

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

Informationen über die Befreiung von gruppeninternen Geschäften von der Besicherungspflicht nach EMIR

1. Hintergrund und Zweck dieser Veröffentlichung

Unter EMIR (European Market Infrastructure Regulation) besteht für festgelegte Marktteilnehmer eine Verpflichtung zur Besicherung von nicht zentral geclearten OTC-Derivaten. Allerdings besteht die Möglichkeit gruppeninterne Geschäfte von dieser Pflicht zu befreien. Die ING-DiBa AG und die ING Bank N.V. haben jeweils bei den zuständigen Aufsichtsbehörden (BaFin bzw. De Nederlandsche Bank) einen Folgeantrag auf Befreiung von der Besicherungspflicht gestellt.

Seitens der BaFin wurde der aktuelle Folgeantrag der ING-DiBa AG am 20.10.2022 und seitens DNB am 02.12.2019 bewilligt.

Die Veröffentlichung der Informationen über die Befreiung gruppeninterner Geschäfte findet im Einklang mit den Anforderungen gemäß Art. 11 Abs. 14 d) EMIR i.V.m. Art. 20 Delegierte Verordnung (EU) 149/2013 statt.

2. Beteiligte Parteien

Die Befreiung bezieht sich auf gruppeninterne Geschäfte zwischen den beiden folgenden Gegenparteien:

ING-DiBa AG
Theodor-Heuss-Allee 2
60486 Frankfurt am Main
Deutschland
LEI: 3KXUNHVVQFIJN6RHLO76

ING Bank N.V.
Bijlmerplein 888
Amsterdam, 1102 MG
Niederlande
LEI: 3TK20IVIUJ8J3ZU0QE75

3. Gruppenstruktur

Die ING-DiBa AG ist ein Tochterunternehmen der ING Bank N.V.. Weitere Details zur Gruppenstruktur, Konsolidierung und zum Verhältnis zwischen der ING-DiBa AG sowie der ING Bank N.V. sind im Geschäftsbericht ersichtlich.

4. Befreiung

Die Gruppenausnahme gilt nur für den Austausch von Initial Margin (IM). Die Gegenparteien tauschen weiterhin Variation Margin (VM) aus.

5. Geschäftsvolumen

Die Befreiung umfasst gruppeninterne OTC-Geschäfte zwischen den oben genannten Kontrahenten für ein jährliches Volumen pro Assetklasse:

1. Rohstoffderivate: 5 Mrd. EUR Nominalvolumen
2. Kreditderivate: 5 Mrd. EUR Nominalvolumen
3. Währungsderivate: 40 Mrd. EUR Nominalvolumen
4. Aktienderivate: 5 Mrd. EUR Nominalvolumen
5. Zinsderivate: 350 Mrd. EUR Nominalvolumen