Ergänzungsvereinbarung vom
zur Mantelvereinbarung vom

Ergänzungsvereinbarung für die Besicherung von Finanztermingeschäften im Zusammenhang mit Segmenten (Ergänzungsvereinbarung) zur oben genannten Mantelvereinbarung

zwischen

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

und

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

Bank und Gesellschaft zusammen „die Parteien“

Muster

1. Zweck und Gegenstand der Ergänzungsvereinbarung

(1) Die Ergänzungsvereinbarung findet Anwendung, wenn die Parteien miteinander entweder eine „Mantelvereinbarung für Finanzgeschäfte mit Kapitalverwaltungsgesellschaften“ oder eine „Mantelvereinbarung für Finanzgeschäfte mit luxemburgischen Investmentfonds und Investmentgesellschaften“ (jeweils Mantelvereinbarung) abgeschlossen haben.

(2) Die Parteien beabsichtigen, Derivategeschäfte, die unter dem in der Mantelvereinbarung genannten Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte zwischen den Parteien (der „Rahmenvertrag“) getätigt und in Bezug auf Investmentvermögen, für die einzelne Segmente gebildet wurden, abgeschlossen werden, so zu behandeln, dass bei der laufenden Besicherung dieser Geschäfte unter dem ergänzend zum Rahmenvertrag zwischen den Parteien abgeschlossenen Besicherungsanhang (der „Besicherungsanhang“) und/oder Besicherungsanhang für Variation Margin (der „VM-Besicherungsanhang“, zusammen die „Besicherungsanhänge“) der Bildung von Segmenten Rechnung getragen werden soll. Die unter Nr. 3 dargestellte Berechnungsweise und die Erfüllungsweise der Leistungspflichten aus den Besicherungsanhängen wird vereinbart, weil ein segmentübergreifendes Sicherheitenmanagement dem Zweck der buchhalterischen Unterteilung des Investmentvermögens in Segmente zuwiderlaufen würde. Die buchhalterische Unterteilung des Investmentvermögens in Segmente erfolgt, um die Einschaltung unterschiedlicher Vermögensverwalter bei der Portfolioverwaltung dieser Segmente zu ermöglichen. Um die Leistung dieser Vermögensverwalter richtig einzuschätzen, muss sich die Berechnung der Leistung von Sicherheiten bzw. VM-Sicherheiten gemäß den Bestimmungen der Besicherungsanhänge auf die Segmente des Investmentvermögens beziehen und nicht auf das Investmentvermögen insgesamt.

2. Informationspflichten

(1) Die Gesellschaft und die Bank vereinbaren unter Nennung der entsprechenden notwendigen Angaben (u.a. Namen, Bezeichnungen, wirtschaftliche Größen und Zuordnungen) in Anlage 1 oder in anderer geeigneter Weise auch diejenigen Investmentvermögen („betroffene Investmentvermögen“), für deren Segmente („betroffene Segmente“) eine Besicherung mit modifizierter Erfüllung nach Nr. 3 Anwendung finden soll.

(2) Die Gesellschaft wird der Bank bei Abschluss eines jeden Einzelabschlusses mitteilen, für Rechnung welchen betroffenen Segmentes eines Investmentvermögens sie den Einzelabschluss tätigt. Die Bank wird das betroffene Segment in der Bestätigung des Einzelabschlusses benennen.

3. Modifizierte Erfüllung der Sicherheitsleistung

(1) In Bezug auf ein betroffenes Investmentvermögen gelten die Regelungen des Rahmenvertrags sowie der Besicherungsanhänge. Im Fall einer „Unterdeckung“ gelten die Regelungen nach Nr. 3 des Besicherungsanhangs (Leistung von Sicherheiten) oder nach Nr. 3 des VM-Besicherungsanhangs (VM-Unterdeckung) sowie im Fall einer „Überdeckung“ die Regelungen nach Nr. 4 des Besicherungsanhangs (Überdeckung) oder nach Nr. 4 des VM-Besicherungsanhangs (VM-Überdeckung) mit folgender Maßgabe: Die Erfüllung der sich aufgrund einer „Über- oder Unterdeckung“ ergebenden Ansprüche auf Leistung von Sicherheiten und VM-Sicherheiten erfolgt in Teilleistungen. Die Teilleistungen werden jeweils in Bezug auf das betroffene Segment unter Berücksichtigung der im Rahmenvertrag sowie im jeweiligen Besicherungsanhang festgelegten Berechnungsweisen errechnet und erbracht. Eine Verrechnung zwischen den Segmenten eines Investmentvermögens erfolgt nicht.

(2) Zwischen den Parteien vereinbarte Mindesttransferbeträge (Nr. 5 des Besicherungsanhangs) oder VM-Mindesttransferbeträge (Nr. 5 des VM-Besicherungsanhangs) werden unter Berücksichtigung deren in Anlage 1 vereinbarter Verteilung auf die betroffenen Segmente auf alle Teilleistungen angewandt. Je nach Ergebnis der Berechnungen können die einzelnen Teilleistungen von der einen oder von der anderen Partei zu erbringen sein. Dabei sind die Anforderungen des Art. 25 der Delegierte Verordnung (EU) 2016/2251 der Kommission vom 4. Oktober 2016 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards zu Risikominderungstechniken für nicht durch eine zentrale Gegenpartei geclearte OTC-Derivatekontrakte zu beachten.

(3) Alle Teilleistungen zusammen entsprechen dem insgesamt für das betroffene Investmentvermögen ermittelten Betrag von zu erbringenden oder zu erhaltenden Leistungen von Sicherheiten oder VM-Sicherheiten und den für das jeweilige betroffene Investmentvermögen vereinbarten Mindesttransferbeträgen oder VM-Mindesttransferbeträgen.

© Bank-Verlag GmbH 44.063 (02/17)

4. Einheitlicher Rahmenvertrag für betroffene Investmentvermögen, Beendigung des Rahmenvertrags nach Nr. 7 des Rahmenvertrags

(1) Das Bestehen eines Rahmenvertrags für alle Einzelabschlüsse, die für Rechnung eines betroffenen Investmentvermögens getätigt wurden und werden sowie insbesondere die Bestimmungen von Nr. 7 des Rahmenvertrags werden durch diese Ergänzungsvereinbarung nicht berührt.

(2) Im Fall der Beendigung des Rahmenvertrags erfolgt die Berechnung des nach den Nrn. 8 und 9 des Rahmenvertrags zu zahlenden Betrags auf Grundlage sämtlicher Einzelabschlüsse, die die Parteien in Bezug auf dieses Investmentvermögen einschließlich aller seiner Segmente getätigt haben und unter Berücksichtigung aller Sicherheiten, die in Bezug auf dieses Investmentvermögen einschließlich aller seiner Segmente geleistet wurden.

5. Sonstige Vereinbarungen

Muster

Unterschrift(en) der Gesellschaft	

Unterschrift(en) der Bank	

© Bank-Verlag GmbH 44.063 (02/17)

Hinweis zu Anlage 1 dieses Vordrucks
Die unter Nr. 2 „Informationspflichten“ genannte Anlage 1 zum Vordruck 44.063 stellt der Bank-Verlag als Excel-Sheet zur Verfügung.

Muster