

Note for Capital Markets staff dealing with trading products: Market conformity

Dear all,

Please be informed that **with immediate effect**, comments on market conformity requests have always to be entered **using a link to the MGB database** in the e-mail rather than providing feedback in an alternative way like e-mail or phone or even not providing any answer or correction in Front Office system without any responds.

As a matter of policy, **any comment provided outside MGB database will be considered as not being provided** and handled as such, were the next step of escalation will be applied.

The responses must be provided during next 24h on business days.

Afterwards MRM follows escalation policy (Manual 160, 3.5.1)

PLEASE INFORM YOUR COLLEAGUES ACCORDINGLY.

Best Regards,

Regina Marinina

Joerg Schwengel

Eskalationsprozess

Aufgrund der Organisationsstruktur ist folgender Eskalationsprozess vorgesehen:

1. Die Geschäfte werden durch einen Mitarbeiter von MRM Engineering Düsseldorf geprüft. Dieser Mitarbeiter prüft, warum ein Geschäft durch die vorhergegangene technische Filterung aussortiert worden ist. Die Ausarbeitungen des Mitarbeiters werden mit Hilfe der Auswertungssoftware dokumentiert.
2. Wenn kein triftiger Grund für eine Abweichung offensichtlich ist und der Effekt auf die P&L-Berechnung nicht unwesentlich ist, wird der Händler über MGB Applikation kontaktiert und um eine Stellungnahme gebeten. Die Gründe für die Abweichung, bzw. die Bestätigung, dass das angemahnte Geschäft korrigiert wird, sind schriftlich abzugeben. MRM Engineering überprüft die Korrektur oder stellt sicher, dass die Erläuterungen plausibel sind.
3. Wenn die oben angeführten Schritte nicht innerhalb 24h zu einer Erklärung der erheblichen Abweichungen führen, sollte der für den Händler zuständige „Head of Desk“ kontaktiert werden. Dieser wird um eine Stellungnahme gebeten. MRM Engineering stellt sicher, dass die Erläuterungen plausibel sind.
4. Wenn die oben angeführten Schritte nicht zu einer Erklärung der erheblichen Abweichungen führen, sollte das für den „Head of Trading“ zuständige Vorstandsmitglied kontaktiert werden. Dieses wird um eine Stellungnahme gebeten. MRM Engineering stellt sicher, dass die Erläuterungen plausibel sind.