

[Briefkopf]

[Kunde]

[Datum]

**Zinssatzswap – Ref.-Nr.:** [ ]

Wir bestätigen Ihnen folgenden, auf der Grundlage unseres Rahmenvertrages für Finanztermingeschäfte („Rahmenvertrag“) getätigten Einzelabschluss:

Rahmenvertragsdatum: [ ]

Abschlussdatum: [ ]

Anfangsdatum: [ ]

Enddatum: [ ], [vorbehaltlich einer Anpassung entsprechend Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages] [ohne Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 des Rahmenvertrages]<sup>1</sup>

Vertragswährung: [ ] [EUR]

Bezugsbetrag: [ ]

Zahlungspflichten: Vorbehaltlich einer Aufrechnung nach Nr. 3 Abs. 3 des Rahmenvertrages zahlt – jeweils an die andere Partei -

- der Zahler der Festbeträge an jedem Fälligkeitstag für Festbeträge den entsprechenden Festbetrag
- der Zahler der variablen Beträge an jedem Fälligkeitstag für variable Beträge den entsprechenden variablen Betrag
- [Falls der variable Satz negativ ist,

<sup>1</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages erfolgen soll.

zahlt der Zahler der Festbeträge an dem betreffenden Fälligkeitstag für variable Beträge zusätzlich den als absoluten Betrag ausgedrückten variablen Betrag an den Zahler der variablen Beträge.]<sup>2</sup>  
 [Falls der variable Satz negativ oder null ist, zahlt keine der Parteien den variablen Betrag.]<sup>3</sup>

Regelungen betreffend Festbeträge:

Zahler der Festbeträge: [ ]

[Festbeträge:]<sup>4</sup> [ ] je Zahlungstermin [, jedoch für den [ersten] [letzten] Berechnungszeitraum [ ]

[Festsatz:]<sup>5</sup> [[ ]% p. a.]

[Quotient:]<sup>6</sup> [ ]

Fälligkeitstage für Festbeträge: Jeweils der [ ] vom [ ] bis zum [ ] [, vorbehaltlich einer Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages.]<sup>7</sup>

Bankarbeitstag: [Finanzplatz: [ ]] [TARGET-Tag]

["TARGET-Tag" ist (a) für Zahlungen, jeder Tag, an dem alle für die Durchführung einer solchen Zahlung relevanten Teile des Trans-European Automated Real-time Gross Settlement Express Transfer (TARGET) System in Betrieb sind, und (b) für sonstige Zwecke jeder Tag, an dem das TARGET System geöffnet ist.]<sup>8</sup>

Regelungen betreffend variable Beträge:

Zahler der variablen Beträge: [ ]

Variabler Satz: Basis-Satz plus Spread

---

<sup>2</sup> Entspricht „Negative Interest Rate Method“ (Section 6.4 2000 ISDA Definitions, Seite 12).  
<sup>3</sup> Entspricht „Zero Interest Rate Method“ (Section 6.4 2000 ISDA Definitions, Seite 12).  
<sup>4</sup> Nur erforderlich, wenn Festbetrag vereinbart.  
<sup>5</sup> Nur erforderlich, wenn kein Festbetrag vereinbart.  
<sup>6</sup> Nur erforderlich, wenn kein Festbetrag vereinbart.  
<sup>7</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages erfolgen soll.  
<sup>8</sup> Nur erforderlich, wenn TARGET-Tag vereinbart.

Spread:	[minus] [ ]% p. a.
Basis-Satz:	[ ] [[ ]-Monats-EURIBOR]
Bestimmung des Basis-Satzes:	[ ] [[ ]-Monats-EURIBOR] ist der Satz für [ ]-Monatsgelder in [der Vertragswährung] [ ] gemäß Bildschirm-Veröffentlichung des [Dow Jones Telerate-Informationsdienstes (Bridge Telerate Seite 248)] [ ] für den Zeitpunkt [11.00 Uhr in Brüssel] [ ] am [zweiten] [ ] [TARGET-Tag] [ ] vor dem Beginn des jeweiligen Berechnungszeitraums ("Feststellungstag").]
[Variabler Satz für den ersten Berechnungszeitraum:]	[[ ]% p. a.]
[Variabler Betrag für den ersten Berechnungszeitraum:]	[Währung, Betrag] <sup>9</sup>
Rundungen:	Der Basis-Satz ist gegebenenfalls kaufmännisch auf den nächsten [1/1.000] [1/10.000] [1/100.000] Prozentpunkt auf- oder abzurunden.
Fälligkeitstage für variable Beträge:	Jeweils der [ ] vom [ ] bis zum [ ] [ , vorbehaltlich einer Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages] <sup>10</sup>
Quotient:	[ ]
[Berechnungszeitraum für variable Beträge:] <sup>11</sup>	[Fälligkeitstag/Fälligkeitstag]
Bankarbeitstag:	[Finanzplatz: [ ]] [Finanzplatz: [ ] , jedoch für die Bestimmung des Basis-Satzes: [TARGET-Tag] [Finanzplatz: [ ]] [TARGET-Tag] [TARGET-Tag, abweichend hiervon jedoch für die Bestimmung des Basis-Satzes: [Finanzplatz: [ ]]
	["TARGET-Tag" ist (a) für Zahlungen,

<sup>9</sup> Nur anwendbar unter der Voraussetzung, dass die Fälligkeitstage nicht angepasst sind.

<sup>10</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages ("modifiziert") erfolgen soll.

<sup>11</sup> Nur erforderlich, wenn abweichend von Nr. 6 Abs. 6 Satz 1 DRV "Fälligkeitstag/Fälligkeitstag" gewünscht ist.

jeder Tag, an dem alle für die Durchführung einer solchen Zahlung relevanten Teile des Trans-European Automated Real-time Gross Settlement Express Transfer (TARGET) System in Betrieb sind, und (b) für sonstige Zwecke jeder Tag, an dem das TARGET System geöffnet ist.]<sup>12</sup>

Anpassungen nach Nr. 3 Abs. 5 des Rahmenvertrages:

Soweit vorstehend keine abweichende Vereinbarung getroffen wird, erfolgen Anpassungen der Fälligkeitstage und des Enddatums nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages.

Ihr Konto:

[ ]

Unser Konto:

[ ]

Makler:

[ ]

Besondere Vereinbarungen:

[ ] [Keine]

Diese Bestätigung erhalten Sie als Telefax [und in Briefform]<sup>13</sup>. Falls Sie bei deren Prüfung Abweichungen von den vereinbarten Bestimmungen des Einzelabschlusses feststellen, bitten wir Sie, uns unverzüglich zu benachrichtigen.

Die Richtigkeit der vorstehenden Angaben erklären Sie bitte durch Gegenzeichnung und Rücksendung dieser Bestätigung.

Mit freundlichen Grüßen  
[Bank]

\_\_\_\_\_  
[Unterschrift]

\_\_\_\_\_  
[Unterschrift]

Gegenbestätigt:  
[Vertragspartner]

\_\_\_\_\_  
[Ort, Datum]

<sup>12</sup> Nur erforderlich, wenn TARGET-Tag vereinbart.

<sup>13</sup> Nur erforderlich, wenn die andere Partei nach Nr. 2 Abs. 2 eine unterzeichnete Ausfertigung des Einzelabschlusses verlangt.

---

[Unterschrift]

---

[Unterschrift]