

[Briefkopf]

[Kunde]

[Datum]

**Zinssatz- und Währungsswap [fest/variabel] – 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>

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 [ ]
- der Zahler der Festbeträge am Anfangsdatum den Bezugsbetrag für variable Beträge

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

- der Zahler der variablen Beträge am Anfangsdatum den Bezugsbetrag für Festbeträge]<sup>2</sup> [
- der Zahler der Festbeträge am Enddatum den Bezugsbetrag für Festbeträge
- der Zahler der variablen Beträge am Enddatum den Bezugsbetrag für variable Beträge]<sup>3</sup>
- [Falls der variable Satz negativ ist, 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>4</sup>
- [Falls der variable Satz negativ oder null ist, zahlt keine der Parteien den variablen Betrag.]<sup>5</sup>

Regelungen betreffend Festbeträge:

Zahler der Festbeträge:	[ ]
Bezugsbetrag der Festbeträge:	[ ]
Währung der Festbeträge:	[ ] [EUR]
[Festbeträge:] <sup>6</sup>	[ ] je Zahlungstermin [, jedoch für den [ersten] [letzten] Berechnungszeitraum [ ]]
[Festsatz:] <sup>7</sup>	[[ ]% p. a.]
[Quotient:] <sup>8</sup>	[ ]
Fälligkeitstage für Festbeträge:	Jeweils der [ ] vom [ ] bis zum [ ] [, vorbehaltlich einer Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages.] <sup>9</sup>

<sup>2</sup> Nur erforderlich, wenn "Anfangstausch" erfolgen soll.

<sup>3</sup> Nur erforderlich, wenn "Schlusstausch" erfolgen soll.

<sup>4</sup> Diese Lösung beinhaltet die "Negative Interest Rate Method" (Section 6.4 2000 ISDA Definitions, Seite 12).

<sup>5</sup> Diese Lösung beinhaltet die "Zero Interest Rate Method" (Section 6.4 2000 ISDA Definitions, Seite 12).

<sup>6</sup> Nur erforderlich, wenn Festbetrag nicht berechnet werden soll.

<sup>7</sup> Nur erforderlich, wenn kein Festbetrag vereinbart.

<sup>8</sup> Nur erforderlich, wenn kein Festbetrag vereinbart.

<sup>9</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages erfolgen soll.

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>10</sup>

Regelungen betreffend variable Beträge:

Zahler der variablen Beträge: [ ]

Bezugsbetrag der variablen Beträge: [ ]

Währung der variablen Beträge: [ ] [EUR]

Variabler Satz: Basis-Satz plus Spread

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>11</sup>

Rundungen: Der Basis-Satz ist gegebenenfalls kaufmännisch auf den nächsten [1/1.000] [1/10.000] [1/100.000] Prozentpunkt auf-

<sup>10</sup> Nur erforderlich, wenn TARGET-Tag vereinbart.

<sup>11</sup> Nur anwendbar unter der Voraussetzung, dass die Fälligkeitstage nicht angepasst sind.

oder abzurunden.

Fälligkeitstage für variable Beträge: Jeweils der [ ] vom [ ] bis zum [ ]  
[, vorbehaltlich einer Anpassung nach  
Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des  
Rahmenvertrages]<sup>12</sup>

Quotient: [ ]

[Berechnungszeitraum für variable  
Beträge:]<sup>13</sup> [Fälligkeitstag/Fälligkeitstag]

Bankarbeitstag: [Finanzplatz: [ ]]  
[Finanzplatz: [ ], jedoch für die  
Bestimmung des Basis-Satzes:  
[TARGET-Tag] [Finanzplatz: [ ]]  
[TARGET-Tag]  
[TARGET-Tag, jedoch für die  
Bestimmung des Basis-Satzes:  
[Finanzplatz: [ ]]

[„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>14</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 für Zahlungen in [ ]: [ ]

Ihr Konto für Zahlungen in [ ]: [ ]

Unser Konto für Zahlungen in [ ]: [ ]

Unser Konto für Zahlungen in [ ]: [ ]

Makler: [ ]

<sup>12</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages (“modifiziert”) erfolgen soll.

<sup>13</sup> Nur wenn abweichend von Nr. 6 Abs. 6 Satz 1 DRV “Fälligkeitstag/Fälligkeitstag” gewünscht ist.

<sup>14</sup> Nur erforderlich, wenn TARGET-Tag vereinbart.

Besondere Vereinbarungen:  [Keine]

Diese Bestätigung erhalten Sie als Telefax [und in Briefform]<sup>15</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]

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

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

<sup>15</sup> Nur erforderlich, wenn die andere Partei nach Nr. 2 Abs. 2 eine unterzeichnete Ausfertigung des Einzelabschlusses verlangt.