**ANNEX B ZUR MITTEILUNG GEMÄSS DEN ARTIKEL 11 (6-10) DER VERORDNUNG 648/2012 (EMIR) BETREFFEND DIE AUSNAHME FÜR GRUPPENINTERNE GESCHÄFTE VON DER BESICHERUNGSPFLICHT**

**Angaben zu Artikel 18 (2) delegierte Verordnung (EU) 149/2013**

Die Mitteilung an die zuständige Behörde mit den Einzelheiten des gruppeninternen Geschäfts erfolgt schriftlich und enthält u.a. folgende Angaben:

* Im Rahmen ihres Antrags bzw. der Benachrichtigung der zuständigen Behörde übermittelt eine Gegenpartei außerdem zusätzliche Informationen, die belegen, dass die Bedingungen des Artikels 11 Absätze 6 bis 10 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erfüllt sind. Diese Belege umfassen Kopien historische Transaktionsdaten.

Bitte fügen Sie in den folgenden Tabellen eine Aufstellung historischer Daten bei. Dabei sollen die OTC-Derivategeschäfte aufgeführt werden, die zwischen den Gegenparteien in den letzten 12 Monaten in den Asset-Klassen, für die eine Ausnahme von der Besicherungspflicht beantragt wird, getätigt worden sind. Aus der Übersicht sollte jeweils das Brutto- und Nettonominalvolumen je Asset-Klasse auf Monatsbasis in Mio. EUR hervorgehen. Sollten solche Daten nicht für die letzten 12 Monate vorliegen, so stellen Sie bitte die Daten für den verfügbaren Zeitraum zusammen und legen dar, warum die Daten nicht 12 Monate umfassen.

Das unten angegebene Format ist zu übernehmen, kann jedoch in anderen Formaten (z.B. Excel) übernommen werden.

***Information regarding article 18(2) delegated regulation (EU) 149/2013***

*The application or notification to the competent authority of the details of the intragroup transaction shall include:*

* *As part of its application or notification to the relevant competent authority, a counterparty shall also submit supporting information evidencing that the conditions of Article 11(6) to (10) of Regulation (EU) No 648/2012 are fulfilled. The supporting documents shall include historical transaction information.*

*The table below contains historical transaction information on a monthly basis for a time period of the last 12 months (if not available, provide the data for a shorter period and state the reasons for that):*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Pairing: IGT Counterparty 1 – IGT Counterparty 2** | | | | | | | | | | | | | |
| **Assetclass** |  | **COMMODITY** | | **CREDIT** | | **CURRENCY** | | **EQUITY** | | **INTEREST RATE** | | **OTHER** | |
| **Gross/Net** |  | **GNV[[1]](#footnote-1)** | **NNV[[2]](#footnote-2)** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** |
| **Month/Year** | Jan xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Feb xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Mar xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Apr xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | May xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Jun xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Jul xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Aug xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Sep xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Oct xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Nov xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Dec xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Pairing: IGT Counterparty 3 – IGT Counterparty 4** | | | | | | | | | | | | | |
| **Assetclass** |  | **CO** | | **CR** | | **CU** | | **EQ** | | **IR** | | **OT** | |
| **Gross/Net** |  | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** |
| **Month/Year** | Jan xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Feb xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Mar xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Apr xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | May xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Jun xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Jul xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Aug xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Sep xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Oct xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Nov xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Dec xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Pairing: IGT Counterparty 5 – IGT Counterparty 6** | | | | | | | | | | | | | |
| **Assetclass** |  | **CO** | | **CR** | | **CU** | | **EQ** | | **IR** | | **OT** | |
| **Gross/Net** |  | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** | **GNV** | **NNV** |
| **Month/Year** | Jan xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Feb xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Mar xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Apr xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | May xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Jun xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Jul xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Aug xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Sep xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Oct xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Nov xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | Dec xx |  | |  | |  | |  | |  | |  | |

Tbc for all pairs….

1. GNV – Gross Nominal Volume [↑](#footnote-ref-1)
2. NNV – Net Nominal Volume [↑](#footnote-ref-2)