

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

### Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

#### Teilabschnitt 3.3 Für den Off-Book-Handel zulässige Referenzgeschäfte

[...]

##### 3.3.4 Referenzgeschäfte im Rahmen eines EFS-Geschäfts

###### 3.3.4.1 EFS-for-Fixed-Income

Ein Zinsswap<sub>1</sub>-Overnight Index Swap (OIS) oder swaption kann ein Referenzinstrument im Rahmen eines EFS-for –Fixed-Income-Geschäfts sein, wenn es sich um ein Geschäft im Rahmen eines ISDA Master Agreements oder eines vergleichbaren Rahmenvertrages handelt.

Die Kontraktanzahl der gehandelten Futures-Kontrakte muss sich in einem bestimmten Verhältnis zum Nominalwert des Zinsswaps, OIS oder -swaptions befinden. Das Verhältnis zwischen Futures-Kontrakt und Swap bzw. Swaption wird durch die Durationsmethode bestimmt. ~~Die Kontraktanzahl der gehandelten Index Futures Kontrakte muss sich in einem bestimmten Verhältnis zum Marktwert des Aktienkorbes befinden, der über den Equity Index Swap abgebildet wird. Dieser darf gegenüber dem Kontraktwert der Futuresposition um maximal 20 Prozent abweichen. Das dem EFP-F-Geschäft zugrundeliegende Geschäft im Referenzinstrument muss in einer Währung der OECD-Mitgliedsstaaten denominiert sein.~~

Im Falle eines EFS-Geschäfts mit einem Zinsswaps-Geschäft oder OIS als Referenzgeschäft sind zusätzlich zu den allgemeinen Pflichteingaben eines Off-Book Geschäfts die folgenden spezifischen Pflichteingaben vorzunehmen: Nominalbetrag, Zinssatz, Zinszahlungsfrequenz sowie Start- und Enddatum der Swap-Transaktion. Im Falle eines EFS-Geschäfts mit einem Zinsswaptions-Geschäft als Referenzgeschäft sind zusätzlich zu den allgemeinen Pflichteingaben eines Off-Book Geschäfts die folgenden spezifischen Pflichteingaben vorzunehmen: Nominalbetrag, Optionsprämie, Fälligkeit der Option sowie die Gesamtlaufzeit der zugrundeliegenden Swap-Transaktion.

[...]

\*\*\*\*\*