

Information über die Befreiung von der Besicherungspflicht für gruppeninterne OTC-Derivatgeschäfte unter EMIR

Die Österreichische Finanzmarktaufsicht (FMA) hat dem Antrag der BAWAG P.S.K. - Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft auf Befreiung von der Besicherungspflicht für die zwischen den unten genannten, derselben Gruppe angehörenden Gegenparteien abgeschlossenen OTC-Derivatekontrakte stattgegeben. Wir erwarten, dass die De Nederlandsche Bank (DNB) dem Antrag der Knab N.V. auf Befreiung von der Besicherungspflicht für die zwischen den unten genannten, derselben Gruppe angehörenden Gegenparteien abgeschlossenen OTC-Derivatekontrakte in Kürze stattgegeben wird.

Veröffentlichung nach Art. 11 Abs. 14 lit. d EMIR i.V.m. Art. 20 Delegierte Verordnung (EU) 149/2013

a) Rechtmäßige Gegenparteien der Transaktionen:

- BAWAG P.S.K. - Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft (AT; LEI: 529900ICA8XQYGIKR372)
- Knab N.V. (NL; LEI: 549300772D1G8JPIUR96)

b) Beziehung zwischen den Gegenparteien:

Die unter a) genannten Gegenparteien gehören derselben Gruppe an, wobei es sich bei BAWAG P.S.K. um die Konzernmutter und Knab N.V. um die Konzerntochter handelt.

c) Umfang der Befreiung:

Die Befreiung ist für den Austausch von Ersteinschüssen gemäß Art. 1 Abs. 1 Delegierte Verordnung (EU) Nr. 2016/2251 gültig.

d) Gesamtnennbetrag der OTC-Derivatekontrakte:

Das Brutto-Nominalvolumen pro Jahr der OTC-Derivatekontrakte, für die die Befreiung gruppeninterner Geschäfte gilt, beträgt:

- Währungsderivate: EUR 960 Mio mit Laufzeiten bis zu 1 Jahr
- Zinsderivate: EUR 4.875 Mio mit Laufzeiten bis zu 31 Jahren