

Ergänzende Definitionen zu Zinsderivaten, Referenzzinssätzen und EONIA

zu einem von der Schweizerischen Bankiervereinigung veröffentlichten Schweizer Rahmenvertrag für OTC-Derivate (2003 und 2013)

Diese ergänzenden Definitionen zu Zinsderivaten, Referenzzinssätzen und EONIA gelten für alle Transaktionen, die unter Bezugnahme auf Zinssätze abgeschlossen werden, sofern die Parteien in den Transaktionsunterlagen auf die Bestimmungen dieser ergänzenden Definitionen verweisen oder anderweitig vereinbart haben, diese ergänzenden Definitionen auf die betreffende Transaktion oder gegebenenfalls einen Rahmenvertrag oder ein Sicherungsdokument anzuwenden. Sofern nichts anderes vereinbart ist, gilt der in den jeweiligen Transaktionsunterlagen enthaltene Verweis auf in diesen ergänzenden Definitionen definierter Begriff als Verweis auf die zum Zeitpunkt des Verweises durch die Schweizerische Bankiervereinigung zuletzt veröffentlichte Version der ergänzenden Definitionen. Diese ergänzenden Definitionen bilden einen integrierenden Bestandteil des jeweiligen Anhangs zum Rahmenvertrag bzw. der Transaktionsbestätigung.

Teil A: Ergänzende Definitionen für Zinssätze

1. Berichtigungen von veröffentlichten und angezeigten Sätzen

Zur Bestimmung des jeweiligen variablen Satzes für einen bestimmten Tag gilt Folgendes:

- (i) basiert dieser Satz auf Informationen, die von den Bildschirmseiten von Reuters, Bloomberg, Check, ICAP SwapPX oder SwapMarker stammen, unterliegt dieser Satz ggf. den späteren Berichtigungen, die von der jeweiligen Quelle innerhalb einer Stunde nach dem Zeitpunkt, zu dem dieser Satz erstmals von dieser Quelle angezeigt wurde, angezeigt werden;
- (ii) basiert dieser Satz für einen bestimmten Tag, auf Informationen aus einem *H.15 (519)* oder *H.15-Daily-Update*, unterliegt dieser Satz ggf. den an diesen Informationen vorgenommenen Berichtigungen, die diese Quelle innert 30 Tagen ab diesem Datum veröffentlicht hat; und
- (iii) benachrichtigt eine Partei die andere Partei spätestens 15 Tage nach Ablauf der in den Unterabsätzen (i) oder (ii) oben genannten Frist über eine Berichtigung im Sinne dieser Unterabsätze, ist infolge einer solchen Berichtigung ein angemessener Betrag zu entrichten (bei einer Transaktion unabhängig davon, ob die Berichtigung oder Benachrichtigung vor oder nach der Beendigung der Transaktion erfolgt ist), einschliesslich der Zinsen auf diesen Betrag zu einem Jahreszinssatz in Höhe der Kosten (ohne Belege oder Nachweise für tatsächliche Kosten), die der betreffenden Partei (wie von ihr bestätigt) durch die Finanzierung dieses Betrags entstanden sind. Die Zinsen werden für den Zeitraum ab einschliesslich dem Tag, an dem aufgrund einer solchen Berichtigung erstmals die Zahlung eines falschen Betrags erfolgt ist, bis ausschliesslich

zu dem Tag, an dem die Zahlung der Rückerstattung oder die aus dieser Berichtigung resultierende Zahlung erfolgt ist, berechnet.

2. Interpolation

Für jede *Berechnungsperiode*, für die eine lineare Interpolation zur Anwendung kommt, wird der betreffende *variable Zinssatz* für das Festlegungsdatum dieser *Berechnungsperiode* oder die in dieser *Berechnungsperiode* enthaltenen «Compounding»-Perioden durch lineare Interpolation zwischen zwei, auf dem betreffenden *variablen Zinssatz* basierenden Zinssätzen, bestimmt. Bei der Bestimmung einer dieser Zinssätze wird davon ausgegangen, dass die festgelegte Laufzeit demjenigen Zeitraum entspricht, der im Vergleich zur *Berechnungsperiode* oder zur «Compounding»-Periode der nächst kürzere Zeitraum wäre, für den Sätze verfügbar wären (oder eine andere durch die Parteien vereinbarte alternative festgelegte Laufzeit wird verwendet), während bei der Bestimmung des anderen Zinssatzes davon ausgegangen wird, dass die festgelegte Laufzeit dem Zeitraum entspricht, der im Vergleich zum *Berechnungsperiode* oder zur «Compounding»-Periode, der nächst längere Zeitraum wäre (oder eine andere durch die Parteien vereinbarte alternative festgelegte Laufzeit wird verwendet).

3. Rundung

Bei Berechnungen werden (sofern nicht anders angegeben) (i) alle Prozentsätze, die sich aus solchen Berechnungen ergeben, mit Ausnahme derer, die durch Interpolation zwischen zwei Zinssätzen ermittelt werden, ggf. auf das nächste Hunderttausendstel eines Prozentpunktes gerundet (z.B. wird 9.876541% (oder 0,09876541) auf 9.87654% (oder 0,0987654) abgerundet und 9.876545% (oder 0,09876545) auf 9.87655% (oder 0,0987655) aufgerundet; und -9.876541% (oder -0,09876541) auf -9.87654% (oder -0,0987654) aufgerundet und -9.876545% (oder -0,09876545) auf -9.87655% (oder -0,0987655%) abgerundet, (ii) alle Prozentsätze, die durch Interpolation zwischen zwei Sätzen bestimmt werden, ggf. nach dem in Unterabsatz (i) oben beschriebenen Verfahren gerundet, jedoch mit demselben Grad an Genauigkeit wie die beiden zur Bestimmung verwendeten Sätze (mit der Ausnahme, dass diese Prozentsätze nicht auf einen geringeren Grad an Genauigkeit gerundet werden als das nächste Tausendstel eines Prozentpunktes (0,001%) und (iii) alle Währungsbeträge, die in diesen Berechnungen verwendet werden oder sich aus solchen Berechnungen ergeben, auf die nächsten zwei Dezimalstellen in der entsprechenden Währung gerundet (wobei 0,005 nach oben gerundet wird [z.B. wird 0,674 auf 0,67 abgerundet und 0,675 auf 0,68 aufgerundet]).

4. Discontinued Rates Maturities Protocol

Jede *Transaktionsbestätigung* führt zur Einbeziehung der Bedingungen des von der International Swaps and Derivatives Association, Inc. am 11. Oktober 2013 veröffentlichten *ISDA 2013 Discontinued Rates Maturities Protocol* und gilt für die Zwecke der Anwendung der Bedingungen dieses *ISDA 2013 Discontinued Rates Maturities Protocol* als eine «Protocol Covered Transaction». Alle Begriffe, die in dieser Ziffer (4) verwendet und im *ISDA 2013 Discontinued Rates Maturities Protocol* definiert werden, erhalten die im *ISDA 2013 Discontinued Rates Maturities Protocol* definierte Bedeutung. Soll für einen bestimmten Termin ein «Affected Discontinued Rate» oder ein «Affected Interpolated Rate» für eine «Protocol Covered Transaction» bestimmt werden, für den (a) es keine diesbezügliche «Overriding

Fallback Provision» gibt und (b) dessen «Fixing Date(s)» (i) am oder nach dem «Amendment Effective Date» für die «Protocol Covered Transaction» und (ii) am oder nach dem «Discontinuation Date» des «Affected Discontinued Rate» liegt/liegen, dann wird ungeachtet anderslautender Bestimmungen in diesem Dokument an Stelle des «Affected Discontinued Rate» bzw. des «Affected Interpolated Rate» für das betreffende Datum der «Interpolated Rate» für diesen «Affected Discontinued Rate» bzw. diesen «Affected Interpolated Rate» für das betreffende Datum verwendet.

Im Rahmen der Anwendung des ISDA 2013 Discontinued Rates Maturities Protocols gelten (i) Verweise auf eine «Protocol Covered Transaction» als Verweise auf die einzelnen *Transaktionen*, (ii) Verweise auf «Adhering Parties» als Verweise auf die Parteien einer solchen *Transaktion*, (iii) Verweise auf einen «ISDA Master Agreement» oder Bestimmungen eines «ISDA Master Agreement» (einschliesslich seiner «Schedule») oder die «Swap Definitions» als durch Verweise auf den *Rahmenvertrag* (einschliesslich seiner Anhänge) in seiner geänderten und ergänzten Fassung und auf seine, den jeweiligen Abschnitten des ISDA Master Agreement bzw. den *ISDA 2006 Definitions* entsprechenden Bestimmungen ersetzt und (iv) Verweise auf ein «Credit Support Document» gelten als Verweise auf ein *Sicherungsdokument* im Sinne der Definition in diesen *ergänzenden Definitionen* zu Zinsderivaten, Referenzzinssätzen und EONIA.

Für die Auslegung des auf diese Weise *einbezogenen ISDA 2013 Discontinued Rates Maturities Protocols* gilt:

- (a) jeder Verweis im *ISDA 2013 Discontinued Rate Maturities Protocol* auf eine «Calculation Period» als Verweis auf die im *Rahmenvertrag* definierte *Berechnungsperiode*;
- (b) jeder Verweis im *ISDA 2013 Discontinued Rate Maturities Protocol* auf eine «Compounding Period» als Verweis auf die folgenden Teile des *Rahmenvertrags*: (i) wenn es sich beim *Rahmenvertrag* um die Version eines Schweizer *Rahmenvertrages* aus dem Jahre 2003 handelt, auf eine *Compounding Periode*, die auf die Berechnung gemäss Anhang B.1.2 oder B. 1.3 anwendbar ist, und (ii) wenn es sich bei dem *Rahmenvertrag* um eine Version eines Schweizer *Rahmenvertrages* aus dem Jahr 2013 handelt, auf eine *Compounding Periode* gemäss der Definition im *Rahmenvertrag*;
- (c) jeder Verweis im *ISDA 2013 Discontinued Rate Maturities Protocol* auf einen «Floating Rate» als Verweis auf die folgenden Teile des *Rahmenvertrages*: (i) wenn es sich beim *Rahmenvertrag* um die Version eines Schweizer *Rahmenvertrages* aus dem Jahre 2003 handelt, auf den *variablen Zinssatz* für die Zwecke der Berechnung gemäss Anhang B.1.2 oder B. 1.3 und (ii) wenn es sich beim *Rahmenvertrag* um eine Version eines Schweizer *Rahmenvertrages* aus dem Jahr 2013 handelt, auf den *variablen Zinssatz* gemäss der Definition im *Rahmenvertrag*;
- (d) jeder Verweis im *ISDA 2013 Discontinued Rate Maturities Protocol* auf einen «Floating Rate Option» als Verweis auf die folgenden Teile des *Rahmenvertrages*: (i) wenn es sich beim *Rahmenvertrag* um die Version eines Schweizer *Rahmenvertrages* aus dem Jahre 2003 handelt, auf die Art von *variablem Zinssatz*, die zur Berechnung gemäss Anhang B.1.2 oder B. 1.3 verwendet wird, und (ii) wenn es sich beim *Rahmenvertrag* um eine Version eines Schweizer *Rahmenvertrages* aus dem Jahr 2013 handelt, auf den ausgewählten *variablen Zinssatz* gemäss der Definition im *Rahmenvertrag*;

- (e) jeder Verweis im *ISDA 2013 Discontinued Rate Maturities Protocol* auf «Governing Master Agreement» als Verweis auf den *Rahmenvertrag*;
- (f) jeder Verweis im *ISDA 2013 Discontinued Rate Maturities Protocol* auf einen «Relevant Rate» als Verweis auf die folgenden Teile des *Rahmenvertrags*: (i) wenn es sich beim *Rahmenvertrag* um die Version eines Schweizer *Rahmenvertrages* aus dem Jahre 2003 handelt, auf den *variablen Zinssatz* für den Zeitraum, auf den sich die Berechnung gemäss Anhang B.1.2 oder B. 1.3 bezieht, und (ii) wenn es sich beim *Rahmenvertrag* um eine Version eines Schweizer *Rahmenvertrages* aus dem Jahr 2013 handelt, auf den für die *Berechnungsperiode* festgelegten *variablen Zinssatz*;
- (g) jeder Verweis im *ISDA 2013 Discontinued Rate Maturities Protocol* auf «Reset Date» als Verweis auf die folgenden Teile des *Rahmenvertrages*: (i) wenn es sich beim *Rahmenvertrag* um die Version eines Schweizer *Rahmenvertrages* aus dem Jahre 2003 handelt, auf das Datum, auf das sich der *variable Zinssatz* gemäss der Berechnung gemäss Anhang B.1.2 oder B. 1.3 bezieht, und (ii) wenn es sich beim *Rahmenvertrag* um eine Version eines Schweizer *Rahmenvertrages* aus dem Jahr 2013 handelt, auf das Festlegungsdatum gemäss der Definition im *Rahmenvertrag*.

5. Fixe Negativzinssätze

Sofern zwischen den Parteien nichts anderes vereinbart wurde, wird der «Fester Betrag » oder der «Fester Zinssatz-Zahlungsbetrag », der von einer Partei an einem Zahlungsdatum zu zahlen ist, mit Null veranschlagt, wenn: (i) der «Fester Betrag » oder der «Fester Zinssatz-Zahlungsbetrag », der von dieser Partei an diesem Zahlungstag zu zahlen ist, (ii) ein negativer Wert ist (aufgrund eines angegebenen negativen Fixsatzes), und die andere Partei zahlt dieser Partei am entsprechenden Zahlungstag den an diesem Zahlungstag errechneten absoluten Wert des negativen «Fester Betrag » oder des negativen «Fester Zinssatz-Zahlungsbetrag », zusätzlich zu allen Beträgen, die von der anderen Partei für die betreffende *Berechnungsperiode* zu zahlen sind. Beträge, die von der anderen Partei in Bezug auf den absoluten Wert eines negativen «Fester Betrag » oder eines negativen «Fester Zinssatz-Zahlungsbetrag » gezahlt werden, werden auf das von der Empfängerpartei angegebene Konto (sofern diese andere Partei nicht rechtzeitig einen angemessenen Widerspruch gegen das auf diese Weise angegebene Konto erhebt) in der Währung gezahlt, in der dieser «Fester Betrag » oder dieser «Fester Zinssatz-Zahlungsbetrag » ausgezahlt worden wäre, wenn es sich hierbei um einen positiven Betrag gehandelt hätte (und ohne Ansehung der Währung, in der die andere Partei ansonsten Zahlungen vornehmen muss).

6. Definitionen

Die folgenden Begriffe, die in diesen *ergänzenden Definitionen* zu Zinsderivaten, zu Referenzzinssätzen und EONIA verwendet werden, erhalten die nachfolgende Bedeutung:

- «**2006 ISDA Definitions**» bezeichnet die von der ISDA am Handelstag der jeweiligen *Transaktion* veröffentlichten 2006 ISDA Definitions oder alle von der ISDA an diesem Handelstag veröffentlichten Nachfolge-Publikationen.
- «**Administrator-/Referenzzinssatz-Ereignis**» bezeichnet in Bezug auf *Transaktionen*, die auf einen *relevanten Referenzzinssatz* Bezug nehmen, die Übermittlung einer Mitteilung durch eine Partei an die Andere (und den «Calculation Agent», wenn dieser nicht als Partei beteiligt ist), die *öffentlich zugängliche Informationen* enthält und wiedergibt, durch die in angemessener Weise bestätigt wird, dass Genehmigungen,

Registrierungen, Anerkennungen, Billigungen, Gleichwertigkeitsentscheidungen, Bestätigungen oder Eintragungen in offizielle Register in Bezug auf den *relevanten Referenzzinssatz*, den Administrator oder den Sponsor *des relevanten Referenzzinssatzes* entweder nicht bei der jeweils zuständigen Behörde oder einer anderen zuständigen amtlichen Stelle eingeholt wurden oder in Zukunft eingeholt werden; oder von dieser Behörde bzw. Stelle abgelehnt, verweigert, ausgesetzt oder zurückgezogen wurden; oder in Zukunft abgelehnt, verweigert, ausgesetzt oder zurückgenommen werden, jeweils mit der Wirkung, dass es einer oder beiden Parteien oder dem «Calculation Agent» nach den anwendbaren Gesetzen oder Vorschriften nicht gestattet ist bzw. sein wird, den *relevanten Referenzzinssatz* zur Erfüllung ihrer jeweiligen Verpflichtungen aus der *Transaktionsbestätigung* zu verwenden.

- «**Administrator-/Referenzzinssatz-Ereignistag**» bezeichnet in Bezug auf ein Administrator-/Referenzzinssatz-Ereignis das Datum, an dem die Genehmigung, Registrierung, Anerkennung, Billigung, Gleichwertigkeitsentscheidung, Bestätigung oder Eintragung in ein offizielles Register (a) nach anwendbarem Recht erforderlich ist oder (b) abgelehnt, verweigert, ausgesetzt oder zurückgenommen wird, wenn nach anwendbarem Recht vorgesehen ist, dass der *relevante Referenzzinssatz* nach der Ablehnung, Verweigerung, Aussetzung oder der Rücknahme nicht für die *Transaktionsbestätigung* verwendet werden darf.
- «**Bankarbeitstag**» bedeutet in Bezug auf die betreffende Stadt jeden Tag, an dem Geschäftsbanken für den allgemeinen Geschäftsverkehr (einschliesslich des Handels mit Devisen und Fremdwährungseinlagen) in dieser Stadt geöffnet sind.
- «**Berechnungsperiode**» bezeichnet den jeweiligen Zeitraum, der zur Berechnung der geschuldeten Beträge unter Bezugnahme auf einen *relevanten Referenzzinssatz* herangezogen wird.
- «**Besicherungsanhang**» bezeichnet einen *Besicherungsanhang* zu einem Schweizer *Rahmenvertrag* für OTC-Derivate, in der von der Schweizerischen Bankiervereinigung veröffentlichten Form.
- «**Betroffener Referenzzinssatz**» bezeichnet einen Referenzzinssatz, der von einem *Administrator-/Referenzzinssatz-Ereignis* oder einem *Index-Einstellungsereignis* betroffen ist.
- «**Bloomberg-Bildschirmseite**» bedeutet, soweit der Begriff im Zusammenhang mit einer bestimmten Seite und einem beliebigen *variablen Zinssatz* verwendet wird, die auf dem Bloomberg-Dienst als solche bezeichnete Anzeigeseite oder eine beliebige *Nachfolgequelle*.
- «**Check-Bildschirmseite**» bedeutet, soweit der Begriff im Zusammenhang mit einer bestimmten Seite und einem beliebigen *variablen Zinssatz* verwendet wird, die von der Korea Securities Computer Corporation als solche bezeichnete Anzeigeseite oder eine beliebige *Nachfolgequelle*.
- «**Covered ISDA Definitions Booklet**» bezeichnet die *2006 ISDA Definitions*, die *2000 ISDA Definitions*, die *1998 ISDA Euro Definitions*, das *1998 Supplement* zu den *1991*

ISDA Definitions und die 1991 ISDA Definitions, die jeweils von der ISDA veröffentlicht wurden.

- Unter «**ergänzenden Definitionen**» versteht man diese *ergänzenden Definitionen* zu Zinsderivaten, Referenzzinssätzen und EONIA.
- «**H.15 (519)**» bezeichnet die als solche bezeichnete wöchentliche statistische Veröffentlichung, die vom Federal Reserve System Board of Governors, oder dessen Nachfolger auf der Website des Federal Reserve System Board of Governors, oder einer beliebigen *Nachfolgequelle* veröffentlicht wird.
- «**H.15 Daily Update**» bezeichnet das tägliche Update von *H.15 (519)*, das auf der Website des Federal Reserve System Board of Governors oder einer beliebigen *Nachfolgequelle* verfügbar ist.
- «**ICAP SwapPX-Bildschirm**» bezeichnet, soweit der Begriff im Zusammenhang mit einer bestimmten Seite und einem beliebigen *variablen Zinssatz* verwendet wird, die als solche im ICAP Information Services LLC SwapPX Service bezeichnete Anzeigeseite oder eine beliebige *Nachfolgequelle*.
- «**Index-Einstellungsereignis**» bezeichnet eine *Transaktion*, die auf einen *relevanten Referenzzinssatz* Bezug nimmt, den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse: (a) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen im Namen des Administrators des *relevanten Referenzzinssatzes*, in der bekannt gegeben wird, dass die Bereitstellung des *relevanten Referenzzinssatzes* dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt wurde oder werden wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den *relevanten Referenzzinssatz* weiterhin bereitstellt; oder (b) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch eine Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den Administrator des *relevanten Referenzzinssatzes*, die Zentralbank für die Währung des *relevanten Referenzzinssatzes*, einen Insolvenzbeauftragten mit Zuständigkeit für den Administrator des *relevanten Referenzzinssatzes*, eine Abwicklungsbehörde mit Zuständigkeit für den Administrator des *relevanten Referenzzinssatzes* oder ein Gericht oder eine Stelle mit vergleichbarer insolvenz- oder abwicklungsrechtlicher Hoheit über den Administrator des *relevanten Referenzzinssatzes*, in der bekannt gegeben wird, dass der Administrator des *relevanten Referenzzinssatzes* die Bereitstellung des *relevanten Referenzzinssatzes* dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt dieser Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den *relevanten Referenzzinssatz* weiterhin bereitstellt.
- «**Index-Einstellungstichtag** bzw. «**Stichtag für Indexeinstellung**» bezeichnet in Bezug auf einen *relevanten Referenzzinssatz* und ein *Index-Einstellungsereignis* das erste Datum, an dem der Referenzzinssatz nicht mehr zur Verfügung gestellt wird.
- «**ISDA 2013 Discontinued Rate Maturities Protocol**» bezeichnet das am 11. Oktober 2013 von der International Swaps and Derivatives Association, Inc. veröffentlichte *ISDA 2013 Discontinued Rate Maturities Protocol*.

- «**ISDA 2020 IBOR Fallbacks Protocol**» bezeichnet das von der ISDA am 23. Oktober 2020 veröffentlichte *ISDA 2020 IBOR Fallbacks Protocol*.
- «**Sicherungsdokumente**» bezeichnet alle Dokumente, die gemäss ihren Bedingungen die Verpflichtungen der jeweiligen Partei aus einem *Rahmenvertrag* oder einer *Transaktionsbestätigung* sicherstellen, garantieren oder anderweitig unterstützen, einschliesslich insbesondere eines zwischen den Parteien in Bezug auf einen *Rahmenvertrag* abgeschlossenen *Besicherungsanhangs*.
- «**Nachfolgequelle**» bezeichnet in Bezug auf Anzeigeseiten, andere veröffentlichte Quellen, Informationsverkäufer oder -anbieter: (i) die nachfolgenden Anzeigeseiten, die nachfolgenden anderen veröffentlichten Quellen, die nachfolgenden Informationsverkäufer oder -anbieter, die vom Sponsor der Originalseite oder Originalquelle offiziell benannt wurde; oder (ii) wenn der Sponsor nicht offiziell eine nachfolgende Anzeigeseite, eine nachfolgende andere publizierte Quelle, einen nachfolgenden Verkäufer bzw. Anbieter benannt hat, die nachfolgende Anzeigeseite, die nachfolgende andere veröffentlichte Quelle, den nachfolgenden Verkäufer bzw. Anbieter, der vom betreffenden Informationsverkäufer oder -anbieter (sofern nicht mit dem Sponsor identisch) benannt wurde.
- «**Öffentlich zugängliche Informationen**» bezeichnet eine oder beide Arten der folgenden Informationen: (a) Informationen, die (i) vom Administrator oder Sponsor des *relevanten Referenzzinssatzes* oder (ii) einer nationalen, regionalen oder anderen Aufsichts- oder Regulierungsbehörde, die für die Aufsicht über den Administrator oder Sponsor des *relevanten Referenzzinssatzes* oder die Regulierung des *relevanten Referenzzinssatzes* zuständig ist, übermittelt oder veröffentlicht werden. Sind jedoch Informationen der in den Unterabsätzen (i) oder (ii) oben beschriebenen Art nicht öffentlich zugänglich, stellen sie nur dann *öffentlich zugängliche Informationen* dar, wenn sie ohne Verletzung eines Gesetzes, einer Verordnung, einer Vereinbarung, einer Absprache oder einer anderen Beschränkung in Bezug auf die Vertraulichkeit dieser Informationen öffentlich zugänglich gemacht werden können; oder (b) Informationen, die in einer Quelle, die in den Transaktionsunterlagen als solche bezeichnet wird, veröffentlicht werden; oder, wenn keine solche Quelle angegeben wird, in einem Nachrichtenmedium, das auf dem jeweiligen Markt üblicherweise verwendet wird.
- «**Rahmenvertrag**» bezeichnet einen von der Schweizerischen Bankiervereinigung veröffentlichten Schweizer *Rahmenvertrag* für OTC-Derivate (einschliesslich (a) der Version von 2003, (b) der Version von 2013 zur Verwendung in Verbindung mit bestimmten ISDA-Definitionen und (c) der nicht-ISDA-Version von 2013, die nicht zur Verwendung in Verbindung mit ISDA-Definitionen bestimmt ist), der zwischen den Parteien abgeschlossen wurde, ungeachtet der Art und Weise, wie ein solcher Vertrag zwischen den Parteien abgeschlossen wird (einschliesslich durch Unterzeichnung einer *Transaktionsbestätigung*, kraft derer der Abschluss eines solchen Vertrags zwischen den Parteien als erfolgt gilt) und einschliesslich aller Verträge, die durch einen Vertreter im Namen einer der Parteien abgeschlossen werden.
- „**Relevanter IBOR**» bezeichnet (a) den Sterling LIBOR (London Interbank Offered

Rate), den Schweizer Franken LIBOR (London Interbank Offered Rate), den US-Dollar-LIBOR (London Interbank Offered Rate), den Euro-LIBOR (London Interbank Offered Rate), die Euro Interbank Offered Rate, den japanischen Yen-LIBOR (London Interbank Offered Rate Rate), die japanische Yen Tokyo Interbank Offered Rate, die Euro-Yen Tokyo Interbank Offered Rate, die Bank Bill Swap Rate, die Canadian Dollar Offered Rate, die Hong Kong Interbank Offered Rate, die Singapore Dollar Swap Offered Rate und das Thai Baht Interest Rate Fixing; und (b) den LIBOR (London Interbank Offered Rate) ohne Verweis auf oder Angabe der Währung des entsprechenden LIBOR (London Interbank Offered Rate), im Fall von (a) und (b) stets in der wie auch immer gearteten Definition oder Beschreibung in der entsprechenden *Transaktionsbestätigung* (ob in Englisch oder in einer anderen Sprache).

- «**Relevanter Referenzzinssatz**» ist jeder Referenzzinssatz, der zur Bestimmung einer relevanten Zahlung herangezogen wird (wie zum Beispiel ein Zinssatz-Benchmark, ein Referenzzinssatz zur Bestimmung des Wechselkurses oder ein Referenzzinssatz zur Bestimmung einer Abwicklungszahlung).
- Unter «**risikofreien Zinssätzen**» versteht man einen *risikofreien Zinssatz*, der von diesen *ergänzenden Definitionen* erfasst ist oder diesen entspricht.
- «**Reuters-Bildschirmseite**» oder «**Thomson Reuters-Bildschirmseite**» bedeutet, soweit die Begriffe im Zusammenhang mit einer bestimmten Seite und einem beliebigen *variablen Zinssatz* verwendet werden, jeweils die auf dem Thomson Reuters-Dienst als solche bezeichnete Anzeigeseite oder eine beliebige *Nachfolgequelle*.
- «**SwapMarker-Bildschirmseite**» bezeichnet, soweit der Begriff im Zusammenhang mit einer bestimmten Seite und einem beliebigen variablen Satz verwendet wird, die als solche im Tullett Prebon Information SwapMarker Service bezeichnete Anzeigeseite oder eine beliebige *Nachfolgequelle*.
- «**TARGET-Abwicklungstag**» ist jeder Tag, an dem das TARGET-System offen ist.
- Unter «**Transaktionen**» versteht man alle zwischen den Vertragsparteien abgeschlossenen Geschäfte, die Teil eines *Rahmenvertrages* sind.
- Unter «**Transaktionsbestätigungen**» versteht man alle Dokumente und sonstigen Nachweise, die eine *Transaktion* bestätigen.

Teil B: Rückfallklauseln

1. Relevanter IBOR

(a) Wenn eine *Transaktionsbestätigung*:

- (A) einen Verweis auf einen *relevanten IBOR* durch Einbeziehung eines *Covered ISDA Definitions Booklets* enthält;
- (B) einen Verweis auf einen *relevanten IBOR* gemäss der Definition in einem *Covered ISDA Definitions Booklet* enthält oder anderweitig vorsieht, dass der *relevante IBOR* die Bedeutung erhält, die ihm in einem *Covered ISDA Definitions Booklet* zugewiesen wird (ungeachtet davon, ob dieses *Covered ISDA Definitions Booklet* vollständig in

diese *Transaktionsbestätigung* einbezogen wurde); oder (C) einen Verweis auf einen *relevanten IBOR* (unabhängig von dessen Definition oder Beschreibung) enthält; gelten die Bedingungen, die in den entsprechenden Abschnitten des von der ISDA veröffentlichten Anhangs zum *ISDA 2020 IBOR Fallbacks Protocol* angegeben werden oder gemäss diesen anwendbar sind, für jede solche Transaktion.

- (b) Für diese Zwecke sind (i) Verweise im Anhang zum *ISDA 2020 IBOR Fallbacks Protocol* auf ein «Protocol Covered Document» oder auf eine «Protocol Covered Confirmation» als Verweise auf die unter (a) oben fallenden *Transaktionsbestätigungen* zu verstehen und (ii) erhalten die im Anhang zum *ISDA 2020 IBOR Fallbacks Protocol* enthaltenen Verweise auf das «IBOR Fallbacks Supplement» die im *ISDA 2020 IBOR Fallbacks Protocol* definierte Bedeutung.

2. **Sonstiges: Index-Einstellungsereignis oder Administrator/Referenzzinssatz-Ereignis**

- (a) Bei Eintritt (i) eines *Index-Einstellungstichtags* in Bezug auf einen anderen betroffenen Referenzzinssatz als einen *relevanten IBOR*, oder (ii) eines *Administrator-/Referenzzinssatz-Ereignistags*, wird der betroffene Referenzzinssatz abgelöst:

- A) durch einen alternativen, von den Parteien nominierten Referenzzinssatz, oder
B) wenn keine Nominierung nach Buchstabe (A) erfolgt, durch einen von einem zuständigen Nominierungsgremium oder dem Administrator oder Sponsor des *betroffenen Referenzzinssatzes* nominierten, bestimmten oder empfohlenen Referenzzinssatz; oder
C) wenn innerhalb eines vom «Calculation Agent» festgelegten und der anderen Partei mitgeteilten Zeitraums keine Nominierung nach vorstehendem Buchstaben (A) oder (B) erfolgt, durch einen vom «Calculation Agent» bestimmten Referenzzinssatz, sofern selbiger eine wirtschaftlich vernünftige Alternative zum betroffenen Referenzzinssatz darstellt.

- (b) Die Parteien bestimmen die jeweilige Anpassungszahlung bzw. -spanne («Adjustment Spread»), die erforderlich ist, um eine Wertverschiebung einer Partei auf die andere, zu dem es ansonsten durch die Ablösung des *betroffenen Referenzzinssatzes* kommen würde, soweit wie angemessen möglich zu reduzieren oder zu unterbinden. Mangels einer Vereinbarung der Parteien nimmt der «Calculation Agent» diese Bestimmung vor.

Teil C: Risikofreie Zinssätze (RFRs)

Berechnungen auf Grundlage von *risikofreien Zinssätzen* erfolgen nach Massgabe dieses Abschnitts C. Zahlungen, die im Rahmen von *Sicherungsdokuments* geschuldet werden, werden von diesem Teil C nicht berührt, es sei denn, die Parteien haben etwas anderes vereinbart.

1. **SARON**

- (a) Verweise auf den SARON gelten als Verweise auf den «CHF-SARON-OIS-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung der tägliche Tagesgeldsatz für den Schweizer Franken Repo-Markt gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet, wobei die Rundung jedoch auf das nächste Zehntausendstel eines Prozentpunktes (0,0001%) erfolgt:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{SARON_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

(b) Für diese Zwecke bedeutet:

«d₀» für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Zürcher *Bankarbeitstage* der betreffenden *Berechnungsperiode* ;

«i» eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d₀, die die jeweiligen Zürcher *Bankarbeitstage* in chronologischer Reihenfolge ab einschliesslich dem ersten Zürcher *Bankarbeitstag* der betreffenden *Berechnungsperiode* darstellen;

«SARON_i» für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem Satz für Overnight-Repo-Geschäfte in Schweizer Franken, der auf der *Thomson Reuters-Bildschirmseite* SARON.S unter der Überschrift «CLSFIX» um oder nach 18.00 Uhr, Ortszeit Zürich, für diesen Tag angezeigt wird, entspricht; wird dieser Satz an dem betreffenden Tag nicht bis 20.00 Uhr auf der *Thomson Reuters-Bildschirmseite* SARON.S angezeigt, wird er vom «Calculation Agent» festgelegt;

«n_i» die Anzahl der Kalendertage in der betreffenden *Berechnungsperiode*, an denen der Zinssatz SARON_i ist; und

«d» die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*.

2. SONIA

(a) Verweise auf den SONIA gelten als Verweise auf den «GBP-SONIA-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung der «Sterling Daily Overnight» Referenzzinssatz gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet, wobei die Rundung jedoch auf das nächste Zehntausendstel eines Prozentpunktes (0,0001%) erfolgt:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{SONIA_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{d}$$

(b) Für diese Zwecke bedeutet:

«d₀» für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Londoner *Bankarbeitstage* der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«i» eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d₀, die die jeweiligen Londoner *Bankarbeitstage* in chronologischer Reihenfolge ab einschliesslich dem ersten Londoner *Bankarbeitstag* in der betreffenden *Berechnungsperiode* ;

«SONIA_i» für jeden Tag «i» der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem täglichen Sterling Overnight Index Average (SONIA)-Referenzzinssatz entspricht, der vom SONIA-Administrator den autorisierten Vertriebsstellen dieses Satzes zur

Verfügung gestellt und von diesen um 9:00 Uhr, Londoner Zeit, des Londoner *Bankarbeitstags*, der direkt auf diesen Tag «i» folgt, veröffentlicht wird;

«n_i» die Anzahl der Kalendertage in der betreffenden *Berechnungsperiode* r, an denen der Zinssatz SONIA_i ist; und

«d» die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode* .

3. SOFR

- (a) Verweise auf die SOFR gelten als Verweise auf den «USD-SOFR-COMPOUND», wobei dieser Satz nach der nachstehenden Formel als Rendite einer täglichen Zinsanlage berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung die SOFR gilt). Bei Eintritt eines *SOFR-Index-Einstellungsereignisses* wird der Satz für jeden Tag der *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab einschliesslich dem *SOFR-Index-Einstellungsstichtag* liegt, so bestimmt, als ob Verweise auf die SOFR-Verweise auf den Satz (einschliesslich etwaiger «Spreads» oder Anpassungen) wären, der vom Federal Reserve Board und/oder der Federal Reserve Bank of New York oder von einem Ausschuss, der vom Federal Reserve Board und/oder der Federal Reserve Bank of New York offiziell eingesetzt oder einberufen wurde, um einen Ersatz für die SOFR zu empfehlen, als SOFR-Ersatz empfohlen wird (wobei dieser Satz von der Federal Reserve Bank von New York oder einem anderen Administrator erstellt werden kann). Wird ein solcher Satz nicht innerhalb eines US-Staatsanleihen-Geschäftstags ab dem *SOFR-Index-Einstellungsereignis* empfohlen, wird der Satz für jeden Tag der *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab einschliesslich dem *SOFR-Index-Einstellungsstichtag* liegt, so bestimmt, als ob Verweise auf die SOFR Verweise auf die OBFR wären, Verweise auf den US-Staatsanleihen-Geschäftstag Verweise auf den New York City-*Bankarbeitstag* und Verweise auf das *SOFR-Index-Einstellungsereignis* Verweise auf das *OBFR-Index-Einstellungsereignis* wären. Wird ein solcher Satz nicht innerhalb eines US-Staatsanleihen-Geschäftstags ab dem *SOFR-Index-Einstellungsereignis* empfohlen und hat ein *OBFR-Index-Einstellungsereignis* stattgefunden, wird der Satz für jeden Tag der *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab einschliesslich dem *SOFR-Index-Einstellungsstichtag* liegt, so bestimmt, als ob Verweise auf die SOFR Verweise auf die «FOMC-Target Rate», Verweise auf den US-Staatsanleihen-Geschäftstag Verweise auf den New York City-*Bankarbeitstag* und Verweise auf die Website der New York Fed Verweise auf die Website der Federal Reserve wären.

Der «USD-SOFR-COMPOUND» wird wie folgt berechnet und der sich daraus ergebende Prozentsatz wird gegebenenfalls nach der in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* beschriebenen Methode gerundet:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{\text{SOFR}_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

- (b) Für diese Zwecke bedeutet:

«d₀» für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der US-Staatsanleihen-Geschäftstage der betreffenden *Berechnungsperiode* ;

«i» eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d₀, die die jeweiligen US-Staatsanleihen-Geschäftstage in chronologischer Reihenfolge ab und einschliesslich dem ersten US-Staatsanleihen-Geschäftstag in der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«SOFR» die von der Federal Reserve Bank of New York als Administrator des Referenzzinssatzes (oder einem Nachfolge-Administrator) auf der Website der New York Fed bereitgestellte tägliche «Secured Overnight Financing Rate»;

i«SOFR_i» für jeden Tag «i» der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der der SOFR des betreffenden Tages entspricht, die um circa 8 Uhr, Ortszeit New York City, am unmittelbar auf den betreffenden Tag «i» folgenden US-Staatsanleihen-Geschäftstag veröffentlicht wird. Wenn bis 17.00 Uhr, Ortszeit New York City, am unmittelbar auf einen Tag «i» folgenden US-Staatsanleihen-Geschäftstag keine SOFR für diesen Tag «i» veröffentlicht wurde und kein *Index-Einstellungsereignis* stattgefunden hat, ist die SOFR_i für diesen Tag «i» die SOFR für den ersten vorangegangenen US-Staatsanleihen-Geschäftstag, für den die SOFR auf der Website der New York Fed veröffentlicht wurde;

«n_i» die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*, an denen der Zinssatz SOFR_i ist;

«d» die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*;

bezeichnet ein «SOFR-Index-Einstellungsereignis» den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse:

- (a) eine öffentliche Erklärung der Federal Reserve Bank of New York (oder eines Nachfolge-Administrators der SOFR), in der mitgeteilt wird, dass sie den SOFR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zu diesem Zeitpunkt keinen Nachfolge-Administrator gibt, der die SOFR weiterhin zur Verfügung stellen wird;
- (b) eine Veröffentlichung von Informationen, in der hinreichend bestätigt wird, dass die Federal Reserve Bank of New York (oder ein Nachfolge-Administrators der SOFR) die SOFR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zu diesem Zeitpunkt keinen Nachfolge-Administrator gibt, der die SOFR weiterhin zur Verfügung stellen wird; oder
- (c) eine öffentliche Erklärung einer Regulierungsbehörde oder einer anderen amtlichen Stelle, welche die Verwendung der SOFR verbietet und auf alle Swapgeschäfte (bestehende inbegriffen) anwendbar ist, ohne auf diese begrenzt zu sein;

bezeichnet ein «SOFR-Index-Einstellungsstichtag» in Bezug auf ein SOFR-*Index-Einstellungsereignis* das Datum, an dem die Federal Reserve Bank of New York (oder ein Nachfolger-Administrator der SOFR) die Veröffentlichung der SOFR einstellt oder das Datum, an dem die SOFR nicht mehr verwendet werden darf;

ist «OBFR» die von der Federal Reserve Bank of New York als Administrator des Referenzzinssatzes (oder einem Nachfolge-Administrator) auf der Website der New York Fed bereitgestellte tägliche «Overnight Bank Funding Rate»;

bezeichnet ein «OBFR Index-Einstellungsereignis» den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse:

- (a) eine öffentliche Erklärung der Federal Reserve Bank of New York (oder eines Nachfolge-Administrators der OBFR), in der mitgeteilt wird, dass sie den OBFR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zu diesem Zeitpunkt keinen Nachfolge-Administrator gibt, der die OBFR weiterhin zur Verfügung stellen wird;

- (b) eine Veröffentlichung von Informationen, in der hinreichend bestätigt wird, dass die Federal Reserve Bank of New York (oder ein Nachfolge-Administrators der OBFR) die OBFR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zu diesem Zeitpunkt keinen Nachfolge-Administrator gibt, der die OBFR weiterhin zur Verfügung stellen wird; oder
- (c) eine öffentliche Erklärung einer Regulierungsbehörde oder einer anderen amtlichen Stelle, welche die Verwendung der OBFR verbietet und auf alle Swapgeschäfte (bestehende inbegriffen) anwendbar ist, ohne auf diese begrenzt zu sein; und

bezeichnet «FOMC-Target Rate» den kurzfristigen Zielzinssatz, der durch das Federal Open Market Committee festgesetzt wird und auf der Website der Federal Reserve Bank of New York veröffentlicht wird, oder, wenn das Federal Open Market Committee keinen einzelnen Referenzzinssatz avisiert, das Mittel des Zielbereichs des kurzfristigen Zielzinssatzes, der durch das Federal Open Market Committee festgesetzt wird und auf der Website der Federal Reserve Bank of New York veröffentlicht wird (berechnet als arithmetisches Mittel zwischen der oberen Grenze der Ziel-Bandbreite und der unteren Grenze der Ziel-Bandbreite, gegebenenfalls gerundet entsprechend dem Verfahren in Teil A Absatz 3 (iii) dieser *ergänzenden Definitionen*).

4. €STR

- (a) Verweise auf die €STR oder die EuroSTR gelten als Verweise auf den «EUR-EuroSTR-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung die Euro Short-Term Rate (€STR) gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem Verfahren in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* gerundet, wobei die Rundung jedoch auf das nächste Zehntausendstel eines Prozentpunktes (0,0001%) erfolgt:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{\text{EuroSTR}_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

- (b) Bei Eintritt eines *EuroSTR-Index-Einstellungsereignisses* wird der Satz für jeden Tag der *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab einschliesslich dem *EuroSTR-Index-Einstellungstichtag* liegt, so bestimmt, als wenn Verweise auf die EuroSTR_i Verweise auf den EZB-Empfehlungsreferenzsatz_i wären; wenn:
 - (1) ein solcher Satz nicht vor dem Ende des *TARGET-Abwicklungstags* unmittelbar nach dem Tag empfohlen wird, an dem das *EuroSTR-Index-Einstellungsereignis* eintritt, dann wird der Satz für jeden Tag der *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab einschliesslich dem *EuroSTR-Index-Einstellungstichtag* liegt, so bestimmt, als wenn Verweise auf die EuroSTR_i Verweise auf die Modifizierte EDFR (EuroSTR)_i wären; oder
 - (2) in der Folge ein *Index-Einstellungsereignis* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz eintritt, dann wird der Satz für jeden Tag der *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab einschliesslich dem *EuroSTR-Index-Einstellungstichtag* liegt, so bestimmt, als wenn Verweise auf die EuroSTR_i Verweise auf die *modifizierte EDFR* (EuroSTR)_i wären.

c) Für diese Zwecke bedeutet:

« d_0 » für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der *TARGET-Abwicklungstage* der betreffenden *Berechnungsperiode* ;

« i » eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d_0 , die jeweils den betreffenden *TARGET-Abwicklungstag* in chronologischer Reihenfolge ab einschliesslich dem ersten *TARGET-Abwicklungstag* der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«EuroSTR $_i$ » für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der der auf der Website der EZB für diesen Tag veröffentlichten EuroSTR entspricht; ist «EuroSTR» die Euro Short-Term-Rate (€STR), die von der Europäischen Zentralbank als Administrator des Referenzzinssatzes (oder einem Nachfolge-Administrator) auf der Website der EZB bereitgestellt wird;

« n_i » die Anzahl der Kalendertage in der betreffenden *Berechnungsperiode* , an denen der Zinssatz EuroSTR $_i$ ist;

« d » die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode* ;

«EuroSTR-Index-Einstellungsereignis» den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse:

- (a) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen der Europäischen Zentralbank (oder eines Nachfolge-Administrators des EuroSTR), in der mitgeteilt wird, dass sie die Bereitstellung des EuroSTR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EuroSTR weiterhin zur Verfügung stellt; oder
- (b) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den EuroSTR-Administrator, die Zentralbank für die Währung des EuroSTR, einen Insolvenzbeauftragten mit Zuständigkeit für den EuroSTR-Administrator, eine Abwicklungsbehörde mit Zuständigkeit für den EuroSTR-Administrator, oder ein Gericht oder eine Stelle mit vergleichbarer insolvenz- oder abwicklungsrechtlicher Hoheit über den EuroSTR-Administrator, in der bekannt gegeben wird, dass der EuroSTR-Administrator die Bereitstellung der EuroSTR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt dieser Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der die EuroSTR weiterhin bereitstellt;

bezeichnet «EuroSTR-Index-Einstellungstichtag» bzw. «Stichtag für Einstellung des EuroSTR-Index» in Bezug auf ein *EuroSTR-Index-Einstellungsereignis* das erste Datum, an dem die EuroSTR nicht mehr zur Verfügung gestellt wird;

ist der «EZB-Empfehlungsreferenzzinssatz $_i$ » für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem von seinem Administrator veröffentlichten oder bereitgestellten EZB-Empfehlungsreferenzzinssatz für diesen Tag entspricht;

entspricht der «EZB-Empfehlungsreferenzzinssatz» dem Zinssatz (einschliesslich etwaiger Spreads oder Anpassungen), der von der Europäischen Zentralbank (oder einem Nachfolge-Administrator der EuroSTR) und/oder einem Ausschuss, der von der Europäischen Zentralbank (oder einem Nachfolge-Administrator des EuroSTR) offiziell eingesetzt oder einberufen wurde, um einen Ersatz für die EuroSTR zu empfehlen, als Ersatz für den

EuroSTR empfohlen wird (wobei dieser Satz von der Europäischen Zentralbank oder einem anderen Administrator erstellt werden kann);

bezeichnet «Index-Einstellungsereignis betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz» den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse:

- (a) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen des Administrators des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, in der mitgeteilt wird, dass er die Bereitstellung des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EZB-Empfehlungsreferenzsatz weiterhin zur Verfügung stellt; oder
- (b) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, die Zentralbank für die Währung des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, einen Insolvenzbeauftragten mit Zuständigkeit für den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, eine Abwicklungsbehörde mit Zuständigkeit für den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, oder ein Gericht oder eine Stelle mit vergleichbarer insolvenz- oder abwicklungsrechtlicher Hoheit über den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, in der bekannt gegeben wird, dass der Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes die Bereitstellung des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt dieser Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EZB-Empfehlungsreferenzsatz weiterhin bereitstellt;

bezeichnet «Index-Einstellungstichtag betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz» in Bezug auf ein *Index-Einstellungsereignis* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz das erste Datum, an dem der EZB-Empfehlungszinssatz nicht mehr zur Verfügung gestellt wird;

ist die «modifizierte EDFR (EuroSTR) i » für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem Zinssatz für die Einlagefazilität im Eurosystem («Eurosystem Deposit Facility Rate») für diesen Tag entspricht, zuzüglich des «EDFR-Spreads»;

bezeichnet «Eurosystem Deposit Facility Rate» den Zinssatz für die Einlagefazilität, den die Banken für Tagesgeldeinlagen beim Eurosystem verwenden können und der auf der Website der EZB veröffentlicht wird; und

unter «EDFR-Spread» versteht man:

- (a) wenn vor dem Ende des *TARGET-Abwicklungstags* unmittelbar nach dem Tag, an dem ein *EuroSTR-Index-Einstellungsereignis* eintritt, kein EZB-Empfehlungsreferenzsatz empfohlen wird, das arithmetische Mittel der täglichen Differenz zwischen der EuroSTR und der «Eurosystem Deposit Facility Rate» während eines Beobachtungszeitraums von 30 *TARGET-Abwicklungstagen*, wobei dieser Zeitraum 30 *TARGET-Abwicklungstage* vor dem Tag des Eintritts des *EuroSTR-Index-Einstellungsereignisses* beginnt und am *TARGET-Abwicklungstag* unmittelbar vor dem Tag des Eintritts des *EuroSTR-Index-Einstellungsereignisses* endet; oder
- (b) im Fall des Eintritts eines *Index-Einstellungsereignisses* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz das arithmetische Mittel der täglichen Differenz zwischen dem EZB-Empfehlungsreferenzsatz und der «Eurosystem Deposit Facility Rate» während eines

Beobachtungszeitraums von 30 *TARGET-Abwicklungstagen*, wobei dieser Zeitraum 30 *TARGET-Abwicklungstage* vor dem Tag des Eintritts des *Index-Einstellungsereignisses* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzzinssatz beginnt und am *TARGET-Abwicklungstag* unmittelbar vor dem Tag des Eintritts des *Index-Einstellungsereignisses* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzzinssatz endet.

5. TONA

- (a) Verweise auf den TONA gelten als Verweise auf den «JPY-TONA-OIS-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung das arithmetische Mittel der täglichen Zinssätze des Tokioter Interbanken-Geldmarkts in JPY gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{TONA_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{d}$$

- (b) Für diese Zwecke bedeutet:

« d_0 » für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Tokioter *Bankarbeitstage* in der betreffenden *Berechnungsperiode*;

« i » eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d_0 , die den jeweiligen Tokioter *Bankarbeitstag* in chronologischer Reihenfolge ab (einschliesslich) dem ersten Tokioter *Bankarbeitstag* der betreffenden *Berechnungsperiode*;

« $TONA_i$ » für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der der Tokyo OverNight Average Rate (TONA) entspricht, der von der Bank of Japan um circa 10.00 Uhr, Ortszeit Tokio, am nächsten auf diesen Tag « i » folgenden Tokioter *Bankarbeitstag* auf der *Reuters-Bildschirmseite* TONAT veröffentlicht wird. Unterbleibt für einen Tag « i » die Anzeige dieses Satzes auf der *Reuters-Bildschirmseite* TONAT, wird der Satz für diesen Tag zwischen den Parteien in gutem Glauben und auf wirtschaftlich vernünftige Weise vereinbart. Können sich die Parteien nicht einigen, wird als Satz für diesen Tag der Satz herangezogen, der auf der *Reuters-Bildschirmseite* TONAT für den unmittelbar vorangegangenen Tokioter *Bankarbeitstag* angezeigt wird;

« n_i » die Anzahl der Kalendertage in der betreffenden *Berechnungsperiode*, an denen der Zinssatz $TONA_i$ ist; und

« d » die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*.

6. SORA

- (a) Verweise auf den SORA gelten als Verweise auf den «SGD-SORA-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung der SORA gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet, wobei die Rundung jedoch auf das nächste Zehntausendstel eines Prozentpunktes (0,0001%) erfolgt:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{SORA_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{d}$$

(b) Bei Eintritt eines *SORA-Index-Einstellungsereignisses* wird der Zinssatz für jeden Tag der *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab einschliesslich dem *SORA-Index-Einstellungstichtag* liegt, so bestimmt, als wenn Verweise auf den SORA Verweise auf den Empfehlungsreferenzsatz der Monetary Authority of Singapore s_i wären.

(c) Für diese Zwecke bedeutet:

« d_0 » für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Singapurere *Bankarbeitstage* in der betreffenden *Berechnungsperiode*;

« i » eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d_0 , die die jeweiligen Singapurere *Bankarbeitstage* in chronologischer Reihenfolge ab einschliesslich dem ersten Singapurere *Bankarbeitstag* der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«SORA» der von der Monetary Authority of Singapore als Administrator des Referenzzinssatzes (oder einem Nachfolge-Administrator) auf der Website der Monetary Authority of Singapore bereitgestellte (oder von ihren autorisierten Vertriebsstellen veröffentlichte) tägliche Singapore Overnight Rate Average;

« $SORA_i$ » für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem für diesen Tag auf der Website der Monetary Authority of Singapore (oder von einer ihrer autorisierten Vertriebsstellen) veröffentlichten SORA entspricht. Wenn bis 17.00 Uhr, Ortszeit Singapur, unmittelbar auf einen Tag « i » folgenden Singapurere *Bankarbeitstag* kein SORA für diesen Tag « i » veröffentlicht wurde und kein *SORA-Index-Einstellungsereignis* stattgefunden hat, ist der $SORA_i$ für diesen Tag « i » der SORA, der für den unmittelbar vorangegangenen Singapurere *Bankarbeitstag* auf der Website der Monetary Authority of Singapore (oder von einer ihrer autorisierten Vertriebsstellen) veröffentlicht wurde;

«*SORA-Index-Einstellungsereignis*» den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse:

(a) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen der Monetary Authority of Singapore (oder eines Nachfolge-Administrators des SORA), in der mitgeteilt wird, dass sie die Bereitstellung des SORA dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den SORA weiterhin zur Verfügung stellt; oder

(b) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den SORA-Administrator, die Zentralbank für die Währung des SORA, einen Insolvenzbeauftragten mit Zuständigkeit für den SORA-Administrator, eine Abwicklungsbehörde mit Zuständigkeit für den SORA-Administrator, oder ein Gericht oder eine Stelle mit vergleichbarer insolvenz- oder abwicklungsrechtlicher Hoheit über den SORA-Administrator, in der bekannt gegeben wird, dass der SORA-Administrator die Bereitstellung des SORA dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt dieser Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den SORA weiterhin bereitstellt;

«SORA-Index-Einstellungstichtag» bzw. «Stichtag für Einstellung des SORA-Index» in Bezug auf das SORA-Index-Einstellungsereignis das erste Datum, an dem der SORA nicht mehr zur Verfügung gestellt wird;

« n_i » die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*, an denen der Zinssatz $SORA_i$ ist;

« d » die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode* ;

ist der «Empfehlungsreferenzsatz _{i} der Monetary Authority of Singapore» für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem von seinem Administrator veröffentlichten oder bereitgestellten Empfehlungsreferenzsatz der Monetary Authority of Singapore für diesen Tag entspricht; und

«Empfehlungsreferenzsatz der Monetary Authority of Singapore» ist der Zinssatz (einschliesslich etwaiger Spreads oder Anpassungen), der von der Monetary Authority of Singapore (oder einem Nachfolge-Administrator des SORA) und/oder einem von der Monetary Authority of Singapore (oder einem Nachfolge-Administrator des SORA) offiziell für die Empfehlung eines Ersatzes für den SORA bestätigten oder einberufenen Ausschuss als Ersatz für den SORA empfohlen wird (wobei dieser Satz von der Monetary Authority of Singapore oder einem anderen Administrator erstellt werden kann).

7. THOR

- (a) Verweise auf die THOR gelten als Verweise auf den «THB-THOR-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung die THOR gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{THOR_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{d}$$

- (b) Bei Eintritt eines THOR-Index-Einstellungsereignisses wird der Zinssatz für jeden Tag der Berechnungsperiode, der in der Zeit ab einschliesslich dem THOR-Index-Einstellungstichtag liegt, so bestimmt, als wenn Verweise auf die THOR Verweise auf den Empfehlungsreferenzsatz der Bank of Thailand wären.
- (c) Für diese Zwecke bedeutet:

« d_0 » für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Bangkok-Bankarbeitstage in der betreffenden *Berechnungsperiode*;

« i » eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d_0 , die die jeweiligen Bangkok-Bankarbeitstage in chronologischer Reihenfolge ab einschliesslich dem ersten Bangkok-Bankarbeitstag der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«THOR» die von der Bank of Thailand als Administrator des Referenzzinssatzes (oder einem Nachfolge-Administrator) auf der Website der Bank of Thailand bereitgestellte (oder von ihren autorisierten Vertriebsstellen veröffentlichte) «Thai Overnight Repurchase Rate»;

« $THOR_i$ » für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der für diesen Tag auf der Website der Bank of Thailand (oder von einer ihrer autorisierten Vertriebsstellen) um circa 17.00 Uhr, Ortszeit Bangkok (oder gemäss den Angaben des

Administrators) am Tag «i» veröffentlichten THOR entspricht. Wenn bis 9.30 Uhr, Ortszeit Bangkok, am unmittelbar auf einen Tag «i» folgenden Bangkok *Bankarbeitstag* keine THOR für diesen Tag «i» veröffentlicht wurde und kein THOR-*Index-Einstellungsereignis* stattgefunden hat, ist die THOR_i für diesen Tag «i» die THOR, die für den unmittelbar vorangegangenen Bangkok-*Bankarbeitstag* auf der Website der Bank of Thailand (oder von einer ihrer autorisierten Vertriebsstellen) veröffentlicht wurde;

«THOR-Index-Einstellungsereignis» den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse:

- (a) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen der Bank of Thailand (oder eines Nachfolge-Administrators der THOR), in der mitgeteilt wird, dass sie die Bereitstellung der THOR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der die THOR weiterhin zur Verfügung stellt; oder
- (b) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den THOR-Administrator oder die Zentralbank für die Währung der THOR, in der mitgeteilt wird, dass der THOR-Administrator die Bereitstellung der THOR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der die THOR weiterhin zur Verfügung stellt; oder
- (c) eine öffentliche Erklärung der Zentralbank für die Währung der THOR, welche die Verwendung der THOR verbietet und auf alle Swappeschäfte (bestehende unbefristet) anwendbar ist, ohne auf diese begrenzt zu sein;

«THOR-Index-Einstellungsstichtag» in Bezug auf ein THOR-*Index-Einstellungsereignis* das erste Datum, an dem die Bank of Thailand (oder ein Nachfolge-Administrator der THOR) die Veröffentlichung der THOR einstellt oder das erste Datum, an dem die THOR nicht mehr verwendet werden darf;

«n_i» die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*, an denen der Zinssatz THOR_i ist;

stellt «d» die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode* dar;

ist der «Empfehlungsreferenzsatz_i der Bank of Thailand» für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem von seinem Administrator veröffentlichten oder bereitgestellten Empfehlungsreferenzsatz der Bank of Thailand für diesen Tag entspricht; und

ist der «Empfehlungsreferenzsatz der Bank of Thailand» der Zinssatz (einschliesslich etwaiger Spreads oder Anpassungen), der von der Bank of Thailand (oder einem Nachfolge-Administrator der THOR) und/oder einem Ausschuss, der von der Bank of Thailand (oder einem Nachfolge-Administrator der THOR) offiziell eingesetzt oder einberufen wurde, um einen Ersatz für die THOR zu empfehlen, als Ersatz für die THOR empfohlen wird (wobei dieser Satz von der Bank of Thailand oder einem anderen Administrator erstellt werden kann).

8. AONIA

- (a) Verweise auf den AONIA gelten als Verweise auf den «AUD-AONIA-OIS-COMPOUND»,

der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung die unten bestimmte «Australian Dollar Interbank Overnight Cash Rate» gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet, wobei die Rundung jedoch auf das nächste Zehntausendstel eines Prozentpunktes (0,0001%) erfolgt:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{AONIA_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{d}$$

(b) Für diese Zwecke bedeutet:

«d₀» für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Sydney-Bankarbeitstage in der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«i» eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d₀, die die jeweiligen Sydney-Bankarbeitstage in chronologischer Reihenfolge ab (einschliesslich) dem ersten Sydney-Bankarbeitstag der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«AONIA_i» für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der von der Reserve Bank of Australia berechnet und auf der *Reuters-Bildschirmseite* RBA30 veröffentlichten «Interbank Overnight Cash Rate» für diesen Tag entspricht. Unterbleibt für einen Tag «i» die Anzeige dieses Satzes auf der *Reuters-Bildschirmseite* RBA30, wird der Satz für diesen Tag zwischen den Parteien in gutem Glauben und auf wirtschaftlich vernünftige Weise vereinbart. Können sich die Parteien nicht einigen, wird als Satz für diesen Tag der Satz herangezogen, der auf der *Reuters-Bildschirmseite* RBA30 für den unmittelbar vorangegangenen Sydney-Bankarbeitstag angezeigt wird;

«n_i» 1, es sei denn, der Sydney-Bankarbeitstag ist der Tag unmittelbar vor einem Tag, bei dem es sich nicht um einen Sydney-Bankarbeitstag handelt; in diesem Fall ist «n» die Anzahl der Kalendertage ab einschliesslich diesem Sydney-Bankarbeitstag bis ausschliesslich dem nächsten Sydney-Bankarbeitstag; und

«d» die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*.

9. CORRA

(a) Verweise auf den CORRA gelten als Verweise auf den «CAD-CORRA-OIS-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung die täglichen «Overnight Repurchase Rates» für Kanadische Dollar gelten, die von der Bank of Canada als gewichteter Durchschnitt «Non-Specific Collaterals», die über Broker gehandelt werden, bestimmt werden). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{CORRA_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{d}$$

(b) Für diese Zwecke bedeutet:

« d_0 » für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Toronto-Bankarbeitstage in der betreffenden *Berechnungsperiode*;

« i » eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d_0 , die die jeweiligen Toronto-Bankarbeitstage in chronologischer Reihenfolge ab (einschliesslich) dem ersten Toronto-Bankarbeitstag der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«CORRA $_i$ » für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem täglichen «Fixing» der «Overnight Repurchase Rate» für den Kanadischen Dollar entspricht, das um circa 9.00 Uhr, Ortszeit Toronto, einen Toronto-Bankarbeitstag nach diesem Tag « i » auf der Website der Bank of Canada veröffentlicht wird. Unterbleibt für den Tag « i » die Anzeige dieses Satzes auf der Website, wird der Satz für diesen Tag zwischen den Parteien in gutem Glauben und auf wirtschaftlich vernünftige Weise vereinbart. Können sich die Parteien nicht einigen, wird als Satz für diesen Tag der Satz herangezogen, der auf der Website der Bank of Canada für den unmittelbar vorangegangenen Toronto-Bankarbeitstag angezeigt wird;

« n_i » die Anzahl der Kalendertage in der betreffenden *Berechnungsperiode*, an denen der Zinssatz der CORRA $_i$ ist; und

« d » die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*.

10. DKKOIS

(a) Verweise auf DKKOIS gelten als Verweise auf den «DKK-DKKOIS-OIS-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung das arithmetische Mittel der täglichen Zinssätze des Kopenhagener Interbanken-Geldmarkts in DKK gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Methode gerundet:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{\text{DKKOIS}_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

(b) Für diese Zwecke bedeutet:

« d_0 » für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Kopenhagener Bankarbeitstage in der betreffenden *Berechnungsperiode*;

« i » eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d_0 , die die jeweiligen Kopenhagener Bankarbeitstage in chronologischer Reihenfolge ab (einschliesslich) dem ersten Kopenhagener Bankarbeitstag der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«DKKOIS $_i$ » für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem täglichen «Fixing» der «Danish Kroner Tomorrow Next Deposits» entspricht, das um circa 11.00 Uhr, Ortszeit Kopenhagen, einen Kopenhagener Bankarbeitstag vor dem betreffenden Tag « i » auf der *Reuters-Bildschirmseite* DNKA14 unter der Überschrift «T/N Rente» veröffentlicht wird. Unterbleibt für einen Tag « i » die Anzeige dieses Satzes auf der *Reuters-Bildschirmseite* DNKA14, wird der Satz für diesen Tag zwischen den Parteien

in gutem Glauben und auf wirtschaftlich vernünftige Weise vereinbart. Können sich die Parteien nicht einigen, wird als Satz für diesen Tag der Satz herangezogen, der auf der *Reuters-Bildschirmseite* DKNA14 für den unmittelbar vorangegangenen Kopenhagener *Bankarbeitstag* angezeigt wird;

« n_i » die Anzahl der Kalendertage in der betreffenden *Berechnungsperiode*, an denen der Zinssatz der DKKOIS i ist; und

stellt « d » die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*.

11. HONIX

- (a) Verweise auf HONIX gelten als Verweise auf den «HKD-HONIX-OIS-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung das arithmetische Mittel der täglichen Zinssätze des Interbanken-Geldmarkts in HKD in Hongkong gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{HONIX_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \frac{365}{d}$$

- (b) Für diese Zwecke bedeutet:

« d_0 » für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Hongkong-*Bankarbeitstage* in der betreffenden *Berechnungsperiode*;

« i » eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d_0 , die die jeweiligen Hongkong-*Bankarbeitstage* in chronologischer Reihenfolge ab (einschliesslich) dem ersten Hongkong-*Bankarbeitstag* der betreffenden *Berechnungsperiode*;

HONIX $_i$ für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem von der Hong Kong Brokers' Association berechneten und auf der *Reuters-Bildschirmseite* HONIX um 17.30 Uhr Ortszeit Hongkong, für diesen Tag veröffentlichten Tagesgeldsatz entspricht. Unterbleibt für einen Tag « i » die Anzeige dieses Satzes auf der *Reuters-Bildschirmseite* HONIX, wird der Satz für diesen Tag zwischen den Parteien in gutem Glauben und auf wirtschaftlich vernünftige Weise vereinbart. Können sich die Parteien nicht einigen, wird als Satz für diesen Tag der Satz herangezogen, der auf der *Reuters-Bildschirmseite* HONIX für den unmittelbar vorangegangenen Hongkong-*Bankarbeitstag* angezeigt wird;

« n_i » 1, es sei denn, der Hongkong-*Bankarbeitstag* ist der Tag unmittelbar vor einem Tag, bei dem es sich nicht um einen Hongkong-*Bankarbeitstag* handelt; in diesem Fall ist « n_i » die Anzahl der Kalendertage ab einschliesslich diesem Hongkong-*Bankarbeitstag* bis ausschliesslich dem nächsten Hongkong-*Bankarbeitstag*; und

« d » die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*.

12. NZIONA

- (a) Verweise auf den NZIONA gelten als Verweise auf den «NZD-NZIONA-OIS-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung die unten bestimmte «New

Zealand Dollar Official Cash Rate» gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet, wobei die Rundung jedoch auf das nächste Zehntausendstel eines Prozentpunktes (0,0001%) erfolgt:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{NZIONA_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \frac{365}{d}$$

(b) Für diese Zwecke bedeutet:

« d_0 » für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der ESAS-Abwicklungstage der betreffenden *Berechnungsperiode*;

« i » eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d_0 , die die jeweiligen ESAS-Abwicklungstage in chronologischer Reihenfolge ab (einschliesslich) dem ersten ESAS-Abwicklungstag der betreffenden *Berechnungsperiode*;

« $NZIONA_i$ » für jeden Tag « i » in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der durch die Reserve Bank of New Zealand für diesen Tag festgelegt und auf der *Reuters-Bildschirmseite* RBNZ02 per 10.00 Uhr, Ortszeit Wellington, am Tag « i » veröffentlichten «Official Cash Rate» entspricht. Unterbleibt für einen Tag « i » die Anzeige dieses Satzes auf der *Reuters-Bildschirmseite* RBNZ02, wird der Satz für diesen Tag zwischen den Parteien in gutem Glauben und auf wirtschaftlich vernünftige Weise vereinbart. Können sich die Parteien nicht einigen, entspricht der Satz für diesen Tag dem Satz, der auf der *Reuters-Bildschirmseite* RBNZ02 für den unmittelbar vorangegangenen ESAS-Abwicklungstag angezeigt wird;

« n_i » eins, es sei denn, der ESAS-Abwicklungstag ist der Tag unmittelbar vor einem Tag, bei dem es sich nicht um einen ESAS-Abwicklungstag handelt; in diesem Fall ist « n_i » die Anzahl der Kalendertage ab einschliesslich diesem ESAS-Abwicklungstag bis ausschliesslich dem nächsten ESAS-Abwicklungstag;

ESAS-Abwicklungstag ein Tag, an dem das «Exchange Settlement Account System» (ESAS) der Reserve Bank of New Zealand geöffnet ist; und

« d » die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*.

13. SIOR

(a) Verweise auf die SIOR gelten als Verweise auf den «SEK-SIOR-OIS-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung das arithmetische Mittel der täglichen Zinssätze des Stockholmer Interbanken-Geldmarkts in SEK gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{SIOR_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

(b) Für diese Zwecke bedeutet:

«d₀» für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Stockholmer *Bankarbeitstage* der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«i» eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d₀, die die jeweiligen Stockholmer *Bankarbeitstage* in chronologischer Reihenfolge ab (einschliesslich) dem ersten Stockholmer-*Bankarbeitstag* der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«SIOR_i» für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem täglichen «Fixing» der Swedish Krona Tomorrow Next Deposits entspricht, das um circa 11.00 Uhr, Ortszeit Stockholm, einen Stockholmer *Bankarbeitstag* vor dem betreffenden Tag «i» auf der *Reuters-Bildschirmseite* SIDE unter der Überschrift «Fixing» veröffentlicht wird. Unterbleibt für einen Tag «i» die Anzeige dieses Satzes auf der *Reuters-Bildschirmseite* SIDE, wird der Satz für diesen Tag zwischen den Parteien in gutem Glauben und auf wirtschaftlich vernünftige Weise vereinbart. Können sich die Parteien nicht einigen, wird als Satz für diesen Tag der Satz herangezogen, der auf der *Reuters-Bildschirmseite* SIDE für den unmittelbar vorangegangenen Stockholmer *Bankarbeitstag* angezeigt wird;

«n_i» die Anzahl der Kalendertage in der betreffenden *Berechnungsperiode*, an denen der Zinssatz der SIOR_i ist; und

«d» die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*.

14. TLREF

(a) Verweise auf die TLREF gelten als Verweise auf den «TRY-TLREF-OIS-COMPOUND», der nach der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Zinsberechnung das arithmetische Mittel der Tagessätze der «Turkish Lira Overnight Reference Rate» gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet, wobei die Rundung jedoch auf das nächste Zehntausendstel eines Prozentpunktes (0,0001%) erfolgt:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{\text{TLREF}_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{d}$$

(b) Für diese Zwecke bedeutet:

«d₀» für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der Istanbul-*Bankarbeitstage* der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«i» eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d, die die jeweiligen Istanbul-*Bankarbeitstage* in chronologischer Reihenfolge ab (einschliesslich) dem ersten Istanbul-*Bankarbeitstag* der betreffenden *Berechnungsperiode*;

«TLREF_i» für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* der Referenzzinssatz, der der auf der Website der Borsa Istanbul um circa 16.00 Uhr, Ortszeit Istanbul, für diesen Tag veröffentlichten «Turkish Lira Overnight Reference Rate» entspricht. Unterbleibt für einen Tag «i» die Anzeige dieses Satzes auf der Website der Borsa Istanbul, wird der Satz für diesen Tag zwischen den Parteien in gutem Glauben und auf wirtschaftlich vernünftige Weise vereinbart. Können sich die Parteien nicht innerhalb eines Istanbul-*Bankarbeitstags*

ab dem betreffenden Tag «i» einigen, wird als Satz für diesen Tag der Satz herangezogen, der auf der Website der Borsa Istanbul für den unmittelbar vorangegangenen Istanbul-Bankarbeitstag angezeigt wird;

«n_i» die Anzahl der Kalendertage in der betreffenden *Berechnungsperiode*, an denen der Zinssatz der TLREF_i ist; und

«d» die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*.

Teil D: EONIA

1. EONIA Compound Rates

- (a) Verweise auf eine «EONIA Compound Rate» gelten als Verweis auf den «EUR-EONIA-OIS-COMPOUND» oder, wenn sie unter Bezugnahme auf eine *Bloomberg-Seite* bestimmt werden, als Verweis auf den «EUR-EONIA-OIS-COMPOUND-Bloomberg», der gemäss der nachstehenden Formel auf Grundlage des täglichen «Compoundings» berechnet wird (wobei als Referenzzinssatz für die Berechnung des Zinssatzes der Euro Overnight Index Average (EONIA) gilt). Der sich hieraus ergebende Prozentsatz wird ggf. nach dem in Teil A Absatz 3 (i) dieser *ergänzenden Definitionen* festgelegten Verfahren gerundet, wobei die Rundung jedoch auf das nächste Zehntausendstel eines Prozentpunktes (0,0001%) erfolgt. Der Satz für jeden Tag der *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab (einschliesslich) dem EONIA-Index-Einstellungstichtag liegt, wird so bestimmt, als wenn die Verweise auf den EONIA_i Verweise auf den modifizierten EuroSTR_i wären.

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{\text{EONIA}_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

- (b) Für diese Zwecke bedeutet:

«d₀» für jede *Berechnungsperiode* die Anzahl der *TARGET-Abwicklungstage* der betreffenden *Berechnungsperiode*.

ist «i» eine Folge ganzer Zahlen von eins bis d₀, die jeweils die betreffenden *TARGET-Abwicklungstage* in chronologischer Reihenfolge ab (einschliesslich) dem ersten *TARGET-Abwicklungstag* der betreffenden *Berechnungsperiode* darstellen.

ist der «EONIA_i» für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem Tagesgeldsatz entspricht, der, was den EUR-EONIA-OIS-COMPOUND betrifft, für diesen Tag auf der *Bloomberg-Bildschirmseite* EONIA bzw., was den EUR-EONIA-OIS-COMPOUND-Bloomberg betrifft, für diesen Tag auf der *Reuters-Bildschirmseite* ALLX EBFS angezeigt wird.

stellt «n_i» die Anzahl der Kalendertage in der betreffenden *Berechnungsperiode* dar, an denen der Zinssatz EONIA_i ist;

«d» ist die Anzahl der Kalendertage der betreffenden *Berechnungsperiode*.

Für diese Zwecke:

bezeichnet «EONIA-Index-Einstellungsereignis»:

- (1) die Ankündigung des European Money Markets Institute vom 31. Mai 2019, dass EONIA am 3. Januar 2022 abgebrochen werden wird; oder
- (2) den Eintritt eines der folgenden Ereignisse:
 - a. eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen des European Money Markets Institutes (oder eines Nachfolge-Administrators des EONIA), in der mitgeteilt wird, dass es die Bereitstellung des EONIA dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EONIA weiterhin zur Verfügung stellt; oder
 - b. eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den EONIA-Administrator, die Zentralbank für die Währung des EONIA, einen Insolvenzbeauftragten mit Zuständigkeit für den EONIA-Administrator, eine Abwicklungsbehörde mit Zuständigkeit für den EONIA-Administrator, oder ein Gericht oder eine Stelle mit vergleichbarer insolvenz- oder abwicklungsrechtlicher Hoheit über den EONIA-Administrator, in der bekannt gegeben wird, dass der EONIA-Administrator die Bereitstellung des EONIA dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt dieser Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EONIA weiterhin bereitstellt.

bezeichnet «EONIA-Index-Einstellungstichtag» bzw. «Stichtag für Einstellung des EONIA-Index» in Bezug auf das *EONIA-Index-Einstellungsergebnis* das erste Datum, an dem der EONIA nicht mehr zur Verfügung gestellt wird.

bezeichnet «modifizierte EuroSTR_i» für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* den Referenzzinssatz, der dem auf der Website der EZB für diesen Tag veröffentlichten EuroSTR entspricht, zuzüglich 0,085%.

ist «EuroSTR» der kurzfristige Euro-Zinssatz (€STR), der von der Europäischen Zentralbank als Administrator des Referenzzinssatzes (oder einem Nachfolge-Administrator) auf der Website der EZB bereitgestellt wird.

(c) Ersatz für die EuroSTR

Bei Eintritt eines *EuroSTR-Index-Einstellungsergebnisses* wird der Satz für jeden Tag einer *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab einschliesslich dem *EuroSTR-Index-Einstellungstichtag* liegt, so bestimmt, als ob Verweise auf den EONIA_i Verweise auf den EZB-Empfehlungsreferenzsatz_i wären.

Wenn:

- (1) ein solcher Satz nicht vor dem Ende des *TARGET-Abwicklungstags* unmittelbar nach dem Tag empfohlen wird, an dem das *EuroSTR-Index-Einstellungsergebnis* eintritt, dann wird der Satz für jeden Tag einer *Berechnungsperiode* ab (einschliesslich) dem *EuroSTR-Index-Einstellungstichtag* so bestimmt, als wenn Verweise auf den EONIA_i Verweise auf die *modifizierte EDFR* (EONIA)_i wären; oder
- (2) in der Folge ein *Index-Einstellungsergebnis* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz eintritt, dann wird der Zinssatz für jeden Tag einer *Berechnungsperiode* ab einschliesslich dem *Index-Einstellungstichtag* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz so bestimmt, als wenn Verweise auf den EONIA_i Verweise auf die *modifizierte EDFR* (EuroSTR)_i wären.

bezeichnet «EuroSTR-Index-Einstellungsereignis» den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse:

- (1) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen der Europäischen Zentralbank (oder eines Nachfolge-Administrators des EuroSTR), in der mitgeteilt wird, dass sie die Bereitstellung des EuroSTR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EuroSTR weiterhin zur Verfügung stellt; oder
- (2) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den EuroSTR-Administrator, die Zentralbank für die Währung des EuroSTR, einen Insolvenzbeauftragten mit Zuständigkeit für den EuroSTR-Administrator, eine Abwicklungsbehörde mit Zuständigkeit für den EuroSTR-Administrator, oder ein Gericht oder eine Stelle mit vergleichbarer insolvenz- oder abwicklungsrechtlicher Hoheit über den EuroSTR-Administrator, in der bekannt gegeben wird, dass der EuroSTR-Administrator die Bereitstellung der EuroSTR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt dieser Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der die EuroSTR weiterhin bereitstellt;

bezeichnet «EuroSTR-Index-Einstellungstichtag» bzw. «Stichtag für Einstellung des EuroSTR-Index» in Bezug auf EuroSTR-*Index-Einstellungsereignis* das erste Datum, an dem die EuroSTR nicht mehr zur Verfügung gestellt wird.

ist der «EZB-Empfehlungsreferenzsatz_i» für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem von seinem Administrator veröffentlichten oder bereitgestellten EZB-Empfehlungsreferenzsatz für diesen Tag entspricht, zuzüglich 0,085%.

ist der «EZB-Empfehlungsreferenzsatz» der Zinssatz (einschliesslich etwaiger «Spreads» oder Anpassungen), der von der Europäischen Zentralbank (oder einem Nachfolge-Administrator der EuroSTR) und/oder einem Ausschuss, der von der Europäischen Zentralbank (oder einem Nachfolge-Administrator der EuroSTR) offiziell eingesetzt oder einberufen wurde, um einen Ersatz für die EuroSTR zu empfehlen, als Ersatz für die EuroSTR empfohlen wird (wobei dieser Satz von der Europäischen Zentralbank oder einem anderen Administrator erstellt werden kann).

bezeichnet «Index-Einstellungsereignis betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz» den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse:

- (1) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen des Administrators des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, in der mitgeteilt wird, dass er die Bereitstellung des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EZB-Empfehlungsreferenzsatz weiterhin zur Verfügung stellt; oder
- (2) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, die Zentralbank für die Währung des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, einen Insolvenzbeauftragten mit Zuständigkeit für den Administrator des EZB-

Empfehlungsreferenzsatzes, eine Abwicklungsbehörde mit Zuständigkeit für den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, oder ein Gericht oder eine Stelle mit vergleichbarer insolvenz- oder abwicklungsrechtlicher Hoheit über den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, in der bekannt gegeben wird, dass der Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes die Bereitstellung des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt dieser Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EZB-Empfehlungsreferenzsatz weiterhin bereitstellt.

bezeichnet «Index-Einstellungstichtag betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz» in Bezug auf ein *Index-Einstellungseignis* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz das erste Datum, an dem der EZB-Empfehlungszinssatz nicht mehr zur Verfügung gestellt wird. ist die «modifizierte EDFR (EONIA)_i» für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der der *modifizierten EDFR* (EONIA) für diesen Tag entspricht, zuzüglich 0,085%.

bezeichnet «modifizierte EDFR (EONIA)» den von seinem Administrator veröffentlichten oder bereitgestellten Zinssatz für die Einlagefazilität im Eurosystem («Eurosystem Deposit Facility Rate»), zuzüglich des «EDFR-Spreads».

bezeichnet «Eurosystem Deposit Facility Rate» den Zinssatz für die Einlagefazilität, den die Banken für Tagesgeldeinlagen beim Eurosystem verwenden können und der auf der Webseite der EZB veröffentlicht wird; und

unter «EDFR-Spread» versteht man:

- (1) wenn vor dem Ende des *TARGET-Abwicklungstags* unmittelbar nach dem Tag, an dem ein *EuroSTR-Index-Einstellungseignis* eintritt, kein EZB-Empfehlungsreferenzsatz empfohlen wird, das arithmetische Mittel der täglichen Differenz zwischen der EuroSTR und der «Eurosystem Deposit Facility Rate» während eines Beobachtungszeitraums von 30 *TARGET-Abwicklungstagen*, wobei dieser Zeitraum 30 *TARGET-Abwicklungstage* vor dem Tag des Eintritts des *EuroSTR-Index-Einstellungseignisses* beginnt und am *TARGET-Abwicklungstag* unmittelbar vor dem Tag des Eintritts des *EuroSTR-Index-Einstellungseignisses* endet; oder
- (2) im Fall des Eintritts eines *Index-Einstellungseignisses* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz das arithmetische Mittel der täglichen Differenz zwischen dem EZB-Empfehlungsreferenzsatz und der «Eurosystem Deposit Facility Rate» während eines Beobachtungszeitraums von 30 *TARGET-Abwicklungstagen*, wobei dieser Zeitraum 30 *TARGET-Abwicklungstage* vor dem Tag des Eintritts des *Index-Einstellungseignisses* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz beginnt und am *TARGET-Abwicklungstag* unmittelbar vor dem Tag des Eintritts des *Index-Einstellungseignisses* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz endet.

2. EONIA Average

- (a) Verweise auf einen EONIA-Durchschnittssatz gelten als Verweise auf den «EUR-EONIA-AVERAGE», der nach der nachstehenden Formel als der durchschnittliche Monatsatz des täglichen Euro-Overnight-Index-Average (EONIA) berechnet und dahingehend angepasst wird, dass die exakte Anzahl Tage im betreffenden Monat berücksichtigt wird. Der Satz für jeden Tag der *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab einem EONIA-Index-

Einstellungstichtag liegt, wird so bestimmt, als wenn Verweise auf den EONIA_i Verweise auf die *modifizierte* EuroSTR_i wären.

$$\frac{100}{D} \times \left[\sum_{i=1}^{i=D} \text{EONIA}_i \right]$$

(b) Für diese Zwecke bedeutet:

«EONIA_i» für jeden Tag «i» in der *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem Tagesgeldsatz entspricht, der auf der *Reuters-Bildschirmseite* EONIA für diesen Tag, wenn es sich bei diesem Tag um einen *TARGET-Abwicklungstag* handelt, oder für den *TARGET-Abwicklungstag* unmittelbar vor diesem Tag, wenn es sich bei diesem Tag nicht um einen *TARGET-Abwicklungstag* handelt, angezeigt wird.

«D», für den Monat der *Berechnungsperiode*, die Anzahl der Kalendertage in diesem Monat.

«i» eine Reihe ganzer Zahlen von eins bis D, die jeweils im Monat der *Berechnungsperiode* die betreffenden Kalendertage in diesem Monat in chronologischer Reihenfolge ab (einschliesslich) dem ersten Tag dieses Monats bis zum (einschliesslich) dem letzten Tag dieses Monats darstellen.

bezeichnet «EONIA-Index-Einstellungsereignis»:

(1) die Ankündigung des European Money Markets Institute vom 31. Mai 2019, dass EONIA am 3. Januar 2022 abgebrochen werden wird; oder

(2) den Eintritt eines der folgenden Ereignisse:

a. eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen des European Money Markets Institutes (oder eines Nachfolge-Administrators des EONIA), in der mitgeteilt wird, dass es die Bereitstellung des EONIA dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EONIA weiterhin zur Verfügung stellt; oder

b. eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den EONIA-Administrator, die Zentralbank für die Währung des EONIA, einen Insolvenzbeauftragten mit Zuständigkeit für den EONIA-Administrator, eine Abwicklungsbehörde mit Zuständigkeit für den EONIA-Administrator, oder ein Gericht oder eine Stelle mit vergleichbarer insolvenz- oder abwicklungsrechtlicher Hoheit über den EONIA-Administrator, in der bekannt gegeben wird, dass der EONIA-Administrator die Bereitstellung des EONIA dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt dieser Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EONIA weiterhin bereitstellt.

bezeichnet «EONIA-Index-Einstellungstichtag» bzw. «Stichtag für Einstellung des EONIA-Index» in Bezug auf das *EONIA-Index-Einstellungsereignis* das erste Datum, an dem der EONIA nicht mehr zur Verfügung gestellt wird.

bezeichnet «modifizierte EuroSTR_i» für jeden Tag «i» in der betreffenden Berechnungsperiode den Referenzzinssatz, welcher der auf der EZB-Website veröffentlichten EuroSTR für diesen Tag, wenn dieser Tag ein *TARGET-Abwicklungstag* ist, oder für den unmittelbar vor diesem Tag liegenden *TARGET-Abwicklungstag*, wenn dieser Tag kein *TARGET-Abwicklungstag* ist, entspricht, zuzüglich 0,085%.

ist «EuroSTR» der kurzfristige Euro-Zinssatz (€STR), der von der Europäischen Zentralbank als Administrator des Referenzzinssatzes (oder einem Nachfolge-Administrator) auf der Website der EZB bereitgestellt wird.

(c) Ersatz für die EuroSTR

Bei Eintritt eines *EuroSTR-Index-Einstellungsereignisses* wird der Satz für jeden Tag einer *Berechnungsperiode*, der in der Zeit ab einschliesslich dem *EuroSTR-Index-Einstellungstichtag* liegt, so bestimmt, als ob Verweise auf den EONIA_i Verweise auf den EZB-Empfehlungsreferenzzinssatz_i wären.

Wenn:

- (1) ein solcher Satz nicht vor dem Ende des *TARGET-Abwicklungstags* unmittelbar nach dem Tag empfohlen wird, an dem das *EuroSTR-Index-Einstellungsereignis* eintritt, dann wird der Satz für jeden Tag einer *Berechnungsperiode* ab (einschliesslich) dem *EuroSTR-Index-Einstellungstichtag* so bestimmt, als wenn Verweise auf den EONIA Verweise auf die *modifizierte EDFR* (EONIA)_i wären; oder
- (2) in der Folge ein *Index-Einstellungsereignis* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzzinssatz eintritt, dann wird der Zinssatz für jeden Tag einer *Berechnungsperiode* ab einschliesslich dem *Index-Einstellungstichtag* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzzinssatz so bestimmt, als wenn Verweise auf den EONIA_i Verweise auf die *modifizierte EDFR* (EuroSTR)_i wären.

Für diese Zwecke:

bezeichnet «EuroSTR-Index-Einstellungsereignis» den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse:

- (1) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen der Europäischen Zentralbank (oder eines Nachfolge-Administrators des EuroSTR), in der mitgeteilt wird, dass sie die Bereitstellung des EuroSTR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EuroSTR weiterhin zur Verfügung stellt; oder
- (2) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den EuroSTR-Administrator, die Zentralbank für die Währung des EuroSTR, einen Insolvenzbeauftragten mit Zuständigkeit für den EuroSTR-Administrator, eine Abwicklungsbehörde mit Zuständigkeit für den EuroSTR-Administrator, oder ein Gericht oder eine Stelle mit vergleichbarer insolvenz- oder abwicklungsrechtlicher Hoheit über den EuroSTR-Administrator, in der bekannt gegeben wird, dass der EuroSTR-Administrator die Bereitstellung der EuroSTR dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt dieser Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der die EuroSTR weiterhin bereitstellt.

bezeichnet «EuroSTR-Index-Einstellungstichtag» bzw. «Stichtag für Einstellung des EuroSTR-Index» in Bezug auf *EuroSTR-Index-Einstellungsereignis* das erste Datum, an dem die EuroSTR nicht mehr zur Verfügung gestellt wird.

ist der «EZB-Empfehlungsreferenzsatz_i» für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* ein Referenzzinssatz, der dem von seinem Administrator veröffentlichten oder bereitgestellten EZB-Empfehlungszinssatz für diesen Tag, wenn dieser Tag ein *TARGET-Abwicklungstag* ist, oder für den *TARGET-Abwicklungstag* unmittelbar vor diesem Tag, wenn dieser Tag kein *TARGET-Abwicklungstag* ist, entspricht, zuzüglich 0,085%;

ist der «EZB-Empfehlungsreferenzsatz» der Zinssatz (einschliesslich etwaiger «Spreads» oder Anpassungen), der von der Europäischen Zentralbank (oder einem Nachfolge-Administrator der EuroSTR) und/oder einem Ausschuss, der von der Europäischen Zentralbank (oder einem Nachfolge-Administrator der EuroSTR) offiziell eingesetzt oder bestätigt wurde, um einen Ersatz für die EuroSTR zu empfehlen, als Ersatz für die EuroSTR empfohlen wird (wobei dieser Satz von der Europäischen Zentralbank oder einem anderen Administrator erstellt werden kann).

Bezeichnet «Index-Einstellungsereignis betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz» bezeichnet den Eintritt eines oder mehrerer der folgenden Ereignisse:

- (1) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch oder im Namen des Administrators des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, in der mitgeteilt wird, dass er die Bereitstellung des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt der Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EZB-Empfehlungsreferenzsatz weiterhin zur Verfügung stellt; oder
- (2) eine öffentliche Erklärung oder Veröffentlichung von Informationen durch die Aufsichtsbehörde mit Zuständigkeit für den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, die Zentralbank für die Währung des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, einen Insolvenzbeauftragten mit Zuständigkeit für den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, eine Abwicklungsbehörde mit Zuständigkeit für den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, oder ein Gericht oder eine Stelle mit vergleichbarer insolvenz- oder abwicklungsrechtlicher Hoheit über den Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes, in der bekannt gegeben wird, dass der Administrator des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes die Bereitstellung des EZB-Empfehlungsreferenzsatzes dauerhaft oder auf unbestimmte Zeit eingestellt hat oder einstellen wird, sofern es zum Zeitpunkt dieser Erklärung oder Veröffentlichung keinen Nachfolge-Administrator gibt, der den EZB-Empfehlungsreferenzsatzes weiterhin bereitstellt.

bezeichnet «Index-Einstellungstichtag betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz» in Bezug auf ein *Index-Einstellungsereignis* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz das erste Datum, an dem der EZB-Empfehlungszinssatz nicht mehr zur Verfügung gestellt wird.

«modifizierte EDFR (EONIA)_i» ist für jeden Tag «i» in der betreffenden *Berechnungsperiode* einen Referenzzinssatz, der dem *modifizierten EDFR* (EONIA) für diesen Tag, wenn dieser Tag ein *TARGET-Abwicklungstag* ist, oder für den unmittelbar vor diesem Tag liegenden *TARGET-Abwicklungstag*, wenn dieser Tag kein *TARGET-Abwicklungstag* ist, entspricht, zuzüglich 0,085%.

bezeichnet «modifizierte EDFR (EONIA)» den von seinem Administrator veröffentlichten oder bereitgestellten Zinssatz für die Einlagefazilität im Eurosystem (Eurosystem Deposit Facility Rate), zuzüglich des «EDFR-Spreads».

bezeichnet «Eurosystem Deposit Facility Rate» den Zinssatz für die Einlagefazilität, den die Banken für Tagesgeldeinlagen beim Eurosystem verwenden können und der auf der Webseite der EZB veröffentlicht wird; und

unter «EDFR-Spread» versteht man:

- (1) wenn vor dem Ende des *TARGET-Abwicklungstags* unmittelbar nach dem Tag, an dem ein *EuroSTR-Index-Einstellungsereignis* eintritt, kein EZB-Empfehlungsreferenzsatz empfohlen wird, das arithmetische Mittel der täglichen Differenz zwischen der EuroSTR und der «Eurosystem Deposit Facility Rate» während eines Beobachtungszeitraums von 30 *TARGET-Abwicklungstagen*, wobei dieser Zeitraum 30 *TARGET-Abwicklungstage* vor dem Tag des Eintritts des *EuroSTR-Index-Einstellungsereignisses* beginnt und am *TARGET-Abwicklungstag* unmittelbar vor dem Tag des Eintritts des *EuroSTR-Index-Einstellungsereignisses* endet; oder
- (2) im Fall des Eintritts eines *Index-Einstellungsereignisses* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz das arithmetische Mittel der täglichen Differenz zwischen dem EZB-Empfehlungsreferenzsatz und der «Eurosystem Deposit Facility Rate» während eines Beobachtungszeitraums von 30 *TARGET-Abwicklungstagen*, wobei dieser Zeitraum 30 *TARGET-Abwicklungstage* vor dem Tag des Eintritts des *Index-Einstellungsereignisses* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz beginnt und am *TARGET-Abwicklungstag* unmittelbar vor dem Tag des Eintritts des *Index-Einstellungsereignisses* betreffend den EZB-Empfehlungsreferenzsatz endet.