

## ANHANG V

[Anhang V](#) der Durchführungsverordnung (EU) 2016/2070 wird wie folgt geändert:

(1) In Abschnitt 1 („Erläuterungen“) erhalten die Buchstaben b, aa und ff folgende Fassung:

„b) Hierfür gelten folgende Daten:

(i) Buchungsdatum ist der 17. September 2020;

(ii) IMV-Referenzdatum ist der 24. September 2020 (17.30 Uhr MEZ);

(iii) IMV-Einreichungstermin ist der 2. Oktober 2020;

(iv) erstes RM-Referenzdatum ist der 18. Januar 2021;

(v) letztes RM-Referenzdatum ist der 29. Januar 2021;

(vi) RM-Einreichungstermin ist der 26. Februar 2021.“

„(aa) Falls notwendig, wenden die Institute zur Ersetzung der in Abschnitt 2 genannten Referenzzinssätze („EURIBOR“) und („LIBOR“) die EU-Benchmark-Verordnung für die Zinssätze an. Hierbei geben die Institute in dem unter Buchstabe d genannten erläuternden Vermerk an, welchen alternativen Satz sie anstatt der Referenzzinssätze („EURIBOR“) und („LIBOR“) verwenden.“

„(ff) In Abschnitt 2 („Instrumente“): Jahr T = 2021; Zusätzlich dazu gilt: Jahr T + X = 2021 + X (X gemäß Festlegung in Abschnitt 2.“

(2) In Abschnitt 1 („Erläuterungen“) wird folgender Buchstabe mm angefügt:

„(mm) Die Risikomessgrößen der Portfolios werden in der Währung berechnet, auf die auch das Portfolio lautet, und schließen keinerlei Wechselkursrisiko ein, auch nicht in Bezug auf die Meldewährung der Institute. Das Wechselkursrisiko ist nur dann zu berücksichtigen, wenn es untrennbar mit den Instrumenten verbunden ist.“

(3) In Abschnitt 2 („Instrumente“) erhalten die Nummern 17, 18, 27, 34, 38 und 39 folgende Fassung:

„17. Shortposition Future NIKKEI 225 (Ticker NKY) (1 P. = 500 JPY)

Börse: CME

Verfallstag: 11. Juni Jahr T

Basiswährung: JPY“

„18. Aktienprodukt, Auto-Callable

Longposition

Buchung zum ‚Buchungszeitpunkt‘

Nominalbetrag („Kapital“): 1 000 000

Basiswert: Index EURO STOXX 50 (Ticker: SX5E)

Basiswährung: EUR

Laufzeit: 5 Jahre

Jährliche Auszahlung und jährliche Beobachtung („Buchungszeitpunkt + 1 Jahr“, „Buchungszeitpunkt + 2 Jahre“, „Buchungszeitpunkt + 3 Jahre“, „Buchungszeitpunkt + 4 Jahre“, „Buchungszeitpunkt + 5 Jahre“). Die Auszahlung erfolgt 10 Tage nach dem Stichtag.

Kupon: 6 %

Autocall-Level (ursprünglicher Wert): Buchungszeitpunkt Tagesschluss - 1 Jahr

Barriere Kuponzahlung: 60 % des Autocall-Levels

Schutzbarriere: 55 % des Autocall-Levels

- Keine Kapitalgarantie, falls der Index unter der Schutzbarriere liegt (bei der Kapitalrendite ab dem fünften Jahr handelt es sich um eine anteilige Rendite, sofern das Level unterhalb der Schutzbarriere liegt: so liegt beispielsweise die Kapitalrendite bei 40 %, wenn  $SX5E = 40\%$  des ursprünglichen Levels).
- Falls  $SX5E \geq 60\%$  (Barriere Kupon) des ursprünglichen Werts zum Ende eines Jahres, wird ein Kupon von 6 % ausbezahlt.
- Falls  $SX5E \geq 100\%$  des ursprünglichen Werts zum Ende eines Jahres, erfolgt ein Produkt-Call und die Auszahlung umfasst Kupon und Kapital (100 %).
- Falls  $SX5E < 60\%$  (Barriere Kupon) des ursprünglichen Werts zum Ende eines Jahres, wird kein Kupon ausbezahlt.
- Falls  $SX5E < 55\%$  (Schutzbarriere) des ursprünglichen Werts zum Ende von Jahr 5, wird das Kapital nur anteilig ausbezahlt. Falls  $SX5E \geq 55\%$  (Schutzbarriere) des ursprünglichen Werts zum Ende von Jahr 5, wird das Kapital vollständig ausbezahlt.“

„27. Longposition ITALY GOVT EUR 1 000 000 (ISIN IT0004953417)

Fälligkeit: 1. März 2024

Basiswährung: EUR“

„34. Longposition BRAZIL GOVT 5 000 000 USD (ISIN US105756AR10)

Fälligkeit: 15. April 2024

Basiswährung: USD“

„38. 6-monatiger USD/EUR Forward-Vertrag. Cash-settled. USD Long – EUR Short; Nominal 10 000 000 USD; EUR/USD-EZB-Referenzkurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum.

Basiswährung: EUR“

„39. 6-monatiger EUR/GBP Forward-Vertrag. Cash-settled. EUR Long – GBP Short; Nominal 10 000 000 GBP; EUR/GBP-EZB-Referenzkurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum.“

Basiswährung: EUR“

(4) In Abschnitt 5 („Instrument zusätzliche Spezifikationen“) wird in Spalte 2 Zeile 6 das Wort „einschließlich“ durch das Wort „Ohne“ ersetzt. (Anm. d. Red.: das Wort "einschließlich" ist in Absch. 5 nicht vorhanden)