Helaba

# Systematische Internalisierung für Derivate

## Aufstellung der Assetklassen und Unterkategorien (sog. Sub-Classes)



Werte, die bewegen.



Herausgeber:

**Helaba**
Capital Markets
Neue Mainzer Straße 52–58
60311 Frankfurt am Main
T +49 69/91 32–01

Die vorliegende Kundeninformation basiert auf den Entscheidungen der Landesbank Hessen-Thüringen, im Rahmen der MiFID und MiFIR.

Im nachfolgenden Text wird die Landesbank Hessen-Thüringen im Sinne einer besseren Lesbarkeit des Textes kurz „die Bank“ genannt.

Alle Angaben wurden sorgfältig ermittelt, für Richtigkeit und Vollständigkeit kann jedoch keine Gewähr übernommen werden. Dieses Werk einschließlich aller seiner Teile ist urheberrechtlich geschützt. Jede Verwertung außerhalb der engen Grenzen des Urheberrechtsgesetzes ist ohne Zustimmung der Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale unzulässig und strafbar. Das gilt insbesondere für Vervielfältigungen, Übersetzungen, Mikroverfilmungen und die Einspeicherung und Verarbeitung in elektronischen Systemen.

© 2020 Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale

# Inhaltsverzeichnis


1 Allgemeine Hinweise 4

2 Aufstellung der MIFID Asset-Classes und Sub-Asset-Classes 4

# 1 Allgemeine Hinweise

**Die Bank hat sich erstmalig zum 15.09.2020 pflichtgemäß als systematischer Internalisierer gem. §2 Abs. 8 Nr. 2 lit. b. WpHG für an einem EU Handelsplatz handelbare Derivate klassifiziert.**
**Die Bank klassifiziert sich grundsätzlich nicht freiwillig für eine gesamte Assetklasse als Systematischer Internalisierer, sondern qualifiziert sich durch das Überschreiten von Schwellenwerten für einzelne Instrumente bzw. Unterkategorien (sog. „Sub Classes“) dieser Assetklasse.**

# 2 Aufstellung der MIFID Asset-Classes und Sub-Asset-Classes

| | MIFID_Asset_Class | MIFID_Sub_Asset_Class | Criteria-1 | Criteria-2 | Criteria-3 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | CRDT | ICDS | ITRAXX EUROPE 6Y | EUR | TTM_4Y_5Y |
| 2 | CURR | DLFR | CAD\|EUR | TTM_1W_3M | |
| 3 | CURR | DLFR | CAD\|EUR | TTM_3M_1Y | |
| 4 | CURR | DLFR | CAD\|EUR | TTM_1Y_2Y | |
| 5 | CURR | DLFR | CHF\|EUR | TTM_1W_3M | |
| 6 | CURR | DLFR | CHF\|EUR | TTM_3M_1Y | |
| 7 | CURR | DLFR | CHF\|EUR | TTM_1Y_2Y | |
| 8 | CURR | DLFR | CNY\|EUR | TTM_3M_1Y | |
| 9 | CURR | DLFR | CNY\|EUR | TTM_1W_3M | |
| 10 | CURR | DLFR | CZK\|EUR | TTM_1W_3M | |
| 11 | CURR | DLFR | CZK\|EUR | TTM_3M_1Y | |
| 12 | CURR | DLFR | CZK\|EUR | TTM_1Y_2Y | |
| 13 | CURR | DLFR | DKK\|EUR | TTM_1W_3M | |
| 14 | CURR | DLFR | DKK\|EUR | TTM_3M_1Y | |
| 15 | CURR | DLFR | EUR\|GBP | TTM_0_1W | |
| 16 | CURR | DLFR | EUR\|GBP | TTM_1W_3M | |
| 17 | CURR | DLFR | EUR\|GBP | TTM_3M_1Y | |
| 18 | CURR | DLFR | EUR\|GBP | TTM_1Y_2Y | |
| 19 | CURR | DLFR | EUR\|HKD | TTM_1W_3M | |
| 20 | CURR | DLFR | EUR\|HUF | TTM_1W_3M | |
| 21 | CURR | DLFR | EUR\|HUF | TTM_3M_1Y | |
| 22 | CURR | DLFR | EUR\|HUF | TTM_1Y_2Y | |
| 23 | CURR | DLFR | EUR\|JPY | TTM_1W_3M | |
| 24 | CURR | DLFR | EUR\|JPY | TTM_3M_1Y | |
| 25 | CURR | DLFR | EUR\|JPY | TTM_1Y_2Y | |
| 26 | CURR | DLFR | EUR\|NOK | TTM_1W_3M | |
| 27 | CURR | DLFR | EUR\|NOK | TTM_3M_1Y | |
| 28 | CURR | DLFR | EUR\|NOK | TTM_1Y_2Y | |
| 29 | CURR | DLFR | EUR\|PLN | TTM_0_1W | |
| 30 | CURR | DLFR | EUR\|PLN | TTM_1W_3M | |
| 31 | CURR | DLFR | EUR\|PLN | TTM_3M_1Y | |
| 32 | CURR | DLFR | EUR\|SEK | TTM_1W_3M | |
| 33 | CURR | DLFR | EUR\|SEK | TTM_3M_1Y | |
| 34 | CURR | DLFR | EUR\|SEK | TTM_1Y_2Y | |
| 35 | CURR | DLFR | EUR\|USD | TTM_0_1W | |
| 36 | CURR | DLFR | EUR\|USD | TTM_1W_3M | |
| 37 | CURR | DLFR | EUR\|USD | TTM_3M_1Y | |
| 38 | CURR | DLFR | EUR\|USD | TTM_1Y_2Y | |

| | MIFID_Asset_Class | MIFID_Sub_Asset_Class | Criteria-1 | Criteria-2 | Criteria-3 |
|---|---|---|---|---|---|
| 39 | CURR | DLFR | EUR\|ZAR | TTM_3M_1Y | |
| 40 | CURR | DLFR | GBP\|USD | TTM_3M_1Y | |
| 41 | CURR | DLFR | CHF\|USD | TTM_1W_3M | |
| 42 | CURR | DLFR | CHF\|USD | TTM_3M_1Y | |

Stand: 15.05.2021

**Glossar**

| | |
|---|---|
| CRDT= | Credit Derivatives |
| ICDS= | Index Credit Default Swap (CDS) |
| INTR= | Interest Rate Derivatives |
| FSCS= | Fixed-to-float single-currency swap and futures/forwards on these |
| CURR= | Foreign Exchange Derivatives |
| DLFR= | Deliverable forwards (DF) |

**Erläuterung**

| | |
|---|---|
| Criteria-1= | Underlying Instrument / Currency resp. Currency Pair |
| Criteria-2= | Currency / TimeToMaturity |
| Criteria-3= | TimeToMaturity |

# Adressen der Helaba

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Hauptsitze** | **Frankfurt am Main** | Neue Mainzer Straße 52 – 58<br>60311 Frankfurt am Main | T +49 69 / 91 32-01 |
| | **Erfurt** | Bonifaciusstraße 16<br>99084 Erfurt | T +49 3 61 / 2 17-71 00 |
| **Bausparkasse** | **Landesbausparkasse Hessen-Thüringen** | Strahlenbergerstraße 13<br>63067 Offenbach am Main | T +49 69 / 91 32-02 |
| | **Landesbausparkasse Hessen-Thüringen** | Bonifaciusstraße 16<br>99084 Erfurt | T +49 3 61 / 2 17-71 07 |
| **Förderbank** | **Wirtschafts- und Infrastrukturbank Hessen** | Strahlenbergerstraße 11<br>63067 Offenbach am Main | T +49 69 / 91 32-01 |
| **Niederlassungen** | **Düsseldorf** | Uerdinger Straße 88<br>40474 Düsseldorf | T +49 2 11 / 3 01 74-0 |
| | **Kassel** | Ständeplatz 17<br>34117 Kassel | T +49 5 61 / 7 06-60 |
| | **London** | 3rd Floor<br>95 Queen Victoria Street<br>London EC4V 4HN,<br>Großbritannien | T +44 20 / 73 34-45 00 |
| | **New York** | 420, Fifth Avenue<br>New York, N.Y. 10018, USA | T +1 212 / 7 03-52 00 |
| | **Paris** | 4-8 rue Daru<br>75008 Paris, Frankreich | T +33 1 / 40 67-77 22 |
| | **Stockholm** | Kungsgatan 3, 2nd Floor<br>11443 Stockholm, Schweden | T +46 / 861 101 16 |
| **Repräsentanzen** | **Madrid**<br>(für Spanien/Portugal) | C/ General Castaños, 4, bajo dcha.<br>28004 Madrid, Spanien | T +34 91 / 39 11-0 04 |
| | **Moskau** | Novinsky Boulevard 8<br>Business Centre Lotte<br>20th Floor<br>121099 Moskau, Russland | T +7 495 / 2 87-03-17 |
| | **São Paulo** | Av. das Nações Unidas<br>12399, Cjs. 105/106 B<br>Brooklin Novo São Paulo – SP<br>CEP: 04578-000 | T +55 11 / 29 24-97 56 |
| | **Shanghai** | Unit 022, 6th Floor<br>Hang Seng Bank Tower<br>1000 Lujiazui Ring Road<br>Shanghai, 200120, China | T +86 21 / 68 77 77 07 |
| | **Singapur** | One Temasek Avenue<br>#05-04 Millenia Tower<br>Singapore 039192 | T +65 / 62 38 04 00 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Vertriebsbüros** | **Düsseldorf** | Uerdinger Straße 88<br>40474 Düsseldorf | T +49 2 11 / 3 01 74-0 |
| | **Berlin** | Joachimsthalerstraße 12<br>10719 Berlin | T +49 30 / 2 06 18 79-13 14 |
| | **München** | Lenbachplatz 2a<br>80333 München | T +49 89 / 5 99 88 49-11 |
| | **Münster** | Regina-Protmann-Straße 16<br>48159 Münster | T +49 2 51 / 92 77 63-01 |
| | **Stuttgart** | Kronprinzstraße 11<br>70173 Stuttgart | T +49 7 11 / 28 04 04-0 |
| **Immobilienbüros** | **Berlin** | Joachimsthalerstraße 12<br>10719 Berlin | T +49 30 / 2 06 18 79-13 14 |
| | **München** | Lenbachplatz 2a<br>80333 München | T +49 89 / 5 99 88 49-0 |
| **Auswahl der Tochtergesellschaften** | **Frankfurter Sparkasse** | Neue Mainzer Straße 47 – 53<br>60311 Frankfurt am Main | T + 49 69 / 26 41-0 |
| | **1822direkt Gesellschaft der Frankfurter Sparkasse mbH** | Borsigallee 19<br>60388 Frankfurt am Main<br>info@1822direkt.com | T +49 69 / 9 41 70-0 |
| | **Frankfurter Bankgesellschaft (Deutschland) AG** | JUNGHOF<br>Junghofstraße 26<br>60311 Frankfurt am Main | T + 49 69 / 1 56 86-0 |
| | **Frankfurter Bankgesellschaft (Schweiz) AG** | Börsenstrasse 16<br>8001 Zürich, Schweiz | T +41 44 / 2 65 44 44 |
| | **Helaba Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH** | JUNGHOF<br>Junghofstraße 24<br>60311 Frankfurt am Main | T +49 69 / 2 99 70-0 |
| | **GWH Wohnungsgesellschaft mbH Hessen** | Westerbachstraße 33<br>60489 Frankfurt am Main | T +49 69 / 9 75 51-0 |
| | **OFB Projektentwicklung GmbH** | Speicherstraße 55<br>60327 Frankfurt am Main | T +49 69 / 9 17 32-01 |
| | **GGM Gesellschaft für Gebäude-Management mbH** | Speicherstraße 55<br>60327 Frankfurt am Main | T +49 69 / 9 17 32-9 00 |

**Helaba**

Neue Mainzer Straße 52 – 58
60311 Frankfurt am Main
T +49 69 / 91 32-01
F +49 69 / 29 15 17

Bonifaciusstraße 16
99084 Erfurt
T +49 3 61 / 2 17-71 00
F +49 3 61 / 2 17-71 01

www.helaba.com