



LEITLINIEN ÜBER ARTEN VON EINGABEDATEN

Veröffentlichung nach Art. 11 Abs. 1 Buchst. c EU-Benchmark-Verordnung

Stand: 09.06.2021

Die ICF BANK AG verwendet bei der Bereitstellung von Referenzwerten die nachfolgend beispielhaft aufgeführten Eingabedaten zu Basiswerten, die sie über die Datenanbieter wie Bloomberg, Reuters, Morningstar oder SIX Financial Information bezieht. Diese Daten beruhen grundsätzlich unmittelbar oder mittelbar auf tatsächlichen Transaktionsdaten, denen damit gegenüber geschätzten Preisen und Quotierungen eine vorrangige Nutzungspriorität zukommt. ESG-Daten bezieht die ICF BANK AG von ISS Institutional Shareholder Services AG oder von öffentlichen Institutionen wie dem Statistischen Amt der Europäischen Gemeinschaft oder dem Statistischen Bundesamt. Einzelheiten werden sowohl im Referenzwert-Dokument/Leitfaden wie auch im Appendix zum Referenzwert-Dokument/Leitfaden transparent dargestellt. Ein Ermessens- oder Beurteilungsspielraum der ICF BANK AG in Bezug auf die Bestimmung der Eingabedaten besteht nicht. Sachverständigeneinschätzungen sind nicht Grundlage der bereitgestellten Referenzwerte.

Basiswert	Datenquelle bzw. Administrator
Aktien und Schuldtitel	
	EU-MiFID-Handelsplatz (geregelter Markt, MTF oder OTF)
	Drittstaaten-Handelsplatz (Bsp.: USA, Schweiz)
Derivate (außer Rohstoffe)	
	EU-OTC-Markt
	MiFIR-Drittstaaten-Derivatehandelsplatz (falls gleichwertig)
	EMIR-Drittstaaten-OTC-Markt (falls gleichwertig) Beispiel: COMEX; NYMEX
Referenzzinssätze	
€STR	European Central Bank (ECB), Frankfurt
EONIA	European Money Markets Institute (EMMI), Brüssel
EURIBOR	European Money Markets Institute (EMMI), Brüssel

LIBOR	ICE Benchmark Administration Ltd. (IBA), London
Federal Funds Rate	Board of Governors of the Federal Reserve System, USA

Devisenkurse	
EUR/USD BFIX	Bloomberg Index Services Ltd, London
EUR/GBP BFIX	Bloomberg Index Services Ltd, London
EUR/CAN BFIX	Bloomberg Index Services Ltd, London
EUR/YEN BFIX	Bloomberg Index Services Ltd, London
EUR/NOK BFIX	Bloomberg Index Services Ltd, London
EUR/SFR BFIX	Bloomberg Index Services Ltd, London
Rohstoffe	
Gold BFIX	Bloomberg Index Services Ltd, London
Silber BFIX	Bloomberg Index Services Ltd, London
Platin BFIX	Bloomberg Index Services Ltd, London
Palladium BFIX	Bloomberg Index Services Ltd, London
Öl Brent (Future)	ICE Futures Europe, London
Öl WTI (Future)	CME Group Inc., Chicago (NYMEX)

Weitere Informationen zu Märkten und Eingabedaten

Informationen zu Marktgröße und -liquidität, Marktzugang, Marktteilnehmern und Währungen der von der ICF BANK AG verwendeten Eingabedaten in Bezug auf Finanzinstrumente sind auf den Internetseiten der jeweiligen Handelsplätze abrufbar. Angaben zu der Methodik der verwendeten Referenzzinssätze stellen die jeweiligen Administratoren bereit.

In Bezug auf Basiswerte, bei denen es sich nicht um Finanzinstrumente handelt (insbesondere Devisen und Edelmetalle), verwendet die ICF BANK AG von Bloomberg Index Services Ltd, London (BIS) auf Grundlage der BFIX-Methodik bereitgestellte Referenzwerte. Diese BFIX-Methodik kombiniert Daten verschiedener Quellen und Marktteilnehmer, wobei ausgeführte Kurse gegenüber ausführbaren und indikativen bevorzugt werden, und beinhaltet stets Geld- und Briefkurse (*bid/ask*). Ausweislich der BFIX-Methodik verwendet BIS keine Eingabedaten von Kontributoren. Eine Beschreibung der BFIX-Methodik ist online abrufbar (https://data.bloomberglp.com/notices/sites/3/2016/04/bfix_methodology.pdf).

Drittstaaten-Handelsplätze

Die ICF BANK AG verwendet bei der Erstellung von Referenzwerten auch Eingabedaten zu Finanzinstrumenten, die ausschließlich an Börsen außerhalb der EU-Mitgliedstaaten und der anderen EWR-Vertragsstaaten zum Handel zugelassen sind, in einem dieser Staaten an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder die dort eine Zulassung zum Handel oder Einbeziehung beantragt haben (Drittstaaten-Handelsplätze).

Eingabedaten, die von Drittstaaten-Handelsplätzen bereitgestellt werden, können nach der EU-Benchmark-Verordnung als sog. nicht regulierte Daten qualifizieren, die besonderen Pflichten unterliegen, sofern kein Gleichwertigkeitsbeschluss in Bezug auf den Handelsplatz vorliegt. Um die Genauigkeit und Integrität von Referenzwerten auf Basis dieser Daten sicherzustellen, überwacht und validiert die ICF BANK AG im Einklang mit den regulatorischen Vorgaben die von Drittstaaten-Handelsplätzen übermittelten Eingabedaten und zeichnet diese auf.

Derzeit erachtet die ICF BANK AG Eingabedaten der nachfolgend aufgeführten Drittstaaten-Handelsplätze für die von ihr bereitgestellten Referenzwerte als allgemein geeignet und zulässig:

I. Börsen in europäischen Ländern außerhalb der EU bzw. des EWR	
Armenien	NASDAQ OMX - Armenia
Bosnien und Herzegowina	Banja Luka Stock Exchange
Kanalinseln	The International Stock Exchange Authority (TISEA)
Montenegro	Montenegro Stock Exchange
Russland	Russian Trading System Stock Exchange Moscow Interbank Currency Exchange
Schweiz	SWX Swiss Exchange
Serbien	Belgrade Stock Exchange
Türkei	Istanbul Stock Exchange
Ukraine	PFTS Stock Exchange

II. Börsen in außereuropäischen Ländern	
Ägypten	Cairo & Alexandria Stock Exchanges
Argentinien	Buenos Aires
Australien	Australian Securities Exchange (ASX)
Bermuda	Bermuda Stock Exchange
Brasilien	Sao Paulo Rio de Janeiro
Chile	Santiago
China	Chinese Interbank Bond Market (CIBM) Hong Kong Stock Exchange

	Shanghai Stock Exchange Shenzhen Stock Exchange
Indien	Bombay Stock Exchange (BSE) National Stock Exchange of India (NSE) Calcutta Delhi Madras
Indonesien	Indonesia Stock Exchange
Iran	Stock Exchange of Tehran
Israel	Tel-Aviv Stock Exchange
Japan	Tokyo Osaka Nagoya Fukuoka Sapporo JASDAQ Securities Exchange
Jordanien	Amman Stock Exchange
Kanada	Toronto Stock Exchange Montréal Stock Exchange TSX Venture Exchange
Kasachstan	Kazakhstan Stock Exchange (KASE)
Katar	Qatar Stock Exchange (QE)
Kenia	Nairobi Securities Exchange
Kolumbien	Colombian Stock Exchange
Korea	Korea Exchange (Busan, Seoul)
Malaysia	Bursa Malaysia Malaysian Bonds Market
Mauritius	Stock Exchange of Mauritius
Mexiko	Mexiko City
Neuseeland	New Zealand Exchange (NZX)
Nigeria	The Nigerian Stock Exchange
Pakistan	Pakistan Stock Exchange Limited (PSX)
Peru	Lima
Philippinen	Philippine Stock Exchange
Saudi Arabien	Saudi Stock Exchange (Tadawul)
Singapur	Singapore Exchange Ltd.
Sri Lanka	Colombo Stock Exchange
Südafrika	Johannesburg (JSE)
Taiwan	Taiwan Stock Exchange (TWE)

Thailand	Stock Exchange of Thailand
USA	NYSE Amex LLC New York Stock Exchange LLC NASDAQ OMX PHLX, Inc. Chicago Board Options Exchange, Inc. Chicago Stock Exchange, Inc. NASDAQ OMX BX, Inc. National Stock Exchange, Inc. International Securities Exchange (ISE) The Nasdaq Stock Market LLC
Vereinigte Arabische Emirate	Abu Dhabi Securities Exchange Dubai Financial Market (DFM)
Vietnam	Hochiminh Stock Exchange

III. Organisierte Märkte in Ländern außerhalb der EU bzw. des EWR

Japan	Over the Counter Market
Kanada	Over the Counter Market
Korea	Over the Counter Market
Schweiz	BX Berne eX-change
USA	Over the Counter Market (unter Beaufsichtigung der FINRA oder SEC)
Weitere Länder	Over the Counter Market der Mitglieder der International Capital Market Association (ICMA), Zürich

Drittstaaten-Referenzwerte

Sollte die ICF BANK AG Referenzwerte verwenden, die von Administratoren mit Sitz im Vereinigten Königreich bereitgestellt werden, als Basiswert für von ihr bereitgestellte Referenzwerte, so gelten die nachstehenden Ausführungen. Diese Referenzwerte qualifizieren nach Austritt des Vereinigten Königreichs als sog. Drittstaaten-Referenzwerte, deren Verwendung besonderen Anforderungen unterliegt.

Sofern die EU-Kommission in Bezug auf die zukünftig im Vereinigten Königreich geltenden regulatorischen Anforderungen keinen Gleichwertigkeitsbeschluss erlässt (Artikel 30 Abs. 2 oder Abs. 3 BM-VO), die betreffenden Administratoren keine Anerkennung erlangen (Artikel 32 BM-VO) und keine Übernahme der betreffenden Referenzwerte erfolgt (Artikel 33 BM-VO), erarbeitet die ICF BANK AG nach Maßgabe der Übergangsbestimmungen (Art. 51 Abs. 5 BM-VO) und im Einklang mit einschlägigen Auslegungsentscheidungen der ESMA rechtzeitig vor

dem Inkrafttreten der Anforderungen für Drittstaaten-Referenzwerte in enger Abstimmung mit ihren Kunden robuste Pläne zur Anpassung der hiervon betroffenen Referenzwerte.