unternehmen tätig?
- f. Ist das Unternehmen ein Mitglied der SFG?
- g. Unterliegt das Unternehmen der Clearing-Pflicht nach Artikel 4a Buchstabe a oder 10 der EMIR?

Angebotsanfrage-Formblatt

Clearingdienstleistung für OTC-Zinsderivate

2. Angaben zu den betroffenen OTC-Derivaten und zum Clearing-Vorhaben

Bitte übermitteln Sie uns die folgenden Angaben zu den für das Clearing vorgesehenen OTC-Derivaten:

- a. Welche clearing-pflichtigen Produktklassen nach Artikel 4 EMIR (inklusive Abwicklungswährung) sollen in das Clearing gegeben werden? Bitte nutzen Sie hierfür den Anhang „Clearingpflichtige Kategorien von OTC-Zinsderivaten“.
- b. Sind darüber hinaus OTC-Derivate für das freiwillige Clearing vorgesehen?
- c. Sofern OTC-Derivate freiwillig ins Clearing gegeben werden sollen, listen Sie die Produktklasse auf.
- d. In welchem Umfang (durchschnittliche Anzahl der Geschäfte pro Monat) ist das Clearing von OTC-Derivaten vorgesehen?
- e. An welchen CCPs soll das Clearing durchgeführt werden?
- f. Welches Schutzniveau (Kontenmodell³) wird für die Führung der Positionen und zur Verwahrung der Sicherheiten angestrebt?
- g. Welche Multilateralen Handelssysteme (MTF) werden zum Handel von OTC-Derivaten verwendet?
- h. Welche Konnektivität ist zum CCP vorgesehen (direkt oder über Zwischenanwendungen)?
- i. Welche Art von Sicherheiten sollen zur Leistung der Initial Margin (IM) gestellt werden (Barmittel, Wertpapiere, beides)?
- j. Welche Anforderungen bestehen an das Reporting des Clearing Brokers?
- k. Welche Anforderungen bestehen an erweiterte Clearing Services („Netting“, „Backloading“, etc.)?
- l. Wie soll die Meldung nach Artikel 9 EMIR erfolgen (eigene Meldung oder Delegationsmeldung des Clearing Brokers)?
- m. Besteht bereits eine Anbindung an andere Clearing Broker?

³ Omnibus Segregated Account (OSA) oder Individual Segregated Account (ISA).

Angebotsanfrage-Formblatt

Clearingdienstleistung für OTC-Zinsderivate

- n. Handelt Ihr Unternehmen bereits in nicht-geclearten OTC-Derivaten?

- o. Besteht bereits eine Geschäftsbeziehung mit der DekaBank? Wenn ja, welche?

Angebotsanfrage-Formblatt

Clearingdienstleistung für OTC-Zinsderivate

3. Benötigte Unterlagen nach Angebotserstellung zur Durchführung des Onboardings

Sofern es zur Aufnahme der Clearing-Beziehung mit der DekaBank kommt, wird für das weitere Onboarding der Abschluss der folgenden Dokumente – jeweils in der aktuellen Fassung – benötigt:

- a. Clearing-Rahmenvereinbarung (CRV 2019)

Stellt die rechtliche Grundlage für das Clearing standardisierter OTC-Derivate dar und wird CCP-übergreifend abgeschlossen.

- b. CCP-Anhänge

CCP-spezifische Ergänzung zu den Bestimmungen der CRV.

- c. CRV-Besicherungsanhang

Dient zur Besicherung aller bestehenden, künftigen und befristeten Ansprüche des Sicherungsnehmers gegen den Sicherungsgeber aus der CRV und wird pro CCP abgeschlossen.

- d. CRV-Ergänzungsvereinbarung

Wird für die individualvertragliche Ergänzung der CRV verwendet.

Angebotsanfrage-Formblatt

Clearingdienstleistung für OTC-Zinsderivate

4. Wichtige Hinweise und Haftungsausschluss

Dieses Dokument stellt weder eine rechtliche oder sonstige Form der Beratung, noch eine Werbung oder eine Empfehlung noch ein Angebot oder eine Aufforderung zur Abgabe eines Angebots dar. Es soll lediglich als Orientierungs- und Entscheidungshilfe dienen und begründet weder eine vertragliche Beziehung zwischen dem Adressaten und der DekaBank und/oder ihren Tochterunternehmen noch eine sonstige bindende Verpflichtung seitens der DekaBank und/oder ihrer Tochterunternehmen. Dieses Dokument enthält nicht alle Informationen, die Sie unter Umständen benötigen, um eine für Sie abschließende Entscheidung im Hinblick auf Clearingdienstleistungen zu treffen. Die DekaBank stellt diese Information zur Verfügung, ohne eine Garantie oder eine Haftung für die Richtigkeit oder Vollständigkeit zu übernehmen. Die DekaBank schließt jede Haftung für direkte oder indirekte Schäden, Folgeschäden oder sonstige Verluste oder Schäden, einschließlich entgangener Gewinne, die Ihnen oder Dritten im Vertrauen auf dieses Dokument entstehen, aus. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen kann die DekaBank jederzeit ohne Vorankündigung ändern.



DekaBank
Deutsche Girozentrale
60625 Frankfurt
Telefon: (0 69) 71 47- 6 52
Telefax: (0 69) 25 46- 24 83
www.deka.de

Handelsregister:
Amtsgericht Frankfurt am Main
HRA 16068
USt-Id-Nr.: DE 114103563



Angebotsanfrage-Formblatt

Clearingdienstleistung für OTC-Zinsderivate

Anhang: Clearingpflichtige Kategorien von OTC-Zinsderivaten⁴

| Nr. | Referenzzinssatz | Abwicklungswährung | Laufzeit | Art der Abwicklungswährung | Option | Art des Nominalwerts | Bedarf an Clearing durch potenziellen Kunden (bitte ankreuzen) |
|--------------------------------------|------------------|--------------------|----------|----------------------------|--------|------------------------|---|
| Basisswaps | | | | | | | |
| 1 | EURIBOR | EUR | 28T-50J | dieselbe Währung | nein | konstant oder variabel | <input type="checkbox"/> |
| 2 | LIBOR | GBP | | | | | <input type="checkbox"/> |
| 2 | | JPY | | | | | <input type="checkbox"/> |
| 4 | | USD | | | | | <input type="checkbox"/> |
| Fixed-to-Float-Zinsswaps | | | | | | | |
| 5 | EURIBOR | EUR | 28T-50J | dieselbe Währung | nein | konstant oder variabel | <input type="checkbox"/> |
| 6 | LIBOR | GBP | | | | | <input type="checkbox"/> |
| 7 | | JPY | | | | | <input type="checkbox"/> |
| 8 | | USD | | | | | <input type="checkbox"/> |
| 9 | NIBOR | NOK | 28T-10J | dieselbe Währung | nein | konstant oder variabel | <input type="checkbox"/> |
| 10 | WIBOR | PLN | | | | | <input type="checkbox"/> |
| 11 | STIBOR | SEK | | | | | 28T-15J |
| Forward Rate Agreements (FRA) | | | | | | | |
| 12 | EURIBOR | EUR | 3T-3J | dieselbe Währung | nein | konstant oder variabel | <input type="checkbox"/> |
| 13 | LIBOR | GBP | | | | | <input type="checkbox"/> |
| 14 | | USD | | | | | <input type="checkbox"/> |
| 15 | NIBOR | NOK | 3T-2J | dieselbe Währung | nein | konstant oder variabel | <input type="checkbox"/> |
| 16 | WIBOR | PLN | | | | | <input type="checkbox"/> |
| 17 | STIBOR | SEK | 3T-3J | <input type="checkbox"/> | | | |
| Overnight-Index-Swaps (OIS) | | | | | | | |
| 18 | EONIA | EUR | 7T-3J | dieselbe Währung | nein | konstant oder variabel | <input type="checkbox"/> |
| 19 | FedFunds | USD | | | | | <input type="checkbox"/> |
| 20 | SONIA | GBP | | | | | <input type="checkbox"/> |

⁴ Gemäß der Delegierten Verordnungen EU Nr. 2015/2205 vom 6. August 2015 und EU Nr. 2016/1178 vom 10. Juni 2016. Hinweis: Im Rahmen der Benchmarks-Ersetzungen bei Derivaten befindet sich die Verordnung EU Nr. 2015/2205 in Überarbeitung. Die Anpassung des Anhangs in diesem Dokument wird nach Veröffentlichung der Überarbeitung im EU Amtsblatt vorgenommen.