

--

Zusatzvereinbarung vom
zu den erfassten Rahmenverträgen (wie in Nr. 2 definiert)

Zusatzvereinbarung für den Übergang von EONIA auf €STR

Zwischen

Name und Anschrift des Vertragspartners
(nachstehend „ Vertragspartner “ genannt)

und

Name und Anschrift der Bank
(nachstehend „ Bank “ genannt)

Bank und Vertragspartner nachstehend zusammen die „Parteien“

wird Folgendes vereinbart:

1. Zweck und Gegenstand

- (1) Vor dem Hintergrund der EU Benchmark-Verordnung ergänzt diese Zusatzvereinbarung („**Zusatzvereinbarung**“) erfasste Regelungen (wie in Nr. 2 definiert) insbesondere um Bestimmungen zur Ersetzung des Referenzwertes Euro OverNight Index Average (EONIA).
- (2) Sofern die Parteien vor oder mit Abschluss dieser Zusatzvereinbarung für erfasste Verträge (wie in Nr. 2 definiert) bereits Regelungen im Zusammenhang mit Änderungen oder der Einstellung von Referenzwerten oder Bezugsgrößen oder Regelungen für den Übergang von EONIA auf €STR vereinbart haben, haben die Regelungen dieser Zusatzvereinbarung Vorrang. Dies gilt jedoch nicht, soweit gemäß Nr. 5 in Verbindung mit Anlage 2 der Vorrang anderer Benchmark-Regelungen vereinbart worden ist.
- (3) Treten sowohl der Vertragspartner als auch die Bank einem gegebenenfalls von der International Swaps and Derivatives Association, Inc. veröffentlichten Protokoll über die Bestimmung von Nachfolgeregelungen für EONIA (dies schließt das ISDA 2018 Benchmarks Supplement Protocol nicht mit ein) bei, werden die erfassten Verträge nicht von den Wirkungen dieses Protokolls erfasst, es sei denn, die Parteien legen dies ausdrücklich fest.
- (4) Diese Zusatzvereinbarung berührt nicht die Anwendbarkeit von Bestimmungen in den erfassten Verträgen (wie in Nr. 2 definiert), die die Behandlung von negativen Zinssätzen regeln.

2. Begriffsbestimmungen

- (1) Im Sinne dieser Zusatzvereinbarung ist bzw. sind:
 - „**€STR**“ die Euro Short Term Rate (€STR) für einen Tag, die von der Europäischen Zentralbank (oder einem Nachfolge-Administrator) als Administrator dieses Referenzwertes im Hinblick auf diesen Tag festgestellt und auf der EZB-Webseite veröffentlicht wird.
 - „**€STR (zuzüglich Ausgleichszahlung)**“ €STR mit der Maßgabe, dass ein einmaliger Ausgleichsbetrag nach Nr. 3 Abs. 2 zu zahlen ist.
 - „**Administrator**“ jede natürliche oder juristische Person, die die Kontrolle über die Bereitstellung eines Referenzwertes ausübt.
 - „**EDFR Spread**“ (i) wenn ein Index-Beendigungsereignis im Hinblick auf €STR eintritt und kein empfohlener EZB-Satz vor Ende des ersten TARGET Abwicklungstages nach dem Eintritt dieses Index-Beendigungsereignisses empfohlen wird, das arithmetische Mittel der täglichen Differenz zwischen dem €STR und dem Einlagefazilitäts-Zinssatz während eines Beobachtungszeitraums von 30 TARGET Abwicklungstagen oder (ii) wenn ein Index-Beendigungsereignis im Hinblick

auf einen empfohlenen EZB-Satz eintritt, das arithmetische Mittel der täglichen Differenz zwischen dem empfohlenen EZB-Satz und dem Einlagefazilitäts-Zinssatz während eines Beobachtungszeitraums von 30 TARGET Abwicklungstagen. Der jeweilige Beobachtungszeitraum beginnt 30 TARGET Abwicklungstage (einschließlich) vor dem Tag, an dem das betreffende Index-Beendigungsereignis eintritt und endet am TARGET Abwicklungstag (einschließlich), der dem Tag des betreffenden Index-Beendigungsereignisses unmittelbar vorangeht.

- „**EMMI-Webseite**“ die Webseite des European Money Market Institutes mit der Adresse <https://www.emmi-benchmarks.eu> oder eine Nachfolgequelle.
- „**empfohlener EZB-Satz**“ der Zinssatz (einschließlich etwaiger Zuschläge (*spreads*) und Anpassungen), der (i) von der Europäischen Zentralbank (oder einem Nachfolge-Administrator für den €STR) oder (ii) von einer von der Europäischen Zentralbank (oder einem Nachfolge-Administrator für den €STR) offiziell benannten Stelle als Ersatz für €STR empfohlen wird.
- „**Einlagefazilitäts-Zinssatz**“ der Zinssatz für die Eurosystem-Einlagefazilität (auch *Eurosystem Deposit Facility Rate* genannt), der für täglich fällige Einlagen von Banken im Eurosystem gilt und der auf der EZB-Webseite veröffentlicht wird.
- „**Einstellungstag**“ der Tag (einschließlich), ab dem der jeweilige Referenzwert infolge eines Index-Beendigungsereignisses nicht mehr zur Verfügung gestellt wird.
- „**EONIA**“ (i) der für einen Tag vom European Money Market Institute (EMMI) (oder einem Nachfolge-Administrator) als Administrator dieses Referenzwertes im Hinblick auf diesen Tag festgestellte und auf der EMMI-Webseite veröffentlichte Euro OverNight Index Average oder (ii) der für einen Tag von der Europäischen Zentralbank im Hinblick auf diesen Tag festgestellte und durch Bloomberg, Reuters oder vergleichbare Quellen veröffentlichte Euro OverNight Index Average. Eine Bezugnahme auf EONIA in den erfassten Regelungen gilt unabhängig von der konkreten Schreibweise oder Bezeichnung als Bezugnahme auf EONIA und in jedem erfassten Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte gilt jede Bezugnahme auf den Interbankensatz als Bezugnahme auf EONIA.
- „**EONIA-Einstellungstag**“ der Tag (einschließlich), ab dem der Euro OverNight Index Average nicht mehr vom European Money Market Institute (EMMI) als Administrator des Referenzwertes zur Verfügung gestellt wird. Dies ist voraussichtlich spätestens der 3. Januar 2022.
- „**erfasste Einzelabschlüsse**“ die zwischen den Parteien unter einem erfassten Rahmenvertrag für Finanztermin-

- geschäfte vereinbaren sowie auf sonstige Weise in einen erfassten Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte einbezogenen und in **Anlage 1 Abschnitt A** bezeichneten Einzelabschlüsse, einschließlich der betreffenden Geschäftsbestätigungen sowie die Geschäftsbestätigungen ergänzenden Produktanhänge oder sonstige, die Geschäftsbestätigungen ergänzenden Dokumente (vorbehaltlich der ggf. gemäß Nr. 5 in Verbindung mit Anlage 2 vereinbarten, vorrangig geltenden anderen Benchmark-Regelungen). Sofern nicht anders vereinbart, umfasst dies auch solche Einzelabschlüsse, die nach dem Datum dieser Zusatzvereinbarung oder dem Geltungstag abgeschlossen werden.
- „**erfasste Regelungen**“ die jeweils in **Anlage 1 Abschnitte A, B und C** in Bezug auf einen erfassten Vertrag ausgewählten Regelungen, welche auf EONIA (bzw. €STR oder den empfohlenen EZB-Satz) Bezug nehmen.
 - „**erfasster Besicherungsanhang**“ jeder zwischen den Parteien vereinbarte und in **Anlage 1 Abschnitt A** ausgewählte Besicherungsanhang bzw. Besicherungsanhang für Variation Margin unter einem erfassten Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte. Sofern nicht anders vereinbart, umfasst dies auch solche Besicherungsanhänge bzw. Besicherungsanhänge für Variation Margin, die nach dem Datum dieser Zusatzvereinbarung oder dem Geltungstag abgeschlossen werden.
 - „**erfasster Rahmenvertrag**“ jeder erfasste Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte, jeder erfasste Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehensgeschäfte und jeder erfasste Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte.
 - „**erfasster Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte**“ jeder in **Anlage 1 Abschnitt A** ausgewählte Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte.
 - „**erfasster Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehensgeschäfte**“ jeder in **Anlage 1 Abschnitt B** ausgewählte Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehensgeschäfte, einschließlich der Geschäftsbestätigungen über Einzelabschlüsse unter einem solchen Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehensgeschäfte.
 - „**erfasster Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte**“ jeder in **Anlage 1 Abschnitt C** ausgewählte Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte (Repos).
 - „**erfasster Vertrag**“ jeder erfasste Rahmenvertrag, jeder erfasste Besicherungsanhang und jeder erfasste Einzelabschluss.
 - „**Ersatzreferenzwert**“ der in **Anlage 1** jeweils für erfasste Regelungen vereinbarte Ersatzreferenzwert.
 - „**EU Benchmark-Verordnung**“ die Verordnung (EU) 2016/1011 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 8. Juni 2016 über Indizes, die bei Finanzinstrumenten und Finanzkontrakten als Referenzwert oder zur Messung der Wertentwicklung eines Investmentfonds verwendet werden, und zur Änderung der Richtlinien 2008/48/EG und 2014/17/EU sowie der Verordnung (EU) Nr. 596/2014.
 - „**EZB-Webseite**“ die Webseite der Europäischen Zentralbank mit der Adresse <https://www.ecb.europa.eu/home/html/index.en.html> oder eine andere veröffentlichte Quelle, die von der Europäischen Zentralbank (oder, im Hinblick auf den €STR, einem Nachfolge-Administrator) offiziell benannt wird.
 - „**Geltungstag**“ der in **Anlage 1** jeweils für erfasste Regelungen vereinbarte Tag (einschließlich), ab dem die Wirkungen von Nr. 3 gelten.
 - „**Index-Beendigungsereignis**“ der Eintritt eines oder mehrerer der nachfolgend genannten Ereignisse in Bezug auf €STR oder den empfohlenen EZB-Satz: (i) eine öffentliche Stellungnahme oder die Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen des Administrators des relevanten Satzes, in der mitgeteilt wird, dass der relevante Satz auf unbestimmte Zeit oder dauerhaft nicht mehr bereitgestellt wird oder werden wird, oder (ii) eine öffentliche Stellungnahme oder die Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde des Administrators des relevanten Satzes, die für die Wahrung des relevanten Satzes zuständige Zentralbank, der für den Administrator zuständige Insolvenzverwalter, die für den Administrator zuständige Abwicklungsbehörde oder eine Stelle, die vergleichbare insolvenz- oder abwicklungsbezogene Befugnisse im Hinblick auf den Administrator hat, in der festgestellt wird, dass der Administrator des relevanten Satzes diesen auf unbestimmte Zeit oder dauerhaft nicht mehr bereitstellt oder bereitstellen wird. Die in (i) und (ii) genannten Ereignisse sind jedoch dann keine Index-Beendigungsereignisse, wenn es zum Zeitpunkt der öffentlichen Stellungnahme oder der Veröffentlichung von Informationen einen Nachfolge-Administrator gibt, der den relevanten Satz weiterführen wird.

- „**modifizierter €STR**“ die Summe aus (i) dem Zinssatz des €STR, der vom Administrator veröffentlicht wird und (ii) 0,085%.
- „**modifizierter EDFR**“ im Hinblick auf einen Tag die Summe aus (i) dem Referenzsatz in Höhe des Einlagefazilitäts-Zinssatzes, der im Hinblick auf diesen Tag veröffentlicht wird und (ii) dem EDFR Spread.
- „**TARGET Abwicklungstag**“ jeder Tag, an dem TARGET2 (das *Trans-European Automated Real-time Gross Settlement Express Transfer System*) für die Abwicklung von Zahlungen in Euro geöffnet ist.
- „**Umstellung zum Beginn des Berechnungszeitraums**“ die Umstellungsmethode, nach der für den gesamten betreffenden Berechnungszeitraum anstelle von EONIA der Ersatzreferenzwert maßgeblich ist.
- „**Umstellung zum Beginn des nächsten Berechnungszeitraums**“ die Umstellungsmethode, nach der für den gesamten laufenden Berechnungszeitraum EONIA und für den nächsten Berechnungszeitraum der Ersatzreferenzwert maßgeblich ist.
- „**Umstellung zum Geltungstag**“ die Umstellungsmethode, nach der (i) vom Tag des Beginns des betreffenden Berechnungszeitraums (einschließlich) bis zum Geltungstag (ausschließlich) der EONIA maßgeblich ist und (ii) vom Geltungstag (einschließlich) bis zum Ende des betreffenden Berechnungszeitraums (ausschließlich) der Ersatzreferenzwert maßgeblich ist.
- „**Umstellungsmethode**“ die in **Anlage 1** jeweils für erfasste Regelungen vereinbarte Umstellungsmethode.

(2) Jede Bezugnahme in dieser Zusatzvereinbarung auf eine ihrer Anlagen ist eine Bezugnahme auf die betreffende Anlage in der jeweils gültigen Fassung der betreffenden Anlage.

3. Ersetzung von EONIA durch Ersatzreferenzwert

- (1) Sofern in erfassten Regelungen auf EONIA Bezug genommen wird, gilt diese Bezugnahme ab dem Geltungstag als Bezugnahme auf den Ersatzreferenzwert. Gegebenenfalls zusätzlich zu EONIA vereinbarte Aufschläge (spreads) finden weiterhin Anwendung; dies gilt auch für den Fall, dass modifizierter €STR als Ersatzreferenzwert ausgewählt ist.
- (2) Sofern in Anlage 1 für eine erfasste Regelung „€STR (zuzüglich Ausgleichszahlung)“ als Ersatzreferenzwert vereinbart ist, wird die einmalige Zahlung eines gesondert vereinbarten Ausgleichsbetrags geschuldet. Den Ausgleichsbetrag, die zur Zahlung verpflichtete Partei sowie gegebenenfalls sonstige Modalitäten der Zahlung werden die Parteien gesondert vereinbaren.
- (3) Sofern ein Geltungstag in einen laufenden Berechnungszeitraum einer erfassten Regelung fällt, wird die Berechnung nach der anwendbaren Umstellungsmethode vorgenommen.

4. Ersatzregelung bei Index-Beendigungsereignissen

- (1) Sofern (i) in erfassten Regelungen auf €STR Bezug genommen wird, wobei als Bezugnahme auch eine Ersetzung nach Nr. 3 Abs. 1 gilt, und (ii) ein Index-Beendigungsereignis in Bezug auf €STR eingetreten ist, gilt diese Bezugnahme ab dem Einstellungstag
 - (a) als Bezugnahme auf den empfohlenen EZB-Satz oder
 - (b) falls ein solcher empfohlener EZB-Satz nicht bis zum Ende des auf dieses Index-Beendigungsereignis folgenden TARGET Abwicklungstages empfohlen wird, als Bezugnahme auf den modifizierten EDFR.
- (2) Sofern (i) in erfassten Regelungen auf den empfohlenen EZB-Satz Bezug genommen wird, wobei als Bezugnahme auch eine Ersetzung nach Absatz 1 gilt, und (ii) ein Index-Beendigungsereignis in Bezug auf einen empfohlenen EZB-Satz eingetreten ist, gilt diese Bezugnahme, ab dem Einstellungstag, als Bezugnahme auf den modifizierten EDFR.
- (3) Der nach Absatz 1 oder 2 bestimmte Referenzwert ersetzt für Zwecke der Umrechnung des modifizierten €STR (falls anwendbar) die Berechnungskomponente €STR so, dass der im modifizierten €STR enthaltene Aufschlag (spread) zu dem nach Absatz 1 oder 2 bestimmten Referenzwert hinzuzurechnen ist. Darüber hinaus gegebenenfalls zusätzlich zum jeweiligen Referenzwert vereinbarte Aufschläge (spreads), einschließlich der gegebenenfalls nach Nr. 3 Abs. 1 übernommenen Aufschläge, finden weiterhin Anwendung.
- (4) Sofern der Einstellungstag in einen laufenden Berechnungszeitraum einer erfassten Regelung fällt, ist für den Zeitraum vom Tag des Beginns des betreffenden Berechnungszeitraums (einschließlich) bis zum Einstellungstag (ausschließlich) der nach Absatz 1 oder 2 zu ersetzende Referenzwert maßgeblich und für den Zeitraum vom Einstellungstag (einschließlich) bis zum Ende des betreffenden Berechnungszeitraums der nach Absatz 1 oder 2 bestimmte Referenzwert.

5. Vorrang anderer Benchmark-Regelungen

Sofern in Anlage 2 eine entsprechende Auswahl getroffen wird, gelten für die in dieser Anlage 2 genannten Einzelabschlüsse die dort ausgewählten Regelungen. Sie gehen den Regelungen dieser Zusatzvereinbarung vor.

6. Sonstige Vereinbarungen

MUSTER

7. Verschiedenes

- (1) Sind Bestimmungen dieser Zusatzvereinbarung unwirksam oder undurchführbar, so bleiben die übrigen Vorschriften hiervon unberührt. Gegebenenfalls hierdurch entstehende Vertragslücken werden durch ergänzende Vertragsauslegung unter angemessener Berücksichtigung der Interessen der Parteien geschlossen.
- (2) Diese Zusatzvereinbarung unterliegt dem Recht der Bundesrepublik Deutschland.
- (3) Gerichtsstand ist der unter dem jeweiligen erfassten Vertrag vereinbarte Gerichtsstand.

Unterschrift(en) des Vertragspartners

Unterschrift(en) der Bank

Anlage 1

vom: _____

zur Zusatzvereinbarung für den Übergang von EONIA auf €STR

vom: _____

Soweit bereits eine Anlage 1 zur Zusatzvereinbarung vereinbart worden ist, ersetzt diese Anlage 1 die vorherige Version.

Erfasste Verträge/Erfasste Regelungen

Die Auswahl der Rahmenverträge in den Abschnitten A., B. und C. ersetzt nicht die zusätzlich vorzunehmende Auswahl der erfassten Regelungen in Abschnitt A. 1. bis 3., in Abschnitt B. oder in Abschnitt C.

A. Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte

Sämtliche zwischen den Parteien abgeschlossenen Rahmenverträge für Finanztermingeschäfte, mit Ausnahme des/der folgenden Rahmenverträge für Finanztermingeschäfte:

Muster

1. Erfasste Besicherungsanhänge:

Erfasste Besicherungsanhänge	Erfasste Regelungen	Ersatzreferenzwert	Umstellungsmethode	Geltungstag
<input type="checkbox"/> alle Besicherungsanhänge mit Ausnahme der nachfolgend gegebenenfalls ausgewählten Besicherungsanhänge: <div style="border: 1px solid black; height: 300px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes für Barsicherheiten <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 300px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> €STR (zuzüglich Ausgleichszahlung) <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 300px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des laufenden Berechnungszeitraums <input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des nächsten Berechnungszeitraums	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____, sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.
Anderweitige Vereinbarungen:				
<div style="border: 1px solid black; height: 300px; width: 100%;"></div>				

2. Erfasste Einzelabschlüsse:

Erfasste Einzelabschlüsse	Erfasste Regelungen	Ersatzreferenzwert	Umstellungsmethode	Geltungstag
<input type="checkbox"/> alle Einzelabschlüsse, mit Ausnahme der nachfolgend gegebenenfalls ausgewählten Einzelabschlüsse: <div style="border: 1px solid black; height: 300px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> alle Regelungen <input type="checkbox"/> Regelungen zwecks Bestimmung des Basissatzes/-zinses zur Berechnung variabler Beträge/Sätze <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 280px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 360px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Geltungstag <input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des laufenden Berechnungszeitraums <input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des nächsten Berechnungszeitraums	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____, sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.
<input type="checkbox"/> Zinssatzwapgeschäfte und Zinsbegrenzungsgeschäfte mit Ausnahme der nachfolgend gegebenenfalls ausgewählten Einzelabschlüsse: <div style="border: 1px solid black; height: 300px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> alle Regelungen <input type="checkbox"/> Regelungen zwecks Bestimmung des Basissatzes/-zinses zur Berechnung variabler Beträge/Sätze <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 280px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 360px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Geltungstag <input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des laufenden Berechnungszeitraums <input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des nächsten Berechnungszeitraums	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____, sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.

<input type="checkbox"/> Einzelabschluss <div style="border: 1px solid black; height: 300px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> alle Regelungen <input type="checkbox"/> Regelungen zwecks Bestimmung des Basissatzes/-zinseszinses zur Berechnung variabler Beträge/Sätze <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 200px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 200px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Geltungstag <input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des laufenden Berechnungszeitraums <input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des nächsten Berechnungszeitraums	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____, sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.
--	---	--	--	--

Anderweitige Vereinbarungen:

3. Erfasste Regelungen in erfassten Rahmenverträgen für Finanztermingeschäfte:

Erfasste Regelungen	Ersatzreferenzwert	Umstellungsmethode	Geltungstag
<input type="checkbox"/> alle weiteren Regelungen des Rahmenvertrags mit Bezugnahmen auf EONIA mit Ausnahme von in Besicherungsanhängen oder Einzelabschlüssen enthaltenen Regelungen.	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> €STR <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 300px; width: 100%;"></div>	Umstellung zum Geltungstag	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____ , sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.

Anderweitige Vereinbarungen:

B. Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehensgeschäfte

Sämtliche zwischen den Parteien abgeschlossenen Rahmenverträge für Wertpapierdarlehensgeschäfte, mit Ausnahme des bzw. der folgenden Rahmenverträge für Wertpapierdarlehensgeschäfte:

Erfasste Regelungen in erfassten Rahmenverträgen für Wertpapierdarlehensgeschäfte:

Erfasste Regelungen	Ersatzreferenzwert	Umstellungsmethode	Geltungstag
<input type="checkbox"/> Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes zur Verzinsung des Wertausgleichs	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> €STR (zuzüglich Ausgleichszahlung) <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 200px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des laufenden Berechnungszeitraums <input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des nächsten Berechnungszeitraums	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____, sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.

<input type="checkbox"/> Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes für Verzugszinsen	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> €STR <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Geltungstag <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____ , sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.
<input type="checkbox"/> alle sonstigen Regelungen (mit Ausnahme der Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes zur Verzinsung des Wertausgleichs sowie Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes für Verzugszinsen)	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> €STR <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Geltungstag <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____ , sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.

Anderweitige Vereinbarungen:

Empty rectangular box for additional agreements.

Muster

C. Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte (Repos)

Sämtliche zwischen den Parteien abgeschlossenen Rahmenverträge für Wertpapierpensionsgeschäfte (Repos), mit Ausnahme des bzw. der folgenden Rahmenverträge für Wertpapierpensionsgeschäfte (Repos):

Erfasste Regelungen in erfassten Rahmenverträgen für Wertpapierpensionsgeschäfte:

Erfasste Regelungen	Ersatzreferenzwert	Umstellungsmethode	Geltungstag
<input type="checkbox"/> Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes zur Verzinsung der Barsicherheiten <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> €STR (zuzüglich Ausgleichszahlung) <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des laufenden Berechnungszeitraums <input type="checkbox"/> Umstellung zum Beginn des nächsten Berechnungszeitraums	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____, sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.

<input type="checkbox"/> Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes für Verzugszinsen <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> €STR <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Geltungstag <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____ , sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.
<input type="checkbox"/> Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes für verzinsliche Einlagen <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> €STR <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Geltungstag <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____ , sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.
<input type="checkbox"/> alle sonstigen Regelungen (mit Ausnahme der Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes zur Verzinsung der Barsicherheiten, der Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes für Verzugszinsen sowie der Regelungen zwecks Bestimmung des Zinssatzes für verzinsliche Einlagen) <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> modifizierter €STR <input type="checkbox"/> €STR <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	<input type="checkbox"/> Umstellung zum Geltungstag <input type="checkbox"/> <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>	Der EONIA-Einstellungstag, oder <input type="checkbox"/> _____ , sofern dieser Tag vor dem zuvor genannten Termin liegt.

Anderweitige Vereinbarungen:

Empty rectangular box for additional agreements.

Unterschrift(en) des Vertragspartners

Empty rectangular box for the signature of the contract partner.

Unterschrift(en) der Bank

Empty rectangular box for the signature of the bank.

MUSTER

Anlage 2

vom: _____

zur Zusatzvereinbarung für den Übergang von EONIA auf €STR

vom: _____

Soweit bereits eine Anlage 2 zur Zusatzvereinbarung vereinbart worden ist, ersetzt diese Anlage 2 die vorherige Version.

Vereinbarung des Vorrangs anderer Benchmark-Regelungen gemäß Nr. 5 der Zusatzvereinbarung

ISDA Definitions-Benchmark-Regelungen

„**ISDA Definitions-Benchmark-Regelungen**“ im Sinne dieser **Anlage 2** sind Benchmark-Regelungen in Einzelabschlüssen, die sich auf

- (i) die 2000 ISDA Definitions oder die 2006 ISDA Definitions (jeweils einschließlich der Supplements) oder
- (ii) den 2000 ISDA Definitions oder den 2006 ISDA Definitions (jeweils einschließlich der Supplements) inhaltsgleiche Bestimmungen beziehen.

Sonstige Vereinbarungen in Bezug auf ISDA Definitions-Benchmark-Regelungen:

Sind die 2000 ISDA Definitions oder die 2006 ISDA Definitions mittels eines Einzelabschlusses oder auf sonstige Weise in die Bedingungen eines Einzelabschlusses einbezogen (die „**Einbeziehungsvereinbarung**“), gilt das „Supplement number 60 to the 2006 ISDA Definitions“, wie von der International Swaps and Derivatives Association, Inc. am 1. Oktober 2019 veröffentlicht, als gemäß den Bedingungen der Einbeziehungsvereinbarung zwischen den Parteien vereinbart. Im Hinblick auf Einzelabschlüsse, die die 2000 ISDA Definitions einbeziehen, gilt zusätzlich, dass Bezugnahmen auf „Sections“ oder „Exhibits“ der 2006 ISDA Definitions als Bezugnahmen auf die entsprechenden „Sections“ oder „Exhibits“ der 2000 ISDA Definitions gelten.

Sind die 2000 ISDA Definitions oder 2006 ISDA Definitions mittels eines Einzelabschlusses oder auf sonstige Weise in die Bedingungen eines Einzelabschlusses einbezogen (die „**Einbeziehungsvereinbarung**“), gilt das „Supplement number 60 to the 2006 ISDA Definitions“, wie von der International Swaps and Derivatives Association, Inc. am 1. Oktober 2019 veröffentlicht, als gemäß den Bedingungen der Einbeziehungsvereinbarung zwischen den Parteien mit der Maßgabe vereinbart, dass die jeweilige Definition von „EONIA Index Cessation Effective Date“ wie folgt ersetzt wird:

“EONIA Index Cessation Effective Date” means
[Insert effective date for switch to Modified EuroSTRi].”

Im Hinblick auf Einzelabschlüsse, die die 2000 ISDA Definitions einbeziehen, gilt zusätzlich, dass Bezugnahmen auf „Sections“ oder „Exhibits“ der 2006 ISDA Definitions als Bezugnahmen auf die entsprechenden „Sections“ oder „Exhibits“ der 2000 ISDA Definitions gelten.

Sind die 2000 ISDA Definitions oder 2006 ISDA Definitions mittels eines Einzelabschlusses oder auf sonstige Weise in die Bedingungen eines Einzelabschlusses einbezogen (die „**Einbeziehungsvereinbarung**“), gilt das „Supplement number 59 to the 2006 ISDA Definitions“, wie von der International Swaps and Derivatives Association, Inc. am 1. Oktober 2019 veröffentlicht, als gemäß den Bedingungen der Einbeziehungsvereinbarung zwischen den Parteien vereinbart. Jede Bezugnahme in einem solchen Einzelabschluss auf „EUR-EONIA-OIS-COMPOUND“, „EUR-EONIA-OIS-COMPOUND-Bloomberg“ oder „EUR-EONIA-AVERAGE“ gilt mit dem Beginn des auf den Supplement-59 Geltungstag folgenden Berechnungszeitraum (Calculation Period), als Bezugnahme auf „EUR-EuroSTR-COMPOUND“ wie in „Supplement number 59 to the 2006 ISDA Definitions“ definiert.

Im Hinblick auf Einzelabschlüsse, die die 2000 ISDA Definitions einbeziehen, gilt zusätzlich, dass Bezugnahmen auf „Sections“ der 2006 ISDA Definitions als Bezugnahmen auf die entsprechenden „Sections“ der 2000 ISDA Definitions gelten.

„**Supplement 59-Geltungstag**“ ist der _____.

Weitere Vereinbarungen:

Muster

Unterschrift(en) des Vertragspartners

Unterschrift(en) der Bank