

Anhang für Devisengeschäfte und Devisenoptionen zum Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte

Vertragsdatum: [●]

zwischen	[●]
	(im folgenden "Bank" genannt)
und	[●]
	(im folgenden "Vertragspartner" genannt)

§ 1 - Zweck und Gegenstand des Anhanges

- 1) Ergänzend zu den Bestimmungen des Rahmenvertrages gelten für Devisengeschäfte und Optionen auf solche Geschäfte ("Devisenoptionen") die nachfolgenden Bestimmungen.
- 2) Der Rahmenvertrag und dieser Anhang gelten für Devisengeschäfte und Devisenoptionen, die zwischen den Parteien abgeschlossen werden, unabhängig von einer Bezugnahme im Einzelabschluss auf den Rahmenvertrag.

§ 2 - Begriffsbestimmungen

- 1) Im Sinne dieses Anhanges ist:
 - "**Ausübungsfrist**" der Zeitraum, der an dem im Einzelabschluss genannten Anfangsdatum beginnt und am Verfalltag endet; ist im Einzelabschluss kein Anfangsdatum genannt, beginnt die Ausübungsfrist am Abschlusstag;
 - "**Ausübungsstelle**" die im Einzelabschluss als solche bezeichnete Stelle des Verkäufers, mangels einer solchen Stelle die die Devisenoption abschließende Stelle des Verkäufers, die Ausübungsstelle ist Finanzplatz im Sinne von § 4 des Rahmenvertrages;
 - "**Ausübungstag**" der Bankarbeitstag, an dem die im Einzelabschluss bestimmte Devisenoption ausgeübt wird oder als ausgeübt gilt;
 - "**Ausübungszeitpunkt**" die im Einzelabschluss so bezeichnete Uhrzeit oder, wenn im Einzelabschluss keine Uhrzeit vereinbart wurde, 10:00 Uhr New Yorker Zeit.
 - "**Berechnungsstelle**" die im Einzelabschluss benannte Partei, mangels einer solchen Benennung die Bank oder wenn beide Vertragsparteien Banken sind die Bank, welche die jeweilige Einzelabschlussbestätigung erstellt hat;
 - "**Devisengeschäft**" jedes Kassa- oder Termingeschäft, das den Austausch eines einzelnen Betrages einer Währung oder Rechnungseinheit zum Gegenstand hat;
 - "**Käufer**" der Käufer der Devisenoption;
 - "**Verfalltag**" der im Einzelabschluss bestimmte Verfalltag oder, falls dieser kein Bankarbeitstag ist, der nächstfolgende Bankarbeitstag.
 - "**Verkäufer**" der Verkäufer der Devisenoption;
- 2) Maßgeblicher Finanzplatz für die Bestimmung des Bankarbeitstages ist bezüglich des Absatzes 1 und § 4 Abs. 1 b) der Ort, an dem sich die Ausübungsstelle befindet, und bezüglich § 3 Abs. 3 der dort bezeichnete Ort.

§ 3 - Zahlungen

- 1) Geschuldete Zahlungen im Sinne von § 3 Abs. 1 des Rahmenvertrages sind bei Devisengeschäften und ausgeübten Devisenoptionen die jeweils im Einzelabschluss genannten Beträge. Diese Beträge sind zwei Bankarbeitstage nach Abschluss des Devisengeschäftes oder der Ausübung der Devisenoption fällig.
- 2) Der Käufer einer Devisenoption ist verpflichtet, die im Einzelabschluss vereinbarte Devisenoptionsprämie zwei Bankarbeitstage nach Abschluss an den Verkäufer zu zahlen.
- 3) Ist ein Fälligkeitstag kein Bankarbeitstag an dem Ort, an dem das Konto des Zahlungsempfängers unterhalten wird, so gilt für die Zahlungen beider Parteien an diesem Tag aus dem betroffenen Einzelabschluss § 3 Abs. 6 b) des Rahmenvertrages.
- 4) Leistet eine Partei den von ihr aus einem Devisengeschäft oder einer ausgeübten Devisenoption geschuldeten Betrag am Fälligkeitstag oder an dem sich aus Abs. 3 ergebenden späteren Tag nicht oder nicht vollständig, so ist die andere Partei berechtigt, anstelle der noch geschuldeten Leistungen unverzüglich durch Erklärung gegenüber der säumigen Partei Erfüllung durch Ausgleichszahlungen zuzüglich Zinsen gemäß § 3 Abs. 4 des Rahmenvertrages ab dem Fälligkeitstag zu wählen. Die Höhe der Ausgleichszahlung wird von der ersatzberechtigten Partei entsprechend § 8 Abs. 1 des Rahmenvertrages in einer der betroffenen Währungen ermittelt.

§ 4 - Ausübung einer Devisenoption

- 1) a) Der Käufer einer Europäischen Devisenoption ist berechtigt, diese bis zum Ausübungszeitpunkt am Verfalltag auszuüben. Geht die Ausübungserklärung vor dem Verfalltag zu, gilt die Devisenoption als am Verfalltag ausgeübt.
 - b) Der Käufer einer amerikanischen Devisenoption ist berechtigt, diese jederzeit innerhalb der Ausübungsfrist bis zum Ausübungszeitpunkt am Verfalltag auszuüben. Geht die Ausübungserklärung vor Beginn der Ausübungsfrist zu, gilt die Devisenoption als am ersten Tag der Ausübungsfrist ausgeübt. Geht die Erklärung an einem Tag vor dem Verfalltag nach dem Ausübungszeitpunkt oder an einem Tag, der kein Bankarbeitstag ist, zu, so gilt die Devisenoption als am darauf folgenden Bankarbeitstag ausgeübt.

- 2) Die Ausübungserklärung ist an die Ausübungsstelle zu richten. Sie ist unwiderruflich.
- 3) Falls der Käufer dem Verkäufer nichts Gegenteiliges mitteilt, gilt eine nicht ausgeübte Devisenoption als am Verfalltag ausgeübt, wenn sie am Ausübungszeitpunkt mindestens [●] % im Geld ("in-the-money") ist.

§ 5 - Besondere Vereinbarungen

Die folgenden Absätze gelten nur, soweit die dazu bestimmten Felder angekreuzt sind.

- § 1 Abs. 2 gilt auch für bereits abgeschlossene Devisengeschäfte und Devisenoptionen.
- § 4 Abs. 3 gilt nicht

[BANK]

Name:

Name:

[VERTRAGSPARTNER]

Name:

Name: