

CFTC-SELBSTAUSKUNFT FÜR SWAPS

Die Regeln für CFTC Swaps sind komplex. Wenn Sie Zweifel oder Rückfragen in Bezug auf diese Regeln haben und/oder wie diese Selbstauskunft ausgefüllt werden soll, sollten Sie unabhängigen Rat einholen, da die BNP Paribas Ihnen keine derartigen Ratschläge erteilen darf. DAB BNP Paribas erhebt von Ihnen Informationen, um die Anforderungen für Transaktionen in Swaps mit dem von Ihnen vertretenen Unternehmen (dem benannten Unternehmen) zu ermitteln. Diese Aktivitäten können den US-Regulierungsanforderungen gemäß dem „Dodd-Frank Wall Street Reform and Consumer Protection Act“ unterliegen.

Der Vertretungsberechtigte nimmt die Erklärungen in jedem der zutreffenden Teile dieser Selbstauskunft vor. Diese Erklärung soll DAB BNP Paribas die benötigten Statusinformationen liefern, um die Anwendung der regulatorischen Anforderungen bezüglich „U.S Swap Dealer“ zu bestimmen. Die in diesem Schreiben enthaltenen Angaben dienen ausschließlich dieser Bestimmung.

(Fett geschriebene Begriffe, welche in dem Schreiben verwendet werden, werden im Anhang 1 erklärt.)

Von (Kunde):

Name:

Adresse:

Kontonummer bei DAB BNP Paribas:

An:

DAB BNP Paribas
Kontoservice
Landsberger Str. 300
80687 München

Präambel:

Der Kunde erklärt hiermit, dass er eine Nicht-US-Person ist und dass sie keine Verbindung zu den USA hat, gleich, ob Buchhaltungs-, Rechts- und/oder Finanzwesen im Sinne der CFTC 2013 Cross-Border Guidance und/oder der CFTC Cross-Border 2020 Rules,

UND der Kunde verpflichtet sich, DAB BNP Paribas rechtzeitig schriftlich vor Abschluß eines Swaps zu benachrichtigen, wenn sich die Umstände, die seine Verbindung zu den USA betreffen, ändern.

Die in dieser Selbstauskunft enthaltene Darstellung gilt als jedes Mal wiederholt, wenn wir einen Swap mit dem Kunden eingehen, es sei denn, wir haben Ihnen vor der Aufnahme eines Swap rechtzeitig schriftlich das Gegenteil mitgeteilt.



Ausgefüllt und bestätigt am:

Datum:

Vollständiger Name der Firma/Juristischen Person:

.....

Unterschrift

Name des Unterzeichners:

.....

Unterschrift

Name des Unterzeichners:

Hat das Unternehmen nicht die oben genannte Präambel unterzeichnet, so hat es die Erklärungen in jedem einzelnen der nachstehenden Teile der Selbstauskunft abzugeben.

I. U.S. Person

➤ **Anleitung :**

Bitte wählen Sie ein Feld in I. (A) U.S. Person - CFTC Cross-Border 2020 Rules **UND** ein Feld in I. (B) U.S. Person - CFTC 2013 Cross-Border Guidance aus.

(A) U.S. Person - CFTC Cross-Border 2020 Rules

Wir bestätigen hiermit, dass:

- die genannte Einheit in keine Kategorie der U.S. Person - CFTC 2020 Rules fällt.
- die genannte Einheit in eine oder mehr Kategorien der U.S. Person - CFTC 2020 Rules fällt.

(B) U.S. Person - CFTC 2013 Cross-Border Guidance

Wir bestätigen hiermit, dass:

- die genannte Einheit in keine Kategorie der U.S. Person - CFTC 2013 Guidance fällt.
- die genannte Einheit in eine oder mehr Kategorien der U.S. Person CFTC 2013 Guidance fällt.

➤ **Anleitung :**

- Falls Sie das erste Feld unter I. (A) U.S. Person – CFTC 2020 Rules ausgewählt haben, bitte wählen sie ein Feld aus in II. (B) Swaps booked through a US Branch of Non-US Banking Organization **UND** ein Feld in II. (C) (1) U.S. Guaranteed - CFTC 2020 Rules aus.
- Falls Sie das erste Feld unter I. (B) U.S. Person – CFTC 2013 Guidance ausgewählt haben, wählen Sie bitte ein Feld in II. (A) U.S. Affiliate Conduit – CFTC 2013 Guidance **UND** eines in (B) Swaps booked through a US Branch of Non-US Banking Organization **UND** ein Feld in II. (C) (1) U.S. Guaranteed - CFTC 2020 Rules **UND** ein Feld in II (B) (2) U.S. Guaranteed – CFTC 2013 Rules, thereunder aus.
- Falls Sie das zweite Feld in I". (A) U.S. Person – CFTC 2020 Rules und I. (B) U.S. Person – CFTC 2013 Guidance ausgewählt haben, müssen sie die folgenden Punkte nicht beantworten.



II. Non U.S. Person

(A) U.S. Affiliate Conduit – CFTC 2013 Cross-Border Guidance

Wir bestätigen hiermit, dass:

- die genannte Einheit ist kein „U.S. Affiliate Conduit“ – CFTC 2013 Guidance.
- die genannte Einheit ist ein „U.S. Affiliate Conduit“ – CFTC 2013 Guidance.

(B) US Zweigstelle einer Nicht-US Bankorganisation - CFTC Cross – Border 2020 Rules

Wir bestätigen hiermit, dass:

- die genannte Einheit keine „Swaps“ über eine US Zweigstelle einer Nicht-US Bankorganisation, zu welcher die genannte Einheit gehört, bucht - CFTC 2020 Rules.
- die genannte Einheit einige oder alle “Swaps” über eine US Zweigstelle einer Nicht-US Bankorganisation, zu welcher die genannte Einheit gehört, bucht - CFTC 2020 Rules.

(C) U.S. Guaranteed

(1) U.S. Guaranteed - CFTC 2020 Cross-Border Rules

Wir bestätigen hiermit, dass:

- die genannte Einheit ist keine „U.S. Guaranteed“ - CFTC 2020 Rules.
- die genannte Einheit ist eine „U.S. Guaranteed“ - CFTC 2020 Rules.

(2) U.S. Guaranteed – CFTC 2013 Cross-Border Guidance

Wir bestätigen hiermit, dass:

- die genannte Einheit ist keine „U.S. Guaranteed“ – CFTC 2013 Guidance.
- die genannte Einheit ist eine „U.S. Guaranteed“– CFTC 2013 Guidance.

➤ **Anleitung :**

- Falls Sie das zweite Feld in II. (C) (1) U.S. Guaranteed - CFTC 2020 Rules **UND/ODER** das zweite Feld in II. (C) (2) U.S. Guaranteed – CFTC 2013 Guidance ausgewählt haben, wählen Sie bitte ein Feld in II. (D) Garantie eines oder mehrerer U.S. Finanzinstitute aus.
- Falls Sie das erste Feld in II. (C) (1) U.S. Guaranteed - CFTC 2020 Rules **UND/ODER** das erste Feld in II. (C) (2) U.S. Guaranteed – CFTC 2013 Guidance ausgewählt haben, wählen Sie bitte ein Feld in II. (F) Significant Risk Subsidiary aus.
- Falls Sie das zweite Feld in II. (A) U.S. Affiliate Conduit – CFTC 2013 Cross-Border Guidance ausgewählt haben, wählen Sie bitte ein Feld in II (E) II. Swap Dealer Affiliate **AND** one box in (F) Significant Risk Subsidiary aus.
- Falls Sie das zweite Feld in II. (B) US Branch of non-US Banking Organization - CFTC Cross – Border 2020 Rules ausgewählt haben, müssen Sie die folgenden Punkte nicht beantworten



(D) Garantie eines oder mehrerer U.S. Finanzinstitute

Es sei denn, wir haben Ihnen vor der Aufnahme eines Swap rechtzeitig schriftlich das Gegenteil mitgeteilt, bestätigen wir hiermit, dass:

- Keine finanzielle Einheit, bei welcher es sich um eine U.S. Person – CFTC 2020 Rules handelt, eine Garantie zur Unterstützung der Verpflichtungen im Zusammenhang mit dem betreffenden Swap liefert.
- Eine oder mehrere finanzielle Einheiten, bei welcher es sich um eine U.S. Person – CFTC 2020 Rules handelt, eine Garantie zur Unterstützung der Verpflichtungen im Zusammenhang mit dem betreffenden Swap liefert.

➤ **Anleitung :**

Falls Sie das zweite Feld in in II. (D) Garantie eines oder mehrerer U.S. Finanzinstitute ausgewählt haben, wählen Sie bitte ein Feld in II. (E) Swap Dealer Affiliate thereunder.

(E) Swap Dealer Affiliate

Wir bestätigen hiermit, dass:

- die genannte Einheit ist kein "Swap Dealer Affiliate" und betätigt sich nicht in Swaps unterhalb der „SD De Minimis“ - Schwelle.
- Die genannte Einheit ist ein "Swap Dealer Affiliate" und betätigt sich in Swaps unterhalb der „SD De Minimis“ - Schwelle.

(F) Significant Risk Subsidiary

Wir bestätigen hiermit, dass:

- Die genannte Einheit ist kein "Significant Risk Subsidiary".
- Die genannte Einheit ist ein "Significant Risk Subsidiary".

Alle oben genannten Darstellungen in diesem Representation Letter gelten als wiederholt gültig, wenn wir einen Swap mit der benannten Einheit eingehen, es sei denn, wir haben Sie rechtzeitig schriftlich vor der Aufnahme eines Swap vom Gegenteil benachrichtigt.

Ausgefüllt und bestätigt am:

Datum:

Vollständiger Name der Firma/der Juristischen Person:

.....

Unterschrift

Name des Unterzeichners:

.....

Unterschrift

Name des Unterzeichners:



ANHANG 1 an das CFTC-SELBSTAUSKUNFT FÜR SWAPS - DEFINITIONEN -

« **CFTC** »: „Commodity Futures Exchange Commission“ der Vereinigten Staaten von Amerika.

« **CFTC 2013 Guidance** » oder „**CFTC 2013 Cross-Border Guidance**“: die « *Interpretative Guidance and Policy Statement Regarding Compliance With Certain Swap Regulations* » (78 Fed. Reg. 45292 (26. Juli 2013)).

« **CFTC 2020 Rules** » oder „**CFTC 2020 Cross-Border Rules**“ : die angepasste CFTC-Regel: « *Cross-Border Application of the Registration Thresholds and Certain Requirements Applicable to Swap Dealers and Major Swap Participants* » (85 Fed. Reg. 56924 (14. September 2020)).

« **CFTC Swaps Rules** »: die regelmäßig von der CFTC erlassenen oder angepassten Vorschriften, Verordnungen, Beschlüsse und Auslegungen, welche für Swaps gelten und unter „Title VII“ der „Dodd-Frank Wall Street Reform“ sowie dem „Consumer Protection Act“ verkündet werden, oder von der CFTC anderweitig der CFTC 2013 Guidance unterstellt werden.

« **Non U.S. Person** »: eine Person welche weder eine *U.S. Person – CFTC 2013 Guidance*, noch ein *U.S. Person – CFTC 2020 Rules* ist.

«**United-States** » oder „**U.S.**“: die Vereinigten Staaten von Amerika inklusive aller zugehöriger Gebiete, bzw. Enklaven welche unter US-Regierung stehen

« **Significant Risk Subsidiary** »: ein Tochterunternehmen, welche eine *Non U.S. Person* ist und welche direkt oder indirekt von einer *U.S. Person* kontrolliert wird und folgende Kriterien erfüllt:

- i) Der Dreijahresdurchschnitt des Eigenkapitals des Tochterunternehmens beträgt mindestens fünf Prozent des Dreijahresdurchschnitts des konsolidierten Eigenkapitals des obersten US-Mutterunternehmens (gemäß den US-GAAP) zum Ende des zuletzt abgeschlossenen Geschäftsjahres; oder
- ii) Der Dreijahresdurchschnitt des Gesamtumsatzes des Tochterunternehmens ist gleich oder größer als zehn Prozent des Dreijahresdurchschnitts des gesamten Konzernumsatzes des obersten US-Mutterunternehmens (gemäß den US-GAAP); oder
- iii) Der Dreijahresdurchschnitt des Gesamtvermögens des Tochterunternehmens beträgt mindestens zehn Prozent des gleitenden Dreijahresdurchschnitts des gesamten konsolidierten Gesamtvermögens des US-Mutterunternehmens (gemäß den US-GAAP) zum Ende des zuletzt abgeschlossenen Geschäftsjahres;

UND

- (x) Das ultimative US-Mutterunternehmen verfügt über 50 Milliarden US-Dollar an globalen konsolidierten Vermögenswerten, wie sie nach den US-GAAP am Ende des zuletzt abgeschlossenen Geschäftsjahres ermittelt wurden; und
- (y) Die Non-U.S. Person unterliegt keiner:
 - a) konsolidierten Beaufsichtigung und Regulierung durch ein Federal Reserve Board als Tochtergesellschaft einer US-Bankholdinggesellschaft oder einer Zwischenholdinggesellschaft; oder
 - b) sowohl (i) Kapitalstandards als auch Kontrolle durch die Aufsichtsbehörde des Herkunftslandes der Non-U.S. Person stehen im Einklang mit dem Basler Ausschuss für Bankenaufsicht „International Regulatory Framework for Banks“ („Basel III“) als auch (ii) Margenanforderungen für nicht geclearte Swaps in einer rechtlichen Zuständigkeit, die die



Kommission gemäß einer veröffentlichten Vergleichbarkeitsprüfung in Bezug auf nicht ungeclearte Swap-Einschussanforderungen für vergleichbar befunden hat

« **Swap** »: Vorbehaltlich bestimmter Ausnahmen sind Derivate auf Währungen, Zins- und Leitzinsen, ausgenommen "Securities" (wie z.B. US-Staatsanleihen, nicht aber kommunale Wertpapiere und bestimmte ausländische Staatspapiere), allgemeine „Security“-Indizes und nichtfinanzielle commodities (wie Metalle, Energie, landwirtschaftliche und umweltbezogene Rohstoffe). Alle Produkte welchen eine "Security", ein eng gefasster Aktienindex oder ein Einzeldarlehen zugrunde liegt, könnten ebenfalls Swaps sein. *Siehe die US-Regulierungsdefinition, eingefügt in Paragraph 1a(47) des „Commodity Exchange Act“.*

« **Swap Dealer** » oder « **SD** »: jegliche Person, welche (i) sich als Händler von Swaps (ii) einen Markt für Swaps bietet; oder (iii) regelmäßig mit Swaps und anderen Parteien interagiert als Teil des gewöhnlichen Geschäfts; oder (iv) Tätigkeiten ausübt, welche die Person als Händler oder Market Maker im Bereich Swaps bekannt macht. *Siehe die US-Regulierungsdefinition, eingefügt in Paragraph 1a(49) des „Commodity Exchange Act“.*

« **SD De Minimis Threshold** »: der aggregierte Bruttonennwert von Swaps im Zusammenhang mit Swap-Geschäften, unterhalb dessen eine Person, die derzeit nicht als Swap-Händler bei der CFTC registriert ist, gemäß CFTC-Regeln nicht als Swap-Händler gilt.

« **Swap Dealer Affiliate** »: jede Person, welche direkt oder indirekt von einem Swap Händler kontrolliert wird, bzw. mit einem Swap-Händler unter gemeinsamer Kontrolle steht.

« **US Branch of Non-US Banking Organization – CFTC 2020 Rules** »: jede Zweigniederlassung bzw. jeder Standort, einer nicht in den Vereinigten Staaten registrierte Bank, wenn diese (i) in den Vereinigten Staaten ansässig ist, (ii) Konten unterhält unabhängig von der Hauptverwaltung und von anderen US-Zweigniederlassungen, wobei der Gewinn oder Verlust, welcher in jeder Zweigstelle angefallen ist, für jede US-Zweigniederlassung als gesonderter Posten bestimmt wird, und (iii) im Bankgeschäft handelt und dadurch US-Bankenregulierungen im ansässigen Staat oder Bezirk unterliegt.

« **U.S. Conduit Affiliate – CFTC 2013 Guidance** »:

- i) jede Non U.S. Person welche ein mehrheitlich geführtes Unternehmen einer U.S. Person ist; oder
- ii) jede Non U.S. Person welche eine U.S. Person kontrolliert, von dieser kontrolliert wird, oder unter gemeinsamer Kontrolle liegt; oder
- iii) jede Non U.S. Person, dessen Finanzergebnisse im Konzernabschluss einer U.S. Person aufgenommen werden;

UND

- (iv) jede Non U.S. Person welche, im regulären Geschäft, (i) in Swaps mit einer non-U.S. Drittpartei einsteigt, mit dem Ziel entstehende Risiken zu hedgen oder zu mindern, oder (ii) nimmt eine Position ein im Namen eines U.S. Person Affiliate und verrechnet Swaps und andere Vereinbarungen mit der U.S. Person Affiliate um die Risiken und Erträge solcher Swaps an Drittparteien der U.S. Person Affiliate zu übertragen.

« **U.S. Guaranteed –CFTC 2013 Guidance** »: jegliche Gegenpartei einer Non U.S. Person welche in entsprechender Verbindung steht, und wessen Swap Pflichten von einer U.S. Person sichergestellt werden. Dies schließt generell jede Zustimmung oder Vereinbarung unter welcher eine Partei sich bereiterklärt finanzielle Absicherungen, bzw. Finanzierung gegen mögliche Verluste zu übernehmen

« **U.S. Guaranteed – CFTC 2020 Rules** »: jegliche Non U.S. Person, welche von einer U.S. Person die Garantie erhält, auf Grundlage einer Vereinbarung, nach der die andere an einem Swap beteiligte



Partei Rückgriffsrechte gegen einen Bürgen/Garantiegeber hat, in Bezug auf die Verpflichtungen der Non U.S. Person aus dem Swap. Zu diesem Zwecke hat eine an einem Swap beteiligte Partei Rückgriffsrechte gegen einen Bürgen, wenn die Partei ein bedingtes oder bedingungsloses, rechtlich durchsetzbares Recht hat, Zahlungen des Bürgen ganz oder teilweise in Bezug auf die Verpflichtungen ihrer Gegenpartei aus dem Swap zu empfangen oder entgegenzunehmen. Zusätzlich, im Falle einer Vereinbarung, nach der der Bürge ein bedingtes oder bedingungsloses, rechtlich durchsetzbares Recht hat, Zahlungen von einem anderen Bürgen ganz oder teilweise in Bezug auf die Verpflichtungen des Geschäftspartners aus dem Swap entgegenzunehmen oder auf andere Weise entgegenzunehmen, gilt diese Vereinbarung als Garantie für die Verpflichtungen des Geschäftspartners aus dem Swap durch den anderen Bürgen.

« U.S. Person – CFTC 2013 Guidance »:

- (i) jede natürliche Person mit festem Wohnsitz in den Vereinigten Staaten, oder
- (ii) jeder Nachlass eines Verstorbenen, welcher zum Zeitpunkt des Todes in den USA ansässig war; oder
- (iii) jede Firma, Partnerschaft, GmbH, Geschäfts- oder sonstige Trust-, Vereins-, Aktiengesellschaften, Fonds- oder Unternehmensformen, die mit einem der vorgenannten Unternehmen vergleichbar sind (abweichend von den unter (iv) oder (v) beschriebenen Einrichtungen) (eine "juristische Person"), welche in jedem Fall organisiert unter den Gesetzen eines Staates oder einer anderen Gerichtsbarkeit in den Vereinigten Staaten organisiert, bzw. integriert ist, oder seinen Hauptgeschäftssitz in den USA hat.; oder
- (iv) alle Pensionspläne für Arbeitnehmer, Beamte oder Leiter einer juristischen Person, es sei denn, der Pensionsplan ist in erster Linie für ausländische Arbeitnehmer dieser Einrichtung bestimmt, oder
- (v) Jede Konzerngesellschaft, welche den Gesetzen eines Staates oder einer anderen Gerichtsbarkeit in den USA unterliegt, wenn ein Gericht in den USA in der Lage ist, die primäre Aufsicht über die Verwaltung des Trustes auszuüben, oder
- (vi) Jeder Commodity Pool, Pooled Account, Investment-Anlageform oder jedes andere Instrument für gemeinsame Anlagen, welches nicht in (iii) beschrieben ist, und welches mehrheitlich im Eigentum einer in (i), (ii), (iii), (iv), or (v) beschriebenen Einheit ist, mit Ausnahme eines Commodity Pool, Pooled Account, oder Investment-Fond, oder jedes anderen Instruments für gemeinsame Anlagen, welches ausschließlich Non U.S. Einheiten und Non U.S. Persons angeboten wird; oder
- (vii) jegliche juristische Einheit (mit Ausnahme einer GmbH, KG, oder ein ähnliches Unternehmen, bei dem alle Eigentümer des Unternehmens über eine beschränkte Haftung verfügen) die direkt oder indirekt im Eigentum einer oder mehrerer Personen stehen, beschrieben in (i), (ii), (iii), (iv), oder (v) und in welchen solche Personen eine unbegrenzte Verantwortung für Pflichten und Schulden der juristischen Einheit haben; oder
- (viii) ein individuelles oder gemeinsames Konto (willkürlich oder nicht-willkürlich) bei dem der wirtschaftliche Eigentümer (oder einer der wirtschaftlichen Eigentümer im Falle eines gemeinsamen Kontos) eine „Person“ ist wie beschrieben in (i), (ii), (iii), (iv), (v), (vi), oder (vii).

« U.S. Person - CFTC 2020 Rules »:

- (i) jede natürliche Person mit festem Wohnsitz in den Vereinigten Staaten; oder
- (ii) Jede Partnerschaft, Firma, Trust, Investmentorganisation, oder andere juristische Organisation, eingebaut, oder etabliert unter den Gesetzen der Vereinigten Staaten oder mit Hauptsitz in den Vereinigten Staaten; oder
- (iii) jegliches Konto (diskretionär oder nicht) einer U.S. Person; oder
- (iv) jeder Erbe eines verstorbenen Erblassers, der zum Zeitpunkt des Todes in den Vereinigten Staaten ansässig war.

