

NAŘÍZENÍ O INFRASTRUKTUŘE EVROPSKÝCH TRHŮ (EUROPEAN MARKET INFRASTRUCTURE REGULATION)

Informace o osvobození transakcí prováděných uvnitř skupiny od požadavků na marži (*margining obligation*) v souladu s Nařízením EU č. 648/2012 o infrastruktuře evropských trhů (*European Market Infrastructure Regulation – EMIR*)

Zveřejnění v souladu s článkem 11, odstavcem 11 Nařízení EMIR a článku 20 v Nařízení EU v přenesené pravomoci č. 149/2013

1. ZÁKLADNÍ ÚDAJE

Na základě Nařízení EU č. 648/2012 o infrastruktuře evropských trhů (*European Market Infrastructure Regulation – EMIR*) jsou smluvní strany obecně povinny poskytovat zajištění (kolaterál) pro nezúčtované OTC derivátové nástroje. **Assicurazioni Generali S.p.A.** a její dceřiné společnosti uvedené v kapitole 5 získaly výjimku z této povinnosti v souladu s článkem 11, odstavcem 3 Nařízení EMIR ohledně transakcí prováděných uvnitř skupiny. V souladu s článkem 11, odstavcem 11 Nařízení EMIR a s článkem 20 v Nařízení EU v přenesené pravomoci č. 149/2013 je povinností zveřejnit o získané výjimce následující údaje.

2. DOTČENÉ PROTISTRANY

Zveřejněné informace se týkají transakcí prováděných uvnitř skupiny mezi následujícími společnostmi:

Assicurazioni Generali S.p.A.

Akciová společnost založená podle italských zákonů, s plně splaceným základním kapitálem ve výši 1.565.165.364,00 euro, se sídlem v Terstu v Itálii, s centrálou na adrese Piazza Ducadegli Abruzzi n. 2, Terst, Itálie, zapsaná v Obchodním rejstříku Italské obchodní a průmyslové komory pod identifikačním číslem 00079760328, dále zapsaná v Registru italských pojišťovacích a zajišťovacích společností pod číslem 100003, mateřská společnost Skupiny Generali zapsané v Registru italských pojišťovacích a zajišťovacích společností (Albo Dei Gruppi Assicurativi) pod číslem 26, identifikační číslo pro právnické osoby (LEI): 549300X5UKJVE386ZB61, na straně jedné,

a v kapitole 5 níže uvedené dceřiné společnosti (každá z nich jednotlivě nazývaná jako „protistrana“ a souborně pak tyto společnosti nazývány jako „protistrany“) na straně druhé.

3. STRUKTURA SKUPINY

Protistrany jsou představovány konsolidovanými dceřinými společnostmi společnosti Assicurazioni Generali S.p.A. a na základě této skutečnosti tyto protistrany patří do Skupiny Generali. Podrobné informace o struktuře Skupiny a o vztazích mezi jednotlivými dceřinými společnostmi v rámci společnosti Assicurazioni Generali S.p.A. jsou uvedeny ve Výroční zprávě společnosti Assicurazioni Generali S.p.A.

4. DRUH UDĚLENÉ VÝJIMKY A POVOLENÝ OBJEM TRANSAKČÍ

Výjimka udělená pro transakce prováděné uvnitř skupiny a vztahující se na požadavky na marži v souladu s článkem 11, odstavcem 3 Nařízení EU č. 648/2012 o infrastruktuře evropských trhů (*European Market Infrastructure Regulation – EMIR*) se týká následujících druhů derivátových transakcí:

- i. **třída podkladových aktiv OTC derivátových smluv:**
měnový kurs (FX)
- ii. **typ OTC derivátových smluv:**
swapy a forwardy na měnový kurz
- iii. **typ podkladového aktiva:**
měnový kurs EUR vůči CZK
- iv. **měna obchodu (derivátové smlouvy) a měna vypořádání:**
měny obchodu - EUR, CZK a měny při vypořádání - EUR, CZK
- v. **doba splatnosti u smluv:**
až 12 měsíců
- vi. **typ vypořádání:**
fyzické vypořádání a / nebo hotovostní vypořádání
- vii. **plánované objemy transakcí:**

Protistrana	pomyslná měna (až do výše uvedené v eurech)	četnost
GP Reinsurance EAD	50 miliónů	1-12 krát za rok
Penzijní společnost České pojišťovny, a.s.	500 miliónů	1-12 krát za rok

Upozornění: jedná se o schválenou maximální hodnotu uzavíraných derivátových transakcí (*notional*). Tato výjimka z maržových povinností týkající se takových transakcí uvnitř skupiny byla udělena na celou tuto částku (*notional*).

5. SEZNAM DCEŘINÝCH SPOLEČNOSTÍ

Protistrana	identifikační číslo pro právnické osoby (LEI)
GP Reinsurance EAD, s oficiálním sídlem v Bulharsku	31570030000000000356
Penzijní společnost České pojišťovny, a.s., s oficiálním sídlem v České republice	315700CQ0BNME49XTC17