

INHALTSUEBERSICHT**Präliminarien**

§ 1 Einleitung	3
----------------	---

Allgemeiner Teil - Phänomenologie

§ 2 Arbeitsdefinition	13
§ 3 Geschichtlicher Ueberblick	16
§ 4 Reale Erscheinungsformen	24
§ 5 Einsatzmöglichkeiten und Risiken	40

Besonderer Teil - Vertragsrechtliche Analyse

§ 6 Swapklauseln	53
§ 7 Typologie der Erscheinungsformen	75
§ 8 Rechtsnatur	85
§ 9 Vertragsrechtliche Qualifikation	102
§ 10 Vertragsinhalt	116
§ 11 Vertragsarchitektur	124
§ 12 Vertragsparteien	133
§ 13 Anwendbares Recht	186

INHALTSVERZEICHNIS

Literaturverzeichnis	XV
Materialienverzeichnis	XLIII
Abkürzungsverzeichnis	XLIV

PRAELIMINARIEN

§ 1 Einleitung	3
I. Ausgangslage	3
II. Zweck der Arbeit	6
III. Aufbau der Arbeit	6

ALLGEMEINER TEIL - Phänomenologie

§ 2 Arbeitsdefinition	13
§ 3 Geschichtlicher Ueberblick	16
§ 4 Reale Erscheinungsformen	24
I. Zinsswap	25
II. Währungsswap	27
III. Indexswap	29
IV. Systematik der Erscheinungsformen	32
V. Varianten	34
A. Veränderung der Grundstruktur	36
B. Verknüpfung mit Finanzinstrumenten	38
§ 5 Einsatzmöglichkeiten und Risiken	40
I. Einsatzmöglichkeiten	40
A. Ertragsoptimierung	40
B. Bilanzmanagement	43

C. Risikomanagement	43
D. Dienstleistung	44
II. Risiken	45
A. Risikoarten	45
B. Eintritt des Risikofalls	48

BESONDERER TEIL - Vertragsrechtliche Analyse

§ 6 Swapklauseln	53
I. Einzelne Klauseln	53
A. Vertragsparteien	53
B. Präambel	54
C. Einheitsvertrag	55
D. Definitionen	55
E. Berechnung der Zahlungsströme	56
F. Zahlungsmodalitäten	56
1. Bedingtheit der Zahlungsströme	56
2. Zahlstellen	58
3. Verrechnung	58
4. Effektivklausel	58
G. Verzug	59
H. Beendigung	59
1. Kündigungsgründe	60
2. Automatische Beendigung	63
I. Schadenersatz	63
J. Zusicherungen	65
K. Sicherheiten	68
L. Uebertragung	69
M. Steuern	70
N. Multibranchklausel	71
O. Weitere Vertragsklauseln	72
1. Kosten	72
2. Mitteilungen	72
3. Rechtswahl und Gerichtsstand	73
4. Individuelle Abreden	73

II. Systematik der Swapklauseln	74
§ 7 Typologie der Erscheinungsformen	75
I. Definitionen	75
A. Gemeinsamkeiten	76
B. Unterschiede	77
C. Ergebnis	78
II. Einheitlicher Verkehrstypus	79
A. Allgemeines	79
B. Funktion der Vertragswährungen	80
C. Ergebnis	83
§ 8 Rechtsnatur	85
I. Obligatorisches Rechtsgeschäft	85
II. Konsensualvertrag	86
III. Synallagmatischer Vertrag	86
IV. Fixgeschäft	88
V. Dauerschuldverhältnis	91
VI. Differenzeinwand	94
A. Termingeschäft	95
B. Leistungsgegenstand: Waren und Börsenpapiere	98
C. Spielcharakter	99
D. Ergebnis	101
§ 9 Vertragsrechtliche Qualifikation	102
I. Abgrenzung von Nominatverträgen	102
A. Kaufvertrag	102
B. Tauschvertrag	105
C. Darlehensvertrag	107
D. Hinterlegungsvertrag	108
E. Schuldübernahme	108
F. Zession	110
G. Ergebnis	111
II. Qualifikation als Innominatvertrag	111
A. Allgemeines zum Innominatvertrag	111
1. Begriff und Arten	111

2. Rechtsanwendung	112
B. Der Swapvertrag	113
§ 10 Vertragsinhalt	116
I. Essentialia	116
A. Vertragssubjekte	116
B. Vertragsobjekt	117
1. Basiswerte	118
2. Zinssatz bzw. Preis	120
3. Zahlungsdauer	121
C. Vertragsleistung	121
II. Accidentalialia	122
§ 11 Vertragsarchitektur	124
I. Mündliche Vertragsverhandlungen	124
II. Vertragsabschluss	125
III. Schriftliche Bestätigungsschreiben	126
IV. Rahmenverträge	127
A. Begriff	127
B. Swap-Rahmenvertrag	129
C. Einheitsvertragskonzept	130
§ 12 Vertragsparteien	133
I. Exkurs: Hazell v Hammersmith	134
A. Sachverhalt	134
B. Entscheide	135
II. Privatrechtliche Vertragsparteien	139
A. Natürliche Personen	140
B. Juristische Personen	140
1. Privatrechtliche Handlungsfähigkeit	141
2. Öffentlich-rechtliche Normen	142
a. Vorsorgeeinrichtungen	143
b. Krankenkassen	147
c. Pfandbriefzentralen	149
d. Versicherungseinrichtungen	151
e. Anlagfonds	153

C. Rechtsgemeinschaften	159
D. Folgerungen	161
1. Fehlende Handlungsfähigkeit	161
2. Verletzung öffentlich-rechtlicher Normen	163
III. Öffentlich-rechtliche Vertragsparteien	164
A. Bund	167
1. Ermächtigung	168
2. Zuständiges Organ	170
B. Kantone und Gemeinden	171
1. Zürich	172
a. Ermächtigung	172
b. Zuständiges Organ	172
2. Basel-Stadt	173
a. Ermächtigung	173
b. Zuständiges Organ	174
C. Weitere juristische Personen	174
1. Schweizerische Nationalbank	174
2. Schweizerische Unfallversicherungsanstalt (SUVA)	176
3. Kantonalbanken	177
D. Folgerungen	180
1. Fehlende Ermächtigung	181
2. Unzuständiges Organ	182
IV. Ergebnis	183
§ 13 Anwendbares Recht	186
I. Binnenverträge	187
A. Subjektive Anknüpfung	188
B. Objektive Anknüpfung	192
II. Internationale Verträge	192
A. Subjektive Anknüpfung	193
B. Objektive Anknüpfung	193
III. Ergebnis	201