

# Preisverzeichnis Inland

für Kunden der Clearstream Banking AG, Frankfurt

## Wichtige Mitteilung

Für die Kunden der Clearstream Banking AG, Frankfurt, ist ausschließlich die deutsche Version des Preisverzeichnisses rechtlich verbindlich. Übersetzungen sollen lediglich die Zugänglichkeit und Kenntnisnahme der für die Geschäftsbeziehung zu Clearstream Banking AG, Frankfurt, relevanten Informationen erleichtern.

## Clearstream Banking

Dokumentnummer: F-CI02

Publikationsdatum: Dezember 2008

Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen dürfen ohne die ausdrückliche schriftliche Zustimmung von Clearstream Banking weder vervielfältigt noch in anderer Form oder für andere als interne Geschäftszwecke versandt werden. Die Bezeichnung Clearstream Banking in diesem Dokument bezieht sich auf Clearstream Banking Frankfurt. Der Inhalt dieses Dokuments kann nach vorheriger Mitteilung geändert werden.

© Copyright Clearstream Banking (2007, 2008). Alle Rechte vorbehalten.

Clearstream Banking ist ein Unternehmen der Gruppe Deutsche Börse.

## Inhalt

|  |           |
|--|-----------|
| <b>1. Allgemeines</b> .....  | <b>1</b>  |
| 1.1 Gültigkeit .....   | 1         |
| 1.2 Rechnungswährung .....   | 1         |
| 1.3 Zahlungsbedingungen .....  | 1         |
| 1.4 Rechnungsempfängerkonzept .....  | 1         |
| <b>2. Grundlegende Konzepte, Erläuterungen und Beispiele</b> .....                       | <b>2</b>  |
| 2.1 Depotführung .....   | 2         |
| 2.2 Wertpapierüberträge und Zahlungsaufträge .....                                       | 4         |
| 2.3 Kommunikation .....  | 6         |
| <b>3. Depotführung</b> .....   | <b>7</b>  |
| 3.1 Rentenwerte .....  | 7         |
| 3.2 Aktienwerte .....  | 9         |
| 3.3 Optionsscheine .....   | 11        |
| 3.4 Verbriefte Rohstoffe der Deutschen Börse Commodities GmbH (DBCo) .....               | 11        |
| <b>4. Wertpapierüberträge, Zahlungsaufträge und damit verbundene Kommunikation</b> ..... | <b>12</b> |
| 4.1 Börsengeschäfte, .....   | 12        |
| 4.2 OTC-Transaktionen .....  | 12        |
| 4.3 Cross-Border Transaktionen .....   | 14        |
| 4.4 Sonstige Wertpapiertransaktionen .....   | 14        |
| <b>5. Depotservice</b> .....   | <b>15</b> |
| 5.1 Dienstleistungen Tresor .....  | 15        |
| 5.2 Dienstleistungen Emissionen .....  | 16        |
| 5.3 Dienstleistungen aus Kapitaldiensten und Steuern .....                               | 17        |
| 5.4 Dienstleistungen Namensaktien .....  | 18        |
| <b>6. Kommunikation</b> .....  | <b>19</b> |
| 6.1 Depotservice bezogene Kommunikation .....  | 19        |
| 6.2 Statement of Holdings: Volumenbezogenes Rabattschema .....                           | 19        |
| 6.3 Sonstige Meldungen .....   | 19        |
| <b>7. Dienstleistungen für die Geldverrechnung über die Deutsche Bundesbank</b> .....    | <b>20</b> |
| 7.1 Verspätete Bereitstellung von Deckung gemäß Dispositionssaldo .....                  | 20        |
| 7.2 Manueller Ausgleich der Geldkonten, täglich oder monatlich .....                     | 20        |
| <b>8. Wertpapierleihe</b> .....  | <b>21</b> |
| 8.1 Frankfurt Automated Borrowing and Lending Service (FAB) .....                        | 21        |
| 8.2 Case by Case Borrowing and Lending Service (FCL) .....                               | 21        |
| 8.3 KAGplus .....  | 21        |
| 8.4 Borrowing and Lending Entleiher-Entgelte .....                                       | 21        |
| 8.5 Bond Advanced Management for Borrowing and Lending (BAMBL) .....                     | 23        |
| 8.6 Collateral Swap .....  | 23        |

|  |           |
|--|-----------|
| <b>9. Xemac®</b> .....   | <b>24</b> |
| 9.1 Collateral Management .....  | 24        |
| 9.2 Über Xemac an CBF übereignete Sicherheiten .....   | 24        |
| 9.3 Leitungspreise für optionale Xemac Standleitungen .....  | 24        |
| <b>10. Abgeltungsteuer Taxbox Service</b> .....  | <b>25</b> |
| 10.1 Einmaliges Setup inklusive Anbindung (Erhebung für jeden fachlichen Teilnehmer). . .              | 25        |
| 10.2 Senden von Datensätzen (Preis pro Datensatz). . . . .   | 25        |
| 10.3 Empfangen von Datensätzen (Preis pro Datensatz). . . . .  | 25        |
| <b>11. Sonderarbeiten, Beratungsdienstleistungen sowie manuelle Tätigkeiten</b> .....                  | <b>25</b> |
| 11.1 Stundensatz für Sonderarbeiten .....  | 25        |
| 11.2 Tagessatz für Beratungs- und Sonderdienstleistungen .....   | 25        |
| 11.3 Zuschlag für manuelle Tätigkeiten .....   | 25        |
| <b>Anhang 1 - Instrumentkategorisierung</b> .....  | <b>27</b> |
| <b>Anhang 2 - Kursbewertungsverfahren zur Depotgebührenberechnung</b> .....                            | <b>31</b> |
| <b>Anhang 3 - Ersatzparitäten zur Bewertung von Wertpapieren<br/>    ohne aktuellen Kurswert</b> ..... | <b>33</b> |

# Clearstream Banking AG - Preisverzeichnis Inland

## 1. Allgemeines

Dieses Verzeichnis enthält die von Clearstream Banking berechneten Preise für das deutsche Inlandsgeschäft.

### 1.1 Gültigkeit

Dieses Preisverzeichnis gilt bis auf weiteres **ab dem 1. Januar 2009**. Änderungen dieses Verzeichnisses werden den Kunden entsprechend mitgeteilt und auf der Clearstream Banking Internetseite unter [www.clearstream.com](http://www.clearstream.com) zur Verfügung gestellt werden.

### 1.2 Rechnungswährung

Alle Leistungen werden, außer dies wird anderweitig angegeben, in Basispunkten angegeben (1 Bp. = 0,01%) und werden in Euro berechnet. Die Entgelte sind netto und verstehen sich zzgl. der gesetzlichen Mehrwertsteuer (MwSt.), falls nicht anders angegeben.

### 1.3 Zahlungsbedingungen

Die Fakturierung erfolgt monatlich. Clearstream Banking benachrichtigt den Kunden am Anfang des auf den abgerechneten Zeitraum folgenden Monats über den Gesamtbetrag. Der entsprechende Betrag wird am 5. Arbeitstag des Monats von dem Konto des Kunden abgebucht. Liegt der Gesamtbetrag der Rechnung unter EUR 5,00 erfolgt keine Fakturierung.

### 1.4 Rechnungsempfängerkonzept

Clearstream bietet den Kunden die Möglichkeit, Konten von Hauptstellen und Filialen oder Niederlassungen für die gemeinsame Fakturierung zusammenzufassen. In diesem Fall erhält der Kunde nur eine Rechnung für alle zusammengefassten Konten. Durch die Kontengruppierung können sich zusätzliche Mengenrabatte ergeben.

## 2. Grundlegende Konzepte, Erläuterungen und Beispiele

### 2.1 Depotführung

- Die Preisangaben der Depotführung sind per annum, die Erhebung erfolgt monatlich pro rata temporis (p.r.t.) zzgl. der gesetzlichen MwSt.
- Für die Depotführung gelten diskrete Rabattstaffeln.
- Die Depotentgelte für Xemac-Konten werden zusammen mit den sonstigen Depotbeständen fakturiert.
- Die eigenen Kategorien für auf den Xemac-Unterkonten 550 gehaltene Bestände werden nicht mehr geführt.
- Für Reichsmarkwerte und Bezugsrechte werden keine Depotentgelte berechnet.
- Die Bewertung des Bestandes für Aktien, Optionsscheine, Zero-Bonds, Wertrechte und Investmentfondanteile und ähnliche Papiere erfolgt zum Kurswert.
- Die Bewertung des Bestandes für festverzinsliche Eurobonds, festverzinsliche Wandelanleihen, andere festverzinsliche Anleihen, variabel-verzinsliche Anleihen (Floating Rate Notes - FRN), Einlagenzertifikate (Certificates of Deposit - CD), Commercial Paper, Euro Commercial Paper sowie alle anderen Schuldverschreibungen basiert auf dem Nominalwert.
- Sollte für ein Wertpapier kein Kurs vorliegen, werden Ersatzparitäten zur Bewertung des Depotbestandes herangezogen (siehe Anhang 2).
- Alle Preise sind in Basispunkten angegeben (1 Bp. = 0,01%).

#### 2.1.1 Die Kategorien in der Depotführung

Entscheidend für die Zuordnung der Wertpapiere zu den Kategorien, ist die Information in den Feldern des Wertpapier-Service-System (WSS) "Verwahrmöglichkeit" und "Wertpapiergruppe" (siehe Anhang 1).

Rentenwerte und ähnliche Papiere sowie Aktienwerte in Prozentnotierung sind in zwei Kategorien unterteilt. Diese sind:

- Kategorie I: In effektiven Einzelkunden verbrieft Renten, Zero-Bonds und ähnliche Papiere in Prozent- bzw. Promill-Notierung.
- Kategorie II: In Dauerglobalurkunden verbrieft Rentenwerte, Zero-Bonds und ähnliche Papiere in Prozent- bzw. Promill-Notierung.

Weitere Gruppen die unter die Depotführung fallen sind:

- Aktienwerte, Investmentfondsanteile und ähnliche Papiere in Stück-Notiz, verbrieft in Einzelkunden oder Dauerglobalurkunden,
- Optionsscheine sowie
- ausländische Wertpapiere in Girosammelverwahrung.

### 2.1.2 Diskrete Depotentgelt-Rabattstaffel

Anhand des nachfolgenden Beispiels lässt sich die Logik der diskreten Rabattstaffeln für die Depotentgelte nachvollziehen.

**Hinweis:** Der Bestand in einem Depot hat einen zeitanteiligen Nominalwert von 35.000 Mio. EUR an Rentenwerten der Kategorie I. Der Depotpreis gemäß der diskreten Rabattstaffel setzt sich wie folgt zusammen:

| Depotwert<br>(in Mio. EUR)<br>Kurswert<br>von bis |        | Teilvolumen<br>Mio. EUR | Zugehöriger Preis in<br>Basispunkten (0,01%) | Monatliches Entgelt<br>(EUR) |
|---|--------|-------------------------|--|------------------------------|
| 0   | 500    | 500                     | 0,800  | 40.000                       |
| 500   | 3.000  | 2.500                   | 0,700  | 175.000                      |
| 3.000   | 6.000  | 3.000                   | 0,600  | 180.000                      |
| 6.000   | 12.000 | 6.000                   | 0,500  | 300.000                      |
| 12.000  | 25.000 | 13.000                  | 0,450  | 585.000                      |
| 25.000  | 50.000 | 10.000                  | 0,325  | 325.000                      |
| <b>Summe/Jahr</b>                                 |        | <b>35.000</b>           |  | <b>1.605.000</b>             |
|   |        |                         |  | <b>1.605.000 / 12</b>        |
| <b>Monatsbelastung</b>                            |        |                         |  | <b>133.750</b>               |

### 2.1.3 Depotentgelte pro-rata-temporis (p.r.t.)

Anhand des nachfolgenden Beispiels lässt sich die Logik der Berechnung der Depotentgelte nachvollziehen.

| Datum                 | Bestand | Für die Ermittlung relevante Anzahl von Tagen | pro-rata-temporis<br>Bestandsermittlung |
|-----------------------|---------|---|---|
| 01.10.2006            | 10.000  | 01  | 1 x 10.000                              |
| 02.10.2006            | 15.000  | 12  | 12 x 15.000                             |
| 14.10.2006            | 12.000  | 01  | 1 x 12.000                              |
| 15.10.2006            | 5.000   | 06  | 6 x 5.000                               |
| 21.10.2006            | 10.000  | 04  | 4 x 10.000                              |
| 25.10.2006            | 20.000  | 05  | 5 x 20.000                              |
| 30.10.2006            | 15.000  | 02  | 2 x 15.000                              |
| <b>Summe</b>          |         | <b>31</b>                                     | <b>402.000</b>                          |
| <b>Bestand p.r.t.</b> |         |   | <b>402.000/31=12.968</b>                |

Für Clearstream Banking ist der zeitanteilige Bestand die Berechnungsgrundlage, d.h. die Nominalwerte eines jeden Tages eines Monats werden kumuliert und durch die Anzahl der Kalendertage des entsprechenden Monats dividiert.

## 2.2 Wertpapierüberträge und Zahlungsaufträge

Die Entgelte für Wertpapierüberträge und Zahlungsaufträge sind von den Entgelten für die Depotführung unabhängig.

Die Preise für Wertpapiertransaktionen sind unter 4.1 Börsengeschäfte, 4.2 Wertpapierüberträge, 4.3 Wertpapierüberträge Cross-Border sowie 4.4 Sonstige Wertpapiertransaktionen zu finden.

Allgemeine Regeln für die Erhebung von Entgelten aus dem Depotservice sind:

- Die Entgelte für das Umsatzgeschäft werden pro Buchungsposten berechnet;
- die Erhebung erfolgt monatlich zzgl. der gesetzlichen MwSt. soweit nicht anders vermerkt;
- Rabatte werden auf Basis des monatlichen Transaktionsvolumens berechnet;
- bei Übertragungen über das SWIFT-Netzwerk fallen zusätzliche Entgelte an.

### 2.2.1 Beispiele der Entgeltberechnung für Wertpapierüberträge und Zahlungsaufträge aus Börsengeschäften und deren Kommunikation

| Anzahl der Transaktionen im Monat:                     | GS Wertpapiere<br>70.000 | GS Euroland Wertpapiere<br>10.000 |
|--|--------------------------|-----------------------------------|
| Wertpapierübertrag:                                    | 0,250 Euro               | 0,850 Euro                        |
| Zahlungsauftrag (vor Abzug Rabatt):                    | 0,300 Euro               | 0,300 Euro                        |
| Kommunikationspauschale (vor Abzug Rabatt):            | 0,075 Euro               | 0,075 Euro                        |
| <b>Transaktionsentgelt gesamt (vor Abzug Rabatt):</b>  | <b>0,625 Euro</b>        | <b>1,225 Euro</b>                 |
| <br>   |                          |                                   |
| ./.. Volumenrabatt:                                    | 7,5 %                    | 7,5 %                             |
| <br>   |                          |                                   |
| Wertpapierübertrag (nach Abzug Rabatt):                | 0,231 Euro               | 0,786 Euro                        |
| Zahlungsauftrag (nach Abzug Rabatt):                   | 0,278 Euro               | 0,278 Euro                        |
| Kommunikationspauschale (nach Abzug Rabatt):           | 0,069 Euro               | 0,069 Euro                        |
| <b>Transaktionsentgelt gesamt (nach Abzug Rabatt):</b> | <b>0,578 Euro</b>        | <b>1.133 Euro</b>                 |
| <br>   |                          |                                   |
| Wertpapierüberträge im Monat (nach Abzug Rabatt):      | 16.178,50 Euro           | 7.862,50 Euro                     |
| Zahlungsaufträge im Monat (nach Abzug Rabatt):         | 19.425,00 Euro           | 2.775,00 Euro                     |
| Kommunikationspauschale im Monat (nach Abzug Rabatt):  | 4.856,25 Euro            | 693,75 Euro                       |
| <b>Transaktionsentgelt gesamt (nach Abzug Rabatt):</b> | <b>40.468,75 Euro</b>    | <b>11.331,25 Euro</b>             |

**2.2.2 Beispiele der Entgeltberechnung für Wertpapierüberträge, Zahlungsaufträge und Kommunikation von OTC-Transaktionen**

| Anzahl der Transaktionen im Monat                      | DVP<br>70.000         | FOP<br>2.500       | DVP RTS<br>3.000     | Cross-Border<br>2.000 |
|--|-----------------------|--------------------|----------------------|-----------------------|
| Wertpapierübertrag (vor Abzug Rabatt):                 | 0,125 Euro            | 0,125 Euro         | 0,500 Euro           | 2,000 Euro            |
| Zahlungsauftrag (vor Abzug Rabatt):                    | 0,300 Euro            | -                  | 0,500 Euro           | -                     |
| Kommunikationspauschale (vor Abzug Rabatt):            | 0,200 Euro            | 0,200 Euro         | 0,200 Euro           | 0,200 Euro            |
| <b>Transaktionsentgelt gesamt (vor Abzug Rabatt):</b>  | <b>0,625 Euro</b>     | <b>0,325 Euro</b>  | <b>1,200 Euro</b>    | <b>2,200 Euro</b>     |
| <br>   |                       |                    |                      |                       |
| ./. Volumenrabatt:                                     | 7,5 %                 | 7,5 %              | 7,5 %                | 0,0 %                 |
| <br>   |                       |                    |                      |                       |
| Wertpapierübertrag (nach Abzug Rabatt):                | 0,116 Euro            | 0,116 Euro         | 0,463 Euro           | 2,000 Euro            |
| Zahlungsauftrag (nach Abzug Rabatt):                   | 0,278 Euro            | -                  | 0,463 Euro           | -                     |
| Kommunikationspauschale (nach Abzug Rabatt):           | 0,185 Euro            | 0,185 Euro         | 0,185 Euro           | 0,200 Euro            |
| <b>Transaktionsentgelt gesamt (nach Abzug Rabatt):</b> | <b>0,578 Euro</b>     | <b>0,301 Euro</b>  | <b>1,110 Euro</b>    | <b>2,200 Euro</b>     |
| <br>   |                       |                    |                      |                       |
| Wertpapierüberträge im Monat (nach Abzug Rabatt):      | 8.093,75 Euro         | 289,06 Euro        | 1.387,50 Euro        | 4,000 Euro            |
| Zahlungsaufträge im Monat (nach Abzug Rabatt):         | 19.425,00 Euro        | -                  | 1.387,50 Euro        | -                     |
| Kommunikationspauschale im Monat (nach Abzug Rabatt):  | 12.950,00 Euro        | 462,50 Euro        | 555,00 Euro          | 400,00 Euro           |
| <b>Transaktionsentgelt gesamt (nach Abzug Rabatt):</b> | <b>40.468,75 Euro</b> | <b>751,56 Euro</b> | <b>3.330,00 Euro</b> | <b>4.400,00 Euro</b>  |

## 2.3 Kommunikation

Der Bereich Kommunikation beinhaltet die folgenden depotbezogene Dienstleistungen:

- Statement of Holdings;
- Corporate Actions Notification sowie
- Confirmation Reports und Paying Agent Claims Reports;

Allgemeine Regeln für die Erhebung von Entgelten im Bereich Kommunikation sind:

- Die Berechnung erfolgt pro Posten;
- sie erfolgt monatlich zzgl. der gesetzlichen Mehrwertsteuer;
- Rabatte werden auf Basis des monatlichen Volumens berechnet und
- für die Anbindung entstehen zusätzliche Entgelte, die der Provider Deutsche Börse Systems (DBS) für CASCADE sowie die Datenfernübertragung in Rechnung stellt, respektive
- für die Benutzung des SWIFT-Netzwerkes, von Clearstream Banking gesondert in Rechnung gestellt werden.

### 2.3.1 Entgeltberechnung für die depotbezogene Kommunikation am Beispiel „Statement of Holdings“

|   |                    |
|---|--------------------|
| <b>Anzahl der im Monat angefallenen Posten:</b>                     | <b>550.000</b>     |
| Entgelt pro Posten (vor Abzug Rabatt):                              | 0,08 Euro          |
| ./.. Volumenrabatt:   | 25 %               |
| Entgelt pro Posten (nach Abzug Rabatt):                             | 0,06 Euro          |
| <b>Gesamtentgelt für Statement of Holdings (nach Abzug Rabatt):</b> | <b>33.000 Euro</b> |

### 3. Depotführung

#### 3.1 Rentenwerte

##### 3.1.1 Rentenwerte und ähnliche effektive Papiere einschließlich Aktienwerte in Prozentnotierung

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR)<br>Nominalwert<br>von bis |         | Kategorie I<br>In effektiven Einzelkunden verbriefte Renten |
|---|---------|---|
| 0   | 500     | 0,800 Bp.   |
| 500   | 3.000   | 0,700 Bp.   |
| 3.000   | 6.000   | 0,600 Bp.   |
| 6.000   | 12.000  | 0,500 Bp.   |
| 12.000  | 25.000  | 0,450 Bp.   |
| 25.000  | 50.000  | 0,325 Bp.   |
| 50.000  | 100.000 | 0,200 Bp.   |
| 100.000   | 150.000 | 0,100 Bp.   |
| >150.000  |         | 0,080 Bp.   |

##### 3.1.2 Rentenwerte und ähnliche dauerglobal verbriefte Papiere einschließlich Aktienwerte in Prozentnotierung

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR)<br>Nominalwert<br>von bis |         | Kategorie II<br>In Dauerglobalurkunden sowie Schuldbuchforderungen verbriefte Renten |
|---|---------|--|
| 0   | 500     | 0,375 Bp.  |
| 500   | 3.000   | 0,350 Bp.  |
| 3.000   | 6.000   | 0,325 Bp.  |
| 6.000   | 12.000  | 0,300 Bp.  |
| 12.000  | 25.000  | 0,250 Bp.  |
| 25.000  | 50.000  | 0,225 Bp.  |
| 50.000  | 100.000 | 0,120 Bp.  |
| 100.000   | 150.000 | 0,070 Bp.  |
| >150.000  |         | 0,060 Bp.  |

### 3.1.3 GS<sup>1</sup>: Euroland-Renten in europäischen Cross-Border-Links, außer schweizer Werte

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR)<br>Nominalwert<br>von bis |        | GS-Euroland-Renten<br>(effektiv + dauerglobal) |
|---|--------|--|
| 0   | 500    | 1,100 Bp.                                      |
| 500   | 1.000  | 0,700 Bp.                                      |
| 1.000   | 5.000  | 0,650 Bp.                                      |
| 5.000   | 15.000 | 0,600 Bp.                                      |
| 15.000  | 30.000 | 0,550 Bp.                                      |
| >30.000   |        | 0,500 Bp.                                      |

### 3.1.4 GS: Schweizer Renten im Cross-Border-Link mit SegalInterSettle (SIS), Zürich

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR)<br>Kurswert<br>von bis |   | GS-CH-Wertpapiere<br>(effektiv + dauerglobal) |
|--|---|---|
| 0  | ~ | 0,500 Bp.                                     |

### 3.1.5 GS: US-Renten im Cross-Border-Link mit „The Depository Trust and Clearing Corporation“ (DTCC), New York

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR)<br>Nominalwert<br>von bis |        | GS-US-Renten<br>(effektiv + dauerglobal) |
|---|--------|--|
| 0   | 500    | 1,100 Bp.                                |
| 500   | 1.000  | 0,700 Bp.                                |
| 1.000   | 5.000  | 0,650 Bp.                                |
| 5.000   | 15.000 | 0,600 Bp.                                |
| 15.000  | 30.000 | 0,550 Bp.                                |
| >30.000   |        | 0,500 Bp.                                |

### 3.1.6 GS: Internationale Renten im Link mit Clearstream Banking S.A., Luxemburg

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR)<br>Nominalwert<br>von bis |        | Int. Renten in Girosammelverwahrung<br>(effektiv + dauerglobal) |
|---|--------|---|
| 0   | 750    | 1,500 Bp.   |
| 750   | 2.000  | 1,300 Bp.   |
| 2.000   | 6.000  | 1,150 Bp.   |
| 6.000   | 15.000 | 1,000 Bp.   |
| 15.000  | 30.000 | 0,900 Bp.   |
| >30.000   |        | 0,800 Bp.   |

1. GS = Girosammelverwahrung

## 3.2 Aktienwerte

### 3.2.1 Aktienwerte, Investmentfondsanteile und ähnliche Papiere effektiv und dauerglobal verbrieft

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR)<br>Kurswert |         | Aktien, Investmentfonds und ähnliche Papiere |
|---|---------|--|
| von                                       | bis     |  |
| 0   | 100     | 0,200 Bp.                                    |
| 100                                       | 250     | 0,175 Bp.                                    |
| 250                                       | 500     | 0,150 Bp.                                    |
| 500                                       | 1.000   | 0,125 Bp.                                    |
| 1.000                                     | 5.000   | 0,100 Bp.                                    |
| 5.000                                     | 10.000  | 0,080 Bp.                                    |
| 10.000                                    | 25.000  | 0,060 Bp.                                    |
| 25.000                                    | 100.000 | 0,040 Bp.                                    |
| >100.000                                  |         | 0,020 Bp.                                    |

### 3.2.2 GS: Euroland-Aktien in europäischen Cross-Border-Links, außer schweizer Werte

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR)<br>Kurswert |     | GS-Euroland-Aktien |
|---|-----|--------------------|
| von                                       | bis |                    |
| 0   | 25  | 2,000 Bp.          |
| 25  | 100 | 1,750 Bp.          |
| 100                                       | 250 | 1,500 Bp.          |
| 250                                       | 500 | 1,250 Bp.          |
| 500                                       | 750 | 1,000 Bp.          |
| >750                                      |     | 0,750 Bp.          |

### 3.2.3 GS: Schweizer Aktien im Cross-Border-Link mit SegalInterSettle (SIS), Zürich

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR)<br>Kurswert |     | GS-CH-Wertpapiere |
|---|-----|-------------------|
| von                                       | bis |                   |
| 0   | ~   | 0,500 Bp.         |

### 3.2.4 GS: US-Aktien im Cross-Border-Link mit „The Depository Trust and Clearing Corporation“ (DTCC), New York

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR)<br>Kurswert |     | GS-US-Aktien |
|---|-----|--------------|
| von                                       | bis |              |
| 0   | 10  | 1,500 Bp.    |
| 10  | 25  | 1,250 Bp.    |
| 25  | 50  | 1,000 Bp.    |
| >50                                       |     | 0,900 Bp.    |

**3.2.5 GS: Internationale Aktien im Link mit Clearstream Banking S.A., Luxemburg**

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR) |        | Int. Aktien in Girosammelverwahrung |
|-------------------------------|--------|-------------------------------------|
| Kurswert                      |        |                                     |
| von                           | bis    |                                     |
| 0                             | 100    | 2,500 Bp.                           |
| 100                           | 250    | 2,200 Bp.                           |
| 250                           | 500    | 2,000 Bp.                           |
| 500                           | 1.000  | 1,800 Bp.                           |
| 1.000                         | 5.000  | 1,700 Bp.                           |
|                               | >5.000 | 1,500 Bp.                           |

### 3.3 Optionsscheine

#### 3.3.1 Optionsscheine (inländische, GS-Euroland und GS-US)<sup>1</sup>

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR) |        | Optionsscheine |
|-------------------------------|--------|----------------|
| Kurswert                      |        |                |
| von                           | bis    |                |
| 0                             | 10     | 2,500 Bp.      |
| 10                            | 25     | 2,000 Bp.      |
| 25                            | 50     | 1,500 Bp.      |
| 50                            | 100    | 1,000 Bp.      |
| 100                           | 500    | 0,800 Bp.      |
| 500                           | 1.000  | 0,600 Bp.      |
| 1.000                         | 2.500  | 0,400 Bp.      |
| 2.500                         | 10.000 | 0,300 Bp.      |
| >10.000                       |        | 0,200 Bp.      |

#### 3.3.2 GS: Schweizer Optionsscheine im Cross-Border-Link mit SegalInterSettle (SIS), Zürich

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR) |     | GS-CH-Wertpapiere |
|-------------------------------|-----|-------------------|
| Kurswert                      |     |                   |
| von                           | bis |                   |
| 0                             | ~   | 0,500 Bp.         |

**Hinweis:** Eine Liste aller zur GS-Verwahrung zugelassenen ausländischen Wertpapiere ist auf der Clearstream Internetseite [www.clearstream.com](http://www.clearstream.com) unter "Publications & Downloads / Reference Date / Securities / Eligible Securities" zu finden.

### 3.4 Verbriefte Rohstoffe der Deutschen Börse Commodities GmbH (DBCo)

#### 3.4.1 Inhaberschuldverschreibung Xetra-Gold®

| Depotvolumen<br>(in Mio. EUR) |       | Xetra-Gold |
|-------------------------------|-------|------------|
| Kurswert                      |       |            |
| von                           | bis   |            |
| 0                             | 250   | 30 Bp.     |
| 250                           | 500   | 27 Bp.     |
| 500                           | 1.000 | 24 Bp.     |
| 1.000                         | 2.000 | 22 Bp.     |
| >2.000                        |       | 21 Bp.     |

1. Inländische, GS-Euroland und GS-US Optionsscheine durchlaufen die Depotentgelt-Rabattstafel jeweils separat.

## 4. Wertpapierüberträge, Zahlungsaufträge und damit verbundene Kommunikation

### 4.1 Börsengeschäfte<sup>1, 2</sup>

#### 4.1.1 Abwicklung

| Abwicklung                       | GS und STR (EUR) | GS US und Euroland <sup>1</sup> (EUR) |
|----------------------------------|------------------|---------------------------------------|
| Wertpapierübertrag               | 0,250            | 0,850                                 |
| Zahlungsauftrag (MwSt frei)      | 0,300            | 0,300                                 |
| Kommunikationspauschale          | 0,075            | 0,075                                 |
| <b>Abwicklungsentgelt gesamt</b> | <b>0,625</b>     | <b>1,225</b>                          |

1. Eine Liste der GS-US und GS-Euroland Wertpapiere steht unter „www.clearstream.com / Publications & Downloads / Reference Data / Securities / Eligible Securities / Foreign Securities in Collective Safe Custody“ zur Verfügung.

#### 4.1.2 Volumenbezogenes Rabattschema

Der volumensbezogene Rabatt wird auf das Abwicklungsentgelt gesamt angewendet.

| Anzahl der Transaktionen | Zusammengefasstes Volumen in GS, STR, US und Euroland |
|--------------------------|---|
| ab 50.000 im Monat       | 5,00 %  |
| ab 75.000 im Monat       | 7,50 %  |
| ab 100.000 im Monat      | 15,00 %   |
| ab 150.000 im Monat      | 17,50 %   |

## 4.2 OTC-Transaktionen<sup>2, 3</sup>

#### 4.2.1 Abwicklung

| Abwicklung                       | Wertpapierübertrag Inland (EUR) | Wertpapierübertrag RTS (EUR) |
|----------------------------------|---------------------------------|------------------------------|
| Wertpapierübertrag               | 0,125                           | 0,500                        |
| Zahlungsauftrag (MwSt frei)      | 0,300                           | 0,500                        |
| Kommunikationspauschale          | 0,200                           | 0,200                        |
| <b>Abwicklungsentgelt gesamt</b> | <b>0,625</b>                    | <b>1,200</b>                 |

- Die Preise und Rabatte beziehen sich ausschließlich auf Börsengeschäfte, die nicht durch den zentralen Kontrahenten (CCP) verarbeitet wurden. Die Abwicklung von Börsengeschäften, die durch den CCP verarbeitet wurden, werden nicht von Clearstream sondern durch den CCP den jeweiligen Clearing Member in Rechnung gestellt.
- Für die Anbindung entstehen zusätzliche Entgelte, die der Provider Deutsche Börse Systems (DBS) für CASCADE sowie die Datenfernübertragung in Rechnung stellt. Fremdkosten die durch die Anbindung respektive die Nutzung des SWIFT-Netzwerks entstehen, werden von CBF gesondert in Rechnung stellt.
- Zuschlag für von Clearstream Banking manuell erfasste Wertpapierüberträge: EUR 5,00

#### 4.2.2 Volumenbezogenes Rabattschema

Der volumensbezogene Rabatt wird auf das Abwicklungsentgelt gesamt angewendet.

| Anzahl der Transaktionen | Zusammengefasstes Volumen von Wertpapierüberträgen Inland und RTS |
|--------------------------|---|
| ab 50.000 im Monat       | 5,00 %  |
| ab 75.000 im Monat       | 7,50 %  |
| ab 100.000 im Monat      | 15,00 %   |

## 4.3 Cross-Border Transaktionen

### 4.3.1 Abwicklung<sup>1</sup>

| Abwicklung                       | Wertpapierübertrag Cross border (über CSD-Link) <sup>1</sup><br>(EUR) |
|----------------------------------|---|
| Wertpapierübertrag               | 2,000   |
| Zahlungsauftrag (MwSt frei)      | 0,300   |
| Kommunikationspauschale          | 0,200   |
| <b>Abwicklungsentgelt gesamt</b> | <b>2,500</b>  |

1. Cross-Border Wertpapierüberträge über die CSD-Links von/zu APK, CBL, DTCC, Euroclear Belgium, Euroclear France, Euroclear Netherlands, Iberclear, Monte Titoli, OeKB und SIS. Neben dem Settlemententgelt werden die externen Kosten je Markt dem Kunden in Rechnung gestellt.

## 4.4 Sonstige Wertpapiertransaktionen

| Position  | EUR   |
|---|-------|
| 4.4.1 Wertpapierdisposition über abweichendes Depotkonto (pro Transaktion)      | 0,125 |
| 4.4.2 Pfandübertrag   | 5,00  |
| 4.4.3 Umtausch von nicht deutschen Aktien in deutsche Zertifikate               | 5,00  |
| Fremdkosten - Großbritannien, USA und Südafrika                                 | 15,00 |
| Fremdkosten - Australien und Neuseeland   | 65,00 |
| 4.4.4 Rücktausch von deutschen Zertifikaten in nicht deutsche Aktien            | 32,50 |
| zzgl. Fremdkosten - Europa (ohne Großbritannien)                                | 2,50  |
| zzgl. Fremdkosten - Großbritannien und Übersee (ohne Australien und Neuseeland) | 15,00 |
| zzgl. Fremdkosten - Australien und Neuseeland                                   | 65,00 |
| 4.4.5 Weitergabe effektiver Einzelkunden bei Inkasso                            | 5,00  |
| 4.4.6 Selbstbesicherung   | 8,00  |

1. Zuschlag für von Clearstream Banking manuell erfasste Wertpapierüberträge: EUR 5,00

## 5. Depotservice

### 5.1 Dienstleistungen Tresor

| Position   | EUR          |
|--|--------------|
| 5.1.1 Einlieferung/ Auslieferung effektiver Einzel-/ Globalurkunden oder Transfer von Positionen in/ aus dem Vorratslager-Depot sowie Einlieferungen/ Auslieferungen von Globalurkunden außer für Einlieferung stücknotierter globalverbriefter Optionsscheine und Zertifikate | 7,50         |
| 5.1.2 Valutierung/ Revalutierung von Globalurkunden  | 1,50         |
| 5.1.3 Rückgabe fehlerhafter Einlieferungen   | 20,00        |
| 5.1.4 Trennung/ Zusammenführung von cum-Anleihen   | 12,50        |
| 5.1.5 Vernichtung von Einzelurkunden <sup>1</sup> , sowie Entwertung, Urkundenabstempelung, Umtausch, Rückzahlung, Liquidation, Bogenerneuerung von Einzelurkunden (pro Urkunde)   | 0,01         |
| 5.1.6 Vernichtung, Entwertung, Rückzahlung, Liquidation von Globalurkunden (pro Urkunde)   | 0,10         |
| 5.1.7 Bestandsbestätigung, Hinterlegungsbescheinigung, Depotauszüge, Duplikate, Stückenummernverzeichnisse   | 5,00         |
| 5.1.8 Sonderverwahrung von nicht begebenen effektiven Einzelurkunden sowie Verwahrung von rechtsunwirksamen Urkunden (pro 1.000 Urkunden p.a.)   | 11,50        |
| 5.1.9 Versand von Wertpapieren (pro Sendung)<br>zzgl. Bearbeitungsentgelt (pro Posten)<br>zzgl. Fremdkosten <sup>2</sup>   | 8,00<br>3,00 |
| 5.1.10 Abwicklungsentgelt bei Auslieferung Gold im Zusammenhang mit der Ausübung von Xetra-Gold <sup>3</sup>   | 50,00        |
| 5.1.11 Zusätzliches Abwicklungsentgelt bei Auslieferung von LBMA-Standardbarren im Zusammenhang mit der Ausübung von Xetra-Gold <sup>4</sup>   | 200,00       |
| 5.1.12 Einlieferung von physischen Globalurkunden für stücknotierte Optionsscheine und Zertifikate   | 10,00        |
| 5.1.13 Einlieferung von Globalurkunden via Electronic Documentation Transmission (EDT) für stücknotierte Optionsscheine und Zertifikate (ohne Erstellung der Urkunde)  | 5,00         |
| 5.1.14 Einlieferung von Globalurkunden via Electronic Documentation Transmission (EDT) für stücknotierte Optionsscheine und Zertifikate (mit Erstellung der Urkunde)   | 6,00         |

1. Die Entwertung/Vernichtung von Zins-, Dividenden- und Ertragsscheinen die sich nicht im Vorratslager befinden ist kostenfrei.
2. z.B. Porto-, Avis-, Versicherungsentgelte und Steuern.
3. Deckt die Aufwendungen für administrative Prozesse im Zusammenhang mit Ausübung von Xetra-Gold<sup>®</sup> und versteht sich zuzüglich Fremdspesen für Goldlieferung, Formung von Kleinbarren, Versicherung und gesetzlicher Umsatzsteuer.
4. Bezieht sich auf Aufwendungen im Zusammenhang mit der Vorbereitung und Verpackung von LBMA-Goldbarren im Tresor.

## 5.2 Dienstleistungen Emissionen

| Position  | EUR      |
|---|----------|
| 5.2.1 Prüfung von Mantel oder Bogen (pro Emission)  | 150,00   |
| 5.2.2 Prüfung von Mantel und Bogen (pro Emission)   | 250,00   |
| 5.2.3 Prüfung von Fortsetzungsdrucken, die auf bereits geprüften Ausstattungsvordrucken hergestellt werden (pro Emission) | 125,00   |
| 5.2.4 Auflegen einer Commercial Paper Tranche <sup>1</sup>  | 25,00    |
| 5.2.5 Treuhänderservice (Entgelt p.a.) <sup>2</sup>   |          |
| - für eine Emission   | 2.500,00 |
| - für zwei bis fünfzig Emissionen (je Emission)   | 1.250,00 |
| - für über fünfzig Emission (je Emission)   | 500,00   |

1. Nur bei Verwahrung der Blankette durch Clearstream Banking.

2. Die Entgeltfakturierung erfolgt jeweils im dritten Quartal.

## 5.3 Dienstleistungen aus Kapitaldiensten und Steuern

| Kapitalmaßnahmen                     |   | EUR        |
|--------------------------------------|---|------------|
| 5.3.1                                | Überwachung von Schachtelbeteiligungen und nicht begebenen Beständen bei systemseitigen Absetzungen nach Kundenumbuchungen in CASCADE in effektiven Beständen oder bei nicht lieferbaren Globalurkunden | 7,50       |
| 5.3.2                                | Nachläufe Income Events   | 50,00      |
| 5.3.3                                | Storno Income Events  | 100,00     |
| 5.3.4                                | Bestandszurechnung -Zentrales Kuponinkasso- <sup>1</sup>  | 12,50      |
| 5.3.5                                | Zweitschrift Kundenabrechnung Kapitaldienste  | 25,00      |
| 5.3.6                                | Kauf- und Verkauf von Bezugsrechten <sup>2 3</sup>  | 1,8%       |
|                                      |   | Min. 26,50 |
| 5.3.7                                | Instruktion einer Kapitalmaßnahme via SWIFT <sup>c</sup>  | 25,00      |
| Stimmrechtsvertretung <sup>4</sup>   |   | EUR        |
| 5.3.8                                | HV / aoHV-Tagesordnung (pro HV, pro Institut)   | 39,50      |
| 5.3.9                                | Bestellung von Eintrittskarten / Ausübung von Vollmachtsstimmrecht (pro HV, pro Institut)   | 39,50      |
| Quellensteuer-Reporting <sup>5</sup> |   | EUR        |
| 5.3.10                               | Bearbeitung von Wohnsitzbescheinigungen/Steuerzertifikaten und Steuererstattungsanträgen <sup>6</sup>   | 35,00      |
| 5.3.11                               | Bearbeitung von Online-Wohnsitzbescheinigungen/-Steuerzertifikaten <sup>7</sup>   | 30,00      |
| 5.3.12                               | Bearbeitung der Mitteilungen über meldepflichtige Beträge nach Steuersatz   | 26,50      |
| 5.3.13                               | Ausstellung von Steuerbescheinigungen und Berichtigungen sowie Rückforderung der ZAST bei thesaurierenden Fonds   | 25,00      |
| 5.3.14                               | ProAct Tax Reclaim Service: Elektronische Bearbeitung <sup>8</sup>  | 15,00      |
| 5.3.15                               | ProAct Tax Reclaim Service: Manuelle Bearbeitung <sup>h</sup>   | 30,00      |

- Die Kunden können die ggf. vorhandenen Provisionsregeln bei der in X-List bzw. WSS hinterlegten Zahlstelle in Erfahrung bringen.
- Das Entgelt wird pro Auftrag berechnet und beinhaltet Standardoptionen. Das Entgelt beträgt 1,8% des Transaktionsbetrages mit einer Mindestentgelt von EUR 26,50.
- Kapitalmaßnahmen für ausländische GS-Gattungen werden z. Z. nicht bepreist. Der Standardservice für deutsche GS-Gattungen wird bislang ebenfalls nicht bepreist. Lediglich für o.g. Zusatzservices deutscher GS-Gattungen werden Entgelte erhoben.
- Auslagen wie Rechtskosten und Kosten, die für Stimmrechtsvertretung auf einer Gesellschaftsversammlung entstehen, sowie Eintragungs- und Depotführungskosten im Zusammenhang mit Eintragungen im Namen des Endbegünstigten gehen zu Lasten des Kunden.
- Clearstream Banking behält sich das Recht vor, einen Stundensatz von EUR 60,00 für bestimmte Kundenanfragen zu berechnen, die den Standardservice überschreiten und umfassende Recherchen erfordern. Dies gilt zum Beispiel für Steuerbescheinigungen über Dividenden- oder Kuponzahlungen, die mehr als 6 Monate zurückliegen, Korrekturen von MOD111, spezielle Reports (Excel US non Legal Report) etc.
- Ein zusätzliches Entgelt in Höhe von EUR 500,00 wird für Steuerrückerstattungsformulare erhoben, die später als zwei Monate vor dem Annahmeterrin des jeweiligen Marktes eingereicht werden. Das Bearbeitungsentgelt bei Anträgen auf Rückerstattung ist für jede Dividenden oder Kuponzahlung, für die Steuern zurückgefordert werden, fällig.
- Zur Zeit nur für Frankreich möglich.
- Zuzüglich Standardentgelt für die Bearbeitung von Steuererstattungsanträgen.

## 5.4 Dienstleistungen Namensaktien

| <b>Dienstleistungen für Banken und Emittenten</b> |  | <b>EUR</b> |
|---|--|------------|
| 5.4.1   | Ersteintragung von Aktien aus Kapitalveränderungen | 0,30       |
| 5.4.2   | Umschreibung von Aktien                            | 0,50       |
| 5.4.3   | Änderungen von Aktionärsdaten                      | 0,10       |

| <b>Dienstleistungen für Banken</b> |   | <b>EUR</b> |
|------------------------------------|---|------------|
| 5.4.4                              | Einlieferung von Namensaktien (effektiv), ohne Rahmenvertrag  | 45,00      |
| 5.4.5                              | Einlieferung von Namensaktien (elektronisch), mit Rahmenvertrag   | 5,00       |
| 5.4.6                              | Auslieferung von Namensaktien aus GS-Verwahrung<br>zzgl. Fremdkosten (Versicherungs- und Versandkosten;<br>siehe Punkt 5.1.9) | 50,00      |
| 5.4.7                              | Erstellung von Bestands- bzw. Emittententransaktionslisten auf<br>Anforderung (pro Auszug)                                    | 5,00       |
| 5.4.8                              | Bestandsquery für Namensaktien (pro Datensatz -<br>Min. EUR 5,00 bzw. Max. EUR 100,00 pro Query)                              | 0,01       |

| <b>Dienstleistungen für Emittenten</b> |  | <b>EUR</b> |
|--|--|------------|
| 5.4.9                                  | Standardaufnahme neuer Emittenten in CASCADE-RS <sup>1</sup> | 4.000,00   |
| 5.4.10                                 | Kapitalmaßnahme in einer CASCADE-RS Gattung <sup>a</sup>     | 1.000,00   |
| 5.4.11                                 | Automatische Umschreibung                                    | 0,10       |
| 5.4.12                                 | Altaktionärsdatenbank (Min. EUR 10,00 bzw. Max. EUR 100,00)  | 0,01       |
| 5.4.13                                 | Auswertung Freier Meldebestand der Banken                    | 10,00      |
| 5.4.14                                 | Erstellung von Bankentransaktionslisten                      | 5,00       |

1. Für über die Standardverfahren hinausgehenden Sonderarbeiten behält sich CBF vor, zusätzlich den Tagessatz zu veranschlagen.

## 6. Kommunikation

### 6.1 Depotservice bezogene Kommunikation<sup>1</sup>

| Position   | EUR  |
|--|------|
| 6.1.1 Statement of Holdings, pro enthaltener Information                               | 0,08 |
| 6.1.2 Corporate Actions Notifications, pro enthaltener Information                     | 0,80 |
| 6.1.3 Corporate Actions Confirmations/Paying Agent Claims, pro enthaltener Information | 0,50 |

### 6.2 Statement of Holdings: Volumenbezogenes Rabattschema

| im Monat übermittelte Informationen | Volumenrabatt |
|-------------------------------------|---------------|
| ab 100.000                          | 5,00 %        |
| ab 150.000                          | 7,50 %        |
| ab 250.000                          | 15,00 %       |
| ab 500.000                          | 25,00 %       |
| ab 1.000.000                        | 50,00 %       |

### 6.3 Sonstige Meldungen

| Position  | EUR                |
|---|--------------------|
| 6.3.1 CBF MIS Reporting (pro Konto)                                   | 60,00              |
| 6.3.2 Bestandsmeldungen an KAGs für Bestandsprovision (pro Datensatz) | 0,01<br>Min. 60,00 |

1. Für die Anbindung entstehen zusätzliche Entgelte, die der Provider Deutsche Börse Systems (DBS) für CASCADE sowie die Datenfernübertragung in Rechnung stellt. Fremdkosten die durch die Anbindung respektive die Nutzung des SWIFT-Netzwerks entstehen, werden von CBF gesondert in Rechnung gestellt.

## 7. Dienstleistungen für die Geldverrechnung über die Deutsche Bundesbank

**Hinweis:** Die verspätete Bereitstellung von Deckung gemäß Dispositionssaldo bezieht sich auf die SDS1 und SDS2 Abwicklungszyklen. Die Entgelte richten sich nach der Anzahl der Verspätungen in den letzten 30 Tagen, inklusive des jeweiligen Verrechnungstages.

### 7.1 Verspätete Bereitstellung von Deckung gemäß Dispositionssaldo

| Minuten |     | Entgelt (EUR)    |                   |                               |
|---------|-----|------------------|-------------------|-------------------------------|
| von     | bis | Erste Verspätung | Zweite Verspätung | Dritte und weitere Verspätung |
| 30      | 60  | 100,00           | 200,00            | 400,00                        |
| 60      | 90  | 2.500,00         | 5.000,00          | 10.000,00                     |
|         | >90 | 5.000,00         | 10.000,00         | 20.000,00                     |

### 7.2 Manueller Ausgleich der Geldkonten, täglich oder monatlich

| Position                                 | EUR  |
|--|------|
| 7.2.1 Sollsaldo-Ausgleich (pro Buchung)  | 5,00 |
| 7.2.2 Guthaben-Überweisung (pro Buchung) | 5,00 |

## 8. Wertpapierleihe

**Hinweis:** Die angegebenen Entgelte der Wertpapierleihe sind frei von der gesetzlichen MwSt.

### 8.1 Frankfurt Automated Borrowing and Lending Service (FAB)

| Position                            | Aktien/Renten |
|-------------------------------------|---------------|
| 8.1.1 Vergütung Verleiher           | 1,00 % p.a.   |
| 8.1.2 Vergütung Clearstream Banking | 0,50 % p.a.   |
| 8.1.3 Nutzungsentgelt Entleiher     | 1,50 % p.a.   |

### 8.2 Case by Case Borrowing and Lending Service (FCL)

| Position                            | Aktien/Renten                        | Mindestentgelt (EUR) |
|-------------------------------------|--------------------------------------|----------------------|
| 8.2.1 Vergütung Verleiher           | nach Vereinbarung <sup>1</sup>       | 20,00                |
| 8.2.2 Vergütung Clearstream Banking | 1/3 der Entleihrate<br>max 0,5% p.a. | 10,00                |
| 8.2.3 Nutzungsentgelt Entleiher     | nach Vereinbarung <sup>1</sup>       | 30,00                |

1. Die Rate orientiert sich an einem vom Entleiher vorgegebenen Maximum.

### 8.3 KAGplus

| Position                  | Aktien            | Renten            |
|---------------------------|-------------------|-------------------|
| 8.3.1 Vergütung Verleiher | nach Vereinbarung | nach Vereinbarung |

| Position                               | von - bis (EUR/Monat) <sup>1</sup> | Aktien (Bp.) | Renten (Bp.) |
|--|------------------------------------|--------------|--------------|
| 8.3.2 Vergütung<br>Clearstream Banking | 0 - 100 Mio.                       | 5,0          | 2,2          |
|  | 100 - 500 Mio.                     | 4,5          | 1,9          |
|  | 500 - 1.500 Mio.                   | 4,0          | 1,6          |
|  | 1.500 - 3.000 Mio.                 | 3,5          | 1,4          |
|  | 3.000 - 5.000 Mio.                 | 3,0          | 1,2          |
|  | 5.000 - 7.000 Mio.                 | 2,5          | 1,0          |
|  | 7.000 - 10.000 Mio.                | 2,0          | 0,9          |
|  | 10.000 - 20.000 Mio.               | 1,8          | 0,8          |
|  | > 20.000 Mio.                      | 1,5          | 0,7          |

1. Die Ermittlung der Vergütung von Clearstream Banking richtet sich nach den gewichteten monatlichen Durchschnittsvolumina.

| Position                        | Aktien            | Renten            |
|---------------------------------|-------------------|-------------------|
| 8.3.3 Nutzungsentgelt Entleiher | nach Vereinbarung | nach Vereinbarung |

### 8.4 Borrowing and Lending Entleiher-Entgelte

| Position                                | Pro Posten EUR |
|---|----------------|
| 8.4.1 Nicht fristgerechter Rückübertrag | 10,00          |

## Clearstream Banking AG - Preisverzeichnis Inland

| <b>Position</b>                                | <b>Pro Posten EUR</b> |
|--|-----------------------|
| 8.4.2 Deckung durch Clearstream Banking        | 25,00                 |
| 8.4.3 Deckung Zusatzrechte (z.B. Bezugsrechte) | 25,00                 |
| 8.4.4 Dividendenausgleichszahlung              | 10,00                 |

## 8.5 Bond Advanced Management for Borrowing and Lending (BAMBL)

| Position                            | Aktien/Renten                          | Mindestentgelt (EUR) |
|-------------------------------------|--|----------------------|
| 8.5.1 Vergütung Verleiher           | nach Vereinbarung <sup>1</sup>         | 20,00                |
| 8.5.2 Vergütung Clearstream Banking | 1/3 der Entleihrate,<br>max. 0,5% p.a. | 10,00                |
| 8.5.3 Nutzungsentgelt Entleiher     | nach Vereinbarung                      | 30,00                |

1. Die Rate orientiert sich an einem vom Entleiher vorgegebenen Maximum.

## 8.6 Collateral Swap

| Position                  | Aktien            | Renten            |
|---------------------------|-------------------|-------------------|
| 8.6.1 Vergütung Verleiher | nach Vereinbarung | nach Vereinbarung |

| Position                            | von - bis (EUR/Monat) | Entgelte (Bp.) |
|-------------------------------------|-----------------------|----------------|
| 8.6.2 Vergütung Clearstream Banking | 0 - 1.500 Mio.        | 2,0            |
|                                     | 1.500 - 5.000 Mio.    | 1,5            |
|                                     | > 5.000 Mio.          | 1,0            |

| Position                        | Aktien            | Renten            |
|---------------------------------|-------------------|-------------------|
| 8.6.3 Nutzungsentgelt Entleiher | nach Vereinbarung | nach Vereinbarung |

## 9. Xemac®

### 9.1 Collateral Management<sup>1</sup>

#### 9.1.1 Xemac Entgelte auf den allokierten Bestand (Erhebung monatlich p.r.t.)

| Allokationsvolumen<br>(in Mio. EUR) |        | Entgelt (Basispunkte) |
|-------------------------------------|--------|-----------------------|
| von                                 | bis    |                       |
| 0                                   | 500    | 0,40 Bp.              |
| > 500                               | 2.000  | 0,35 Bp.              |
| > 2.000                             | 5.000  | 0,30 Bp.              |
| > 5.000                             | 10.000 | 0,25 Bp.              |
| > 10.000                            | 20.000 | 0,20 Bp.              |
| > 20.000                            |        | 0,15 Bp.              |

Die oben angegebenen Entgelte werden ausschliesslich dem Sicherheitengeber in Rechnung gestellt. Auf das gesamte allokierte Volumen wird nur eine Preisstufe aus der Tabelle angewandt.

**Beispiel:** Auf ein allokiertes Volumen in Höhe von EUR 6 Mrd. würden 0,25 Basispunkte p.a. zur Berechnung herangezogen und damit für einen Monat EUR 12.500 erhoben werden.

#### 9.1.2 Euro GC Pooling (Erhebung monatlich p.r.t.)

| Euro GC Pooling |                    | Entgelt auf das<br>Allokationsvolumen<br>(Basispunkte) |
|-----------------|--------------------|--|
| 9.1.2.1         | Sicherheitengeber  | 0,20 Bp.   |
| 9.1.2.2         | Sicherheitennehmer | 0,20 Bp.   |

Das monatliche Mindestentgelt für die Summe der Positionen 9.1.1 und 9.1.2 beträgt EUR 1.000.

### 9.2 Über Xemac an CBF übereignete Sicherheiten<sup>1, 2</sup>

| Übereignete Sicherheiten |  | Entgelt  |
|--------------------------|--|----------|
| 9.2.1                    | Entgelt für allokierte Sicherheiten "Übereignung via CBF" (Erhebung der Sicherheitenwerte p.r.t.)  | 5,00 Bp. |
| 9.2.2                    | Manuelle Bearbeitung von Ein- und Ausbuchungsaufträgen durch Clearstream Banking (pro Transaktion) | EUR 5,00 |

Das monatliche Mindestentgelt beträgt EUR 400.

### 9.3 Leitungspreise für optionale Xemac Standleitungen

| Leitungspreise Xemac Standleitung |  | Entgelt (EUR) |
|-----------------------------------|--|---------------|
| 9.3.1                             | Leitungsinallation (einmalig)                        | 2.000,00      |
| 9.3.2                             | innerhalb Frankfurt (monatlich)                      | 1.200,00      |
| 9.3.3                             | andere Lokationen innerhalb Deutschlands (monatlich) | 2.800,00      |

1. Der durchschnittliche allokierte Bestand wird aus technischen Gründen jeweils vom 21. des Vormonats bis zum 20. des Rechnungsmonats ermittelt. Zur Berechnung wird der Allokationstageshöchstwert herangezogen.
2. Zur Finanzierung der CBF-Nachtverarbeitung gemäß separatem Kreditvertrag.

## 10. Abgeltungsteuer Taxbox Service

| Position |   | Entgelt (EUR) |
|----------|---|---------------|
| 10.1     | Einmaliges Setup inklusive Anbindung (Erhebung für jeden fachlichen Teilnehmer). <sup>1</sup> | 5.000,00      |
| 10.2     | Senden von Datensätzen (Preis pro Datensatz). <sup>2</sup>                                    | 0,15          |
| 10.3     | Empfangen von Datensätzen (Preis pro Datensatz). <sup>3</sup>                                 | 0,15          |

1. Ist ein fachlicher Teilnehmer zusätzlich technischer Teilnehmer, wird die Gebühr nur einmal erhoben.
2. Es werden nur erfolgreich validierte Datensätze in Rechnung gestellt. Folgesätze werden ebenfalls in Rechnung gestellt.
3. Es werden nur erfolgreich validierte Datensätze übertragen. Leer- sowie Folgesätze werden ebenfalls in Rechnung gestellt.

## 11. Sonderarbeiten, Beratungsdienstleistungen sowie manuelle Tätigkeiten

| Position |   | Entgelt (EUR) |
|----------|---|---------------|
| 11.1     | Stundensatz für Sonderarbeiten                      | 60,00         |
| 11.2     | Tagessatz für Beratungs- und Sonderdienstleistungen | 1.000,00      |
| 11.3     | Zuschlag für manuelle Tätigkeiten                   | 30,00         |

Leerseite

## Anhang 1 - Instrumentkategorisierung

| WP-Gruppe/<br>Verwahrmöglichkeit |  |
|----------------------------------|--|
| 1-JGS bis Ersch.                 |  |
| 2-JGS bis Einlief.               |  |
| 3-SVG                            |  |
| 6-STV                            |  |
| 7-STV                            |  |
| 8-STV Inh. Sammelz. CBF          |  |
| 11-GS, stueckelos                |  |
| 14-GS, Rahmenurk. bis-zu         |  |
| 16-GS, tec. Gl. Urk. bis-zu      |  |
| 22-STR, nur Globalurk.           |  |
| 23-Schuldbucheintregung          |  |
| 24-Nur Depoitm. Einbuchg.        |  |
| 98-CBF-Eing. GS-SVG              |  |
| 5-IGL                            |  |
| 9-Girosammelverw.                |  |
| 12-TGL, techn. Globalurk         |  |
| 13-GS-Verwahrung/zentral         |  |
| 15-GS, int. Ra. Urk. Bis-zu      |  |
| 19-Miteigentum Sh. Cert          |  |
| 20-Streifbandverwahrung          |  |
| 21-STR per Erscheinen            |  |
| 88-Sonstige                      |  |
| 91-Haus-Sammelverwahr.           |  |
| 92-Streifband                    |  |
| 96-CBF-Eing. GS-IGL-             |  |
| 97-CBF-Eing. GS                  |  |
| 10                               |  |
| 11                               |  |
| 12                               |  |
| 13                               |  |
| 14                               |  |
| 15                               |  |
| 16                               |  |
| 17                               |  |
| 18                               |  |
| 19                               |  |
| 20                               |  |
| 21                               |  |
| 22                               |  |
| 23                               |  |
| 24                               |  |
| 25                               |  |
| 26                               |  |
| 29                               |  |
| 30                               |  |
| 31                               |  |
| 33                               | <b>Rentenwerte und ähnliche Papiere,<br/>Kategorie 2</b> |
| 34                               |  |
| 35                               |  |
| 40                               |  |
| 41                               |  |
| 42                               |  |
| 43                               |  |
| 66                               |  |
| 67                               |  |
| 68                               |  |
| 102                              |  |
| 127                              |  |
| 132                              |  |
| 133                              |  |
| 134                              |  |
| 136                              |  |
| 137                              |  |
| 138                              |  |
| 139                              |  |
| 199                              |  |
| 200                              |  |
| 202                              |  |
|                                  | <b>Rentenwerte und ähnliche Papiere,<br/>Kategorie 1</b> |

**WP-Gruppe/  
Verwahrmöglichkeit**

1  
2  
3  
4  
5  
6  
7  
8  
9  
46  
48  
50  
52  
53  
54  
55  
57  
58  
59  
101  
103  
117  
119  
120  
128  
129  
142  
143  
144  
149  
153  
154  
157  
158  
159  
160  
161  
162  
163  
164  
165  
166  
167  
168  
169  
170  
171  
172  
173  
174  
175  
176  
177  
178  
179  
180  
182  
183  
184  
185  
186  
187  
188  
189  
190  
198  
201  
203

- 1-JGS bis Ersch.
- 2-JGS bis Einlief.
- 3-SVG
- 6-STV
- 7-STV
- 8-STV Inh. Sammelz. CBF
- 11-GS, stueckelos
- 14-GS, Rahmenurk. bis-zu
- 16-GS, tec. Gl. Urk. bis-zu
- 22-STR, nur Globalurk.
- 23-Schuldbucheintragung
- 24-Nur Depotm. Einbuchg.
- 98-CBF-Eing. GS-SVG
- 5-IGL
- 9-Girosammelverw.
- 12-TGL, techn. Globalurk
- 13-GS-Verwahrung/zentra
- 15-GS, int. Ra. Urk. Bis-zu
- 19-Miteigentum Sh. Cert
- 20-Streifbandverwahrung
- 21-STR per Erscheinen
- 88-Sonstige
- 91-Haus-Sammelverwahr.
- 92-Streifband
- 96-CBF-Eing. GS-IGL-
- 97-CBF-Eing. GS

**Aktienwerte, Investmentfondsanteile und ähnliche Papiere**

| WP-Gruppe/<br>Verwähmöglichkeit |   |
|---------------------------------|---|
| 1-JGS bis Ersch.                |   |
| 2-JGS bis Einlief.              |   |
| 3-SVG                           |   |
| 6-STV                           |   |
| 7-STV                           |   |
| 8-STV Inh. Sammelz. CBF         |   |
| 11-GS, stueckelos               |   |
| 14-GS, Rahmenurk. bis-zu        |   |
| 16-GS, tec. Gl. Urk. bis-zu     |   |
| 22-STR, nur Globalurk.          |   |
| 23-Schuldbucheintragung         |   |
| 24-Nur Depotm. Einbuchg.        |   |
| 98-CBF-Eing. GS-SVG             |   |
| 5-IGL                           |   |
| 9-Girosammelverw.               |   |
| 12-TGL, techn. Globalurk        |   |
| 13-GS-Verwahrung/zentral        |   |
| 15-GS, int. Ra. Urk. Bis-zu     |   |
| 19-Miteigentum Sh. Cert         |   |
| 20-Streifbandverwahrung         |   |
| 21-STR per Erscheinen           |   |
| 88-Sonstige                     |   |
| 91-Haus-Sammelverwahr.          |   |
| 92-Streifband                   |   |
| 96-CBF-Eing. GS-IGL-            |   |
| 97-CBF-Eing. GS                 |   |
| 60                              | <b>Optionsscheine</b>                         |
| 69                              |   |
| 70                              |   |
| 111                             | <b>Bezugsrechte = keine Depotgebühren</b>     |
| 71                              |   |
| 72                              |   |
| 76                              |   |
| 77                              |   |
| 78                              |   |
| 79                              |   |
| 80                              |   |
| 88                              |   |
| 27                              |   |
| 28                              | <b>Reichsmark-Werte = keine Depotgebühren</b> |

Leerseite

## Anhang 2 - Kursbewertungsverfahren zur Depotgebührenberechnung

### Datenbasis

Zur Kursbewertung dient aktuell das "Wertpapier Service System" (WSS). Die steuernden WSS-Tabellen sind

- WSS-Tabelle G16 -- Verwahrmöglichkeit
- WSS-Tabelle G06 -- Wertpapiergruppe

### Kurswährung

Die Kursfeststellung erfolgt grundsätzlich in Euro.

Bei Gattungen in ausländischer Währung wird der festgesetzte Wert mit dem entsprechenden Devisenkurs des Kurses des entsprechenden Wertpapiers multipliziert.

### Reihenfolge der Börsenplätze zur Kursfeststellung

Es werden die Börsenplätze nach folgender Reihenfolge herangezogen:

| Kürzel         | Bezeichnung   |
|----------------|---|
| EDE            | Xetra   |
| EDF            | Frankfurt   |
| EDD            | Düsseldorf  |
| EDM            | München   |
| EDH            | Hamburg   |
| EDB            | Berlin  |
| EDS            | Stuttgart   |
| EDI            | Hannover  |
| EDC            | Bremen  |
| EDX            | Publikums-/WP-Spez.-Fonds   |
| ED             | Priva. Platzierung DTLD<br>/ Rentenbereich = Kurzläufer<br>/ Terminhandel = Kurse durch Maklerangaben<br>/ Finanzierungsschätze = Kurse durch Berechnung (Laufzeit + Diskontsatz) |
| EUA            | Handel mit Eurobonds  |
| ELL            | Börse Luxembourg  |
| EDT            | Terminbörse   |
| Heimatbörse    | entsprechende Eintragung in den WP-Stammdaten (nur Ausland)   |
| Auslandsbörsen |   |

## Kursarten

Die im Rechnungsanhang aufgeführten Kursarten ergeben sich wie folgt:

### **Nominalwert (N)**

Für Rentenpapiere findet keine Kursbewertung statt, sondern der Nominalwert dient als Basis für die Depotgebührenberechnung, sofern sie prozent- und promillnotiert sind.

### **Ultimokurs (U)**

Kursqualität und Reihenfolge der Börsenplätze entsprechen dem Ultimokurs.

Kann zu einem Anforderungsmonat kein Ultimokurs gefunden werden, versucht das Kursermittlungsmodul, den nächst aktuellen Tageskurs innerhalb des angeforderten Monats zu ermitteln.

### **Jahressteuernkurs (S)**

Der Jahressteuernkurs wird herangezogen, wenn bis zum Jahresende weder ein Ultimo- noch ein aktueller Tageskurs vorliegt.

Der Jahressteuernkurs ist in den Wertpapierstammdaten enthalten. Es gibt nur einen Jahressteuernkurs pro Wertpapiergattung. Der Jahressteuernkurs darf nicht weiter als das Datum des letzten Jahresultimos, Ausnahme Januarverarbeitung, zurückliegen.

Handelt es sich um die Jahressteuernkurs-Ermittlung, so wird der Jahressteuer-Devisenkurs über die entsprechende Währung, ansonsten wird über die Notierungs-Währung der Tages-Devisenkurs bzw. der Jahressteuer-Devisenkurs unter Berücksichtigung des Börsenplatzes "Frankfurt" ermittelt.

### **Regeln (R)**

Für die Gattungen, die nach Kursen bewertet werden, und zu denen weder ein Ultimokurs noch ein Jahressteuernkurs vorliegt, kommen feste Regeln (Ersatzparitäten) zur Anwendung. Diese werden über die Wertpapierart gesteuert. Die entsprechenden Regeln je Wertpapierart sind im Anhang 3 aufgeführt.

## Anhang 3 - Ersatzparitäten zur Bewertung von Wertpapieren ohne aktuellen Kurswert

| WP-Art | Bezeichnung  | Regel zur Ermittlung der Ersatzparität |
|--------|--|--|
| 111    | Schuldverschreibungen, Anleihen, Obligationen  | Nennwert=100                           |
| 112    | Pfandbriefe  | Nennwert=100                           |
| 113    | Doppel-/Mehrfachwährungsanleihen   | Nennwert=100                           |
| 114    | Ablösungsanleihen  | Nennwert=100                           |
| 116    | Spar-/Sparkassenobligationen   | Nennwert=100                           |
| 117    | Nichtdeutsche Pfandbriefe  | Nennwert=100                           |
| 118    | Nichtdeutsche öffentliche Pfandbriefe  | Nennwert=100                           |
| 120    | Umtauschanleihen   | Nennwert=100                           |
| 121    | Wandelschuldverschreibungen  | Nennwert=100                           |
| 122    | Doppelwährungs-Wandelanleihen  | Nennwert=100                           |
| 131    | Optionsanleihen cum Optionsschein  | Nennwert=100                           |
| 132    | Optionsanleihen ex Optionsschein   | Nennwert=100                           |
| 133    | Doppelwährungs-Optionsanleihen cum Optionsschein                                     | Nennwert=100                           |
| 134    | Doppelwährungs-Optionsanleihen ex Optionsschein                                      | Nennwert=100                           |
| 135    | Wandelanleihen cum Optionsschein   | Nennwert=100                           |
| 136    | Wandelanleihen ex Optionsschein  | Nennwert=100                           |
| 137    | Anleihen mit Aktienandienungsrecht (Equity-Linked Bonds)                             | Nennwert=100                           |
| 138    | Anleihen mit spezifischem Rückzahlungs-Wahlrecht                                     | Nennwert=100                           |
| 139    | Anleihen mit Rentenandienungsrecht   | Nennwert=100                           |
| 141    | Kassenobligationen   | Nennwert=100                           |
| 142    | Bundeskassenscheine  | Kurswert=0 EUR                         |
| 143    | Gewinnobligationen   | Nennwert=100                           |
| 145    | Erwerbsansprüche auf Renten  | Nennwert=100                           |
| 151    | Verz. Schatzanweisungen  | Nennwert=100                           |
| 152    | Bundesschatzbriefe   | Nennwert=100                           |
| 153    | Finanzierungs-Schätze  | Nennwert=100                           |
| 154    | Bundesschatzanweisungen  | Nennwert=100                           |
| 155    | Bahnschatzanweisungen  | Nennwert=100                           |
| 156    | Postschatzanweisungen  | Nennwert=100                           |
| 157    | Tagesanleihen  | Nennwert=100                           |
| 161    | Deutsche Auslandsbonds (Bund, Bahn, Post, Länder und Gemeinden)                      | Nennwert=100                           |
| 162    | Währungsanleihen deutscher Emittenten (außer Bund, Bahn, Post, Länder und Gemeinden) | Nennwert=100                           |
| 163    | Fundierungsschuldverschreibungen nach Young-Anleihe                                  | Nennwert=100                           |
| 164    | Eurex-Bonds  | Kurswert=0 EUR                         |
| 165    | European Covered Bonds   | Nennwert=100                           |
| 166    | Optionsscheine (Warrants) auf Edelmetall - Basket                                    | Kurswert=1                             |
| 167    | Optionsscheine (Warrants) auf Edelmetall - Basket mit Kock-out Charakter             | Kurswert=1                             |
| 171    | Unverz. Schatzanweisungen  | Nennwert=100                           |
| 180    | Zero-Medium-Term Notes   | Zerobond-Formel <sup>1</sup>           |
| 181    | Zero-Bonds   | Zerobond-Formel <sup>1</sup>           |
| 182    | Zero-Wandelanleihen  | Zerobond-Formel <sup>1</sup>           |
| 183    | Zero-Optionsanleihen cum Optionsschein   | Zerobond-Formel <sup>1</sup>           |
| 184    | Zero-Optionsanleihen ex Optionsschein  | Zerobond-Formel <sup>1</sup>           |
| 185    | Certificates of Deposit  | Nennwert=100                           |
| 186    | Fonds Index  | Nennwert=100                           |
| 187    | Index-Zertifikate auf Fonds-Index  | Kurswert=Emissionspreis                |
| 188    | Index-Zertifikate auf Fonds  | Kurswert=Emissionspreis                |
| 191    | Schuldscheine  | Nennwert=100                           |
| 192    | Reserviert für bankinterne Verwendung, keine Belegung von WM                         | Nennwert=100                           |
| 193    | Reserviert für bankinterne Verwendung, keine Belegung von WM                         | Nennwert=100                           |
| 201    | Spar-/Sparkassen-Briefe  | Nennwert=100                           |
| 211    | Asset Backed Securities  | Nennwert=100                           |
| 212    | Asset Backed Commercial Papers   | Nennwert=100                           |
| 213    | Asset Backed Commercial Papers Prog.   | Nennwert=100                           |

| WP-Art | Bezeichnung   | Regel zur Ermittlung der Ersatzparität                    |
|--------|---|---|
| 216    | Medium-Term Notes   | Nennwert=100  |
| 217    | Commercial Papers   | Nennwert=100  |
| 218    | Commercial Paper- bzw. Medium Term Note-Programme                                       | Nennwert=100  |
| 219    | Zinssicherungs-/Zinsausgleich-Zertifikate   | Kurswert=1  |
| 220    | Strip-VVPR  | Kurswert=0 EUR  |
| 221    | Zinsansprüche   | Nennwert=100  |
| 222    | Credit Linked Notes   | Nennwert=100  |
| 223    | Mortgage Backed Securities  | Nennwert=100  |
| 224    | Asset Backed Medium-Term Notes  | Nennwert=100  |
| 225    | Swap-Anleihe  | Nennwert=100  |
| 226    | Zero Asset Backed Medium-Term Notes   | Nennwert=100  |
| 227    | Medium-Term Pfandbriefe   | Nennwert=100  |
| 228    | öffentliche Medium-Term Pfandbriefe   | Nennwert=100  |
| 229    | nichtdeutsche Medium-Term Pfandbriefe   | Nennwert=100  |
| 230    | nichtdeutsche öffentliche Medium-Term Pfandbriefe                                       | Nennwert=100  |
| 231    | Credit Linked Medium-Term Notes   | Nennwert=100  |
| 232    | Medium-Term Notes mit Aktienandienungsrecht   | Nennwert=100  |
| 233    | Zero Medium-Term Notes mit Aktienandienungsrecht  | Nennwert=100  |
| 234    | Indikativer, fortlaufender Fondsanteilwert  | Kurswert=0 EUR  |
| 235    | Medium-Term Notes mit Rentenandienungsrecht   | Nennwert=100  |
| 236    | Doppelwährungs-Medium-Term Notes  | Nennwert=100  |
| 237    | Medium-Term Notes mit spezifischem Rückzahlungs-Wahlrecht                               | Nennwert=100  |
| 238    | Zero Medium-Term Notes mit Rentenandienungsrecht  | Zerobond-Formel <sup>1</sup>                              |
| 239    | Convertible Medium-Term Notes   | Nennwert=100  |
| 240    | Zero-Convertible Medium-Term Notes  | Zerobond-Formel <sup>1</sup>                              |
| 241    | Exchangeable Medium-Term Notes  | Nennwert=100  |
| 242    | Zero-Exchangeable Medium-Term Notes   | Zerobond-Formel <sup>1</sup>                              |
| 243    | Zero-Doppelwährung-Medium-Term Notes  | Zerobond-Formel <sup>1</sup>                              |
| 244    | Inflationsindizierte Anleihen   | Nennwert=100  |
| 245    | Inflation Linked Medium-Term Notes  | Nennwert=100  |
| 246    | Zero Bond mit Tilgungsabhängigkeit  | Zerobond-Formel <sup>1</sup>                              |
| 247    | Zero Medium-Term Notes mit Tilgungsabhängigkeit   | Zerobond-Formel <sup>1</sup>                              |
| 248    | Fonds auf Lebensversicherungen  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979                 |
| 249    | Emissionszertifikate  | Kurswert=0 EUR  |
| 250    | Loan Participation Notes  | Nennwert=100  |
| 251    | Eurex Bonds Break Even Trades   | not relevant, no security                                 |
| 511    | Stammaktien   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Akt. 846998                 |
| 512    | Vorzugsaktien   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Akt. 846998                 |
| 513    | Sparaktien  | Kurswert=0 EUR  |
| 514    | Aktien mit Rentencharakter  | Kurswert=0 EUR  |
| 515    | Units (aus verschiedenen Wertpapieren zusammengesetzte)                                 | Kurswert=0 EUR  |
| 516    | Guaranteed-Return-On-Investment-Units   | Kurswert=0 EUR  |
| 517    | Currency-linked-Outperformance-Units  | Kurswert=0 EUR  |
| 518    | Index Growth Linked Units   | Kurswert=0 EUR  |
| 519    | Optimised Portfolios as Listed Securities (OPALS)                                       | Kurswert=0 EUR  |
| 520    | Genossenschaftsanteile  | Kurswert=0 EUR  |
| 521    | Teilrecht auf Berichtigungsaktien   | Kurswert=Emittenten Ursprung/<br>Emissionspreis sonst "0" |
| 522    | Deutsche Spitzen-Konten/Aktien  | Kurswert=Emittenten Ursprung/<br>Emissionspreis sonst "0" |
| 523    | Ausländische Spitzen-Konten/Aktien  | Kurswert=Emittenten Ursprung/<br>Emissionspreis sonst "0" |
| 524    | Deutsche Spitzen-Konten/Renten  | Kurswert=Nennwert/Stückzahl-100                           |
| 525    | Ausländische Spitzen-Konten/Renten  | Nennwert=100  |
| 526    | Units (aus verschiedenen Wertpapieren zusammengesetzte)<br>aktienähnlich                | Kurswert=0 EUR  |
| 527    | Units (aus verschiedenen Wertpapieren zusammengesetzte)<br>rentenähnlich                | Kurswert=0 EUR  |
| 528    | Certificats d' Investissement représentatifs de droits pécuniaires (Loi<br>83-1 Art.20) | Kurswert=0 EUR  |
| 529    | Wandelgenußrechte/-scheine (gem. §10 Abs.5 KWG)   | Kurswert=1  |
| 530    | Wandelgenußrechte/-scheine (sonstige)   | Kurswert=1  |
| 531    | Genußrechte/-scheine (gem. §10 Abs.5 KWG)   | Kurswert=1  |
| 532    | Genußrechte/-scheine (sonstige)   | Kurswert=1  |
| 533    | Partizipationsscheine   | Kurswert=1  |
| 534    | Gewinnscheine   | Kurswert=0 EUR  |

| WP-Art | Bezeichnung   | Regel zur Ermittlung der Ersatzparität |
|--------|---|--|
| 535    | Optionsgenußrechte/-scheine (gem. §10 Abs.5 KWG) cum Optionsschein              | Kurswert=0 EUR                         |
| 536    | Optionsgenußrechte/-scheine (sonstige) cum Optionsschein                        | Kurswert=0 EUR                         |
| 537    | Optionsgenußrechte/-scheine (gem. §10 Abs.5 KWG) ex Optionsschein               | Kurswert=0 EUR                         |
| 538    | Optionsgenußrechte/-scheine (sonstige) ex Optionsschein                         | Kurswert=0 EUR                         |
| 539    | Droit de Vote/Stimmrecht  | Kurswert=0 EUR                         |
| 540    | Shares/Units of Beneficial Interest   | Kurswert=0 EUR                         |
| 541    | Bezugsrechte auf Aktien   | Kurswert=0 EUR                         |
| 542    | Bezugsrechte auf Wandel-/Optionsanleihen  | Kurswert=0 EUR                         |
| 543    | Bezugsrechte auf Erwerbsansprüche   | Kurswert=0 EUR                         |
| 544    | Bezugsrechte auf sonstige Werte   | Kurswert=0 EUR                         |
| 545    | Erwerbsansprüche auf Aktien   | Kurswert=0 EUR                         |
| 546    | Erwerbszertifikate  | Kurswert=0 EUR                         |
| 547    | Bezugsrechte auf Fonds-Anteile  | Kurswert=0 EUR                         |
| 548    | Redemption Rights   | Kurswert=0 EUR                         |
| 550    | Stock-Options   | Kurswert=1                             |
| 551    | Optionsscheine (Warrants) für Aktien  | Kurswert=1                             |
| 552    | Optionsscheine (Covered Warrants) für Aktien                                    | Kurswert=1                             |
| 553    | Optionsscheine (Warrants) für Investmentanteile                                 | Kurswert=1                             |
| 554    | Optionsscheine (Covered Warrants) für Investmentanteile                         | Kurswert=1                             |
| 555    | Optionsscheine (Warrants) für Anleihen  | Kurswert=1                             |
| 556    | Optionsscheine (Covered Warrants) für Anleihen                                  | Kurswert=1                             |
| 557    | Optionsscheine (Warrants) für Währung   | Kurswert=1                             |
| 558    | Optionsscheine (Warrants) für Gold  | Kurswert=1                             |
| 559    | Optionsscheine (Warrants) für sonstige Werte                                    | Kurswert=1                             |
| 560    | COT-Optionen  | Kurswert=1                             |
| 561    | Kuxe  | Kurswert=1                             |
| 562    | Optionsscheine (Warrants) auf Indices - deaktiviert ab 01.01.1998               | Kurswert=1                             |
| 563    | Optionsscheine (Warrants) auf Futures   | Kurswert=1                             |
| 564    | Optionsscheine (Warrants) auf Options   | Kurswert=1                             |
| 565    | Optionsscheine (Warrants) auf Renten-Index                                      | Kurswert=1                             |
| 566    | Optionsscheine (Warrants) auf Aktien-Index                                      | Kurswert=1                             |
| 567    | Optionsscheine (Warrants) auf Optionen-Index                                    | Kurswert=1                             |
| 568    | Optionsscheine (Warrants) auf Wertpapierkorb                                    | Kurswert=1                             |
| 569    | Optionsscheine (Warrants) auf Währungskorb                                      | Kurswert=1                             |
| 570    | Optionsscheine (Warrants) auf Zertifikate                                       | Kurswert=1                             |
| 571    | Liquidations-Anteilscheine  | Kurswert=1                             |
| 572    | Umwandlungsscheine  | Kurswert=1                             |
| 573    | Optionsscheine (Warrants) auf Silber  | Kurswert=1                             |
| 574    | Optionsscheine (Warrants) auf Rohstoff  | Kurswert=1                             |
| 575    | Optionsscheine (Warrants) auf Indexkorb   | Kurswert=1                             |
| 576    | Optionsscheine (Warrants) auf Platin  | Kurswert=1                             |
| 577    | Covered Warrants für Investmentanteile - Basket                                 | Kurswert=1                             |
| 578    | Covered Warrants auf sonstige   | Kurswert=1                             |
| 579    | Optionsscheine ( Covered Warrants ) auf sonstige, mit KnockOut - Charakter      | Kurswert=1                             |
| 581    | Bezugsscheine (auch Scrips)   | Kurswert=0 EUR                         |
| 582    | Besserungsscheine (aus RM-Umst.)  | Kurswert=0 EUR                         |
| 583    | Restquoten (aus RM-Umst.)   | Kurswert=0 EUR                         |
| 584    | Lose Kupons   | Kurswert=0 EUR                         |
| 585    | ABS - Transaktion (kein echtes Wertpapier z.B. WKN A0C4ZG)                      | Kurswert=0 EUR                         |
| 593    | Index-Zertifikate mit sonstigem Underlying                                      | Kurswert=Emissionspreis                |
| 594    | Index-Zertifikate mit Underlying Edelmetalle/Edelmetall-Index                   | Kurswert=Emissionspreis                |
| 595    | Index-Zertifikate mit Underlying Aktien   | Kurswert=Emissionspreis                |
| 596    | Index-Zertifikate mit Underlying Aktien-Index                                   | Kurswert=Emissionspreis                |
| 597    | Index-Zertifikate mit Underlying Renten   | Kurswert=Emissionspreis                |
| 598    | Index-Zertifikate mit Underlying Renten-Index                                   | Kurswert=Emissionspreis                |
| 599    | Index-Zertifikate mit sonstigem Underlying und Knock Out-Charakter              | Kurswert=Emissionspreis                |
| 600    | Index-Zertifikate m. Underlying Edelmet./Edelmetall-Index u.Knock Out-Charakter | Kurswert=Emissionspreis                |
| 601    | Index-Zertifikate mit Underlying Aktien und Knock Out-Charakter                 | Kurswert=Emissionspreis                |
| 602    | Index-Zertifikate mit Underlying Aktien-Index und Knock Out-Charakter           | Kurswert=Emissionspreis                |
| 603    | Index-Zertifikate mit Underlying Renten und Knock Out-Charakter                 | Kurswert=Emissionspreis                |
| 604    | Index-Zertifikate mit Underlying Renten-Index und Knock Out-Charakter           | Kurswert=Emissionspreis                |

| WP-Art | Bezeichnung  | Regel zur Ermittlung der Ersatzparität    |
|--------|--|---|
| 605    | Index-Zertifikate mit Underlying Währung und KnockOut-Charakter  | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 606    | Index-Zertifikate mit Underlying Währung   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 607    | INDEX-Certifikate mit sonst. Underl. u. Optionsscheincharakter   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 608    | INDEX-Certifikate m. Underlying Edelmetalle/Edelmetall-Index u. Optionsscheincharakter                         | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 609    | INDEX-Certifikate m. Underlying Aktien u. Optionsschein- charakter   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 610    | INDEX-Certifikate m. Underlying Aktien-Index u. Optionsscheincharakter   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 611    | INDEX-Certifikate m. Underlying Renten u. Optionsscheincharakter   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 612    | INDEX-Certifikate m. Underlying Renten-Index u. Optionsscheincharakter   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 613    | INDEX-Certifikate m. Underlying Währung u. Optionsscheincharakter  | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 615    | Trust Preferred Securities (TPS) (aus verschiedenen Wertpapieren zusammengesetzte), ohne spezifische Zuordnung | Nennwert=100                              |
| 616    | Private Equity Beteiligungen   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 617    | Trust Preferred Securities (TPS) (aus verschiedenen Wertpapieren zusammengesetzte), aktienähnlich              | Nennwert=100                              |
| 618    | Trust Preferred Securities (TPS) (aus verschiedenen Wertpapieren zusammengesetzte), rentenähnlich              | Nennwert=100                              |
| 619    | Zero Bond Xetra-Gold   | Zerobond-Formel <sup>1</sup>              |
| 801    | Collateral Debt Obligationen   | Nennwert=100                              |
| 802    | Synthetic Collateral Debt Obligationen   | Nennwert=100                              |
| 803    | Escrow Zertifikate   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 805    | Indexfonds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 806    | Deutsche offene Fonds auf Optionsscheine   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 807    | Deutsche geschlossene Fonds auf Optionsscheine   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 808    | Ausländische offene Fonds auf Optionsscheine   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 809    | Ausländische geschlossene Fonds auf Optionsscheine   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 810    | Geschlossene Rentenfonds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 811    | Rentenfonds  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 812    | Aktienfonds  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 813    | Gemischte Fonds:<br>Alle Ausländischen bzw. Deutschen bis 70% Aktienanteil                                     | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 814    | Gemischte Fonds:<br>Nur Deutsche mit mehr als 70% Aktienanteil   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 815    | Geschlossener gemischter Fonds bis 70% Aktienanteil  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 816    | Geschlossener gemischter Fonds mit mehr als 70% Aktienanteil   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 817    | Geschlossener Aktienfonds  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 818    | Geschlossene Beteiligungsfonds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 821    | Offene Immobilienfonds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 822    | Closed-End Funds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 823    | Deutsche offene geldmarktnahe Fonds  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 824    | Deutsche geschlossene geldmarktnahe Fonds  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 825    | Ausländische offene Geldmarktfonds   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 826    | Ausländische geschlossene Geldmarktfonds   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 827    | Geschlossene Immobilienfonds in Form von Kommanditgesellschaften   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 828    | Geschlossene Immobilienfonds in Form von Bruchteils-<br>gemeinschaften   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 829    | Deutsche offene Geldmarktfonds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 830    | Deutsche geschlossene Geldmarktfonds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 831    | Geschlossener Immobilienfonds  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 832    | Offener Investmentfonds  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 833    | Geschlossener Investmentfonds  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 834    | Ausländische offene geldmarktnahe Fonds  | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 835    | Ausländische geschlossene geldmarktnahe Fonds  | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 836    | Deutsche offene Terminmarktfonds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 837    | Deutsche geschlossene Terminmarktfonds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 839    | Ausländische offene Terminmarktfonds   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 840    | Ausländische geschlossene Terminmarktfonds   | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 841    | Altersvorsorge-Sondervermögen  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 842    | Dachfonds  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 843    | Investmentaktiengesellschaften   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 844    | Gemischte Wertpapier- und Grundstück-Sondervermögen  | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |

| WP-Art | Bezeichnung   | Regel zur Ermittlung der Ersatzparität    |
|--------|---|---|
| 846    | Option auf Indexfonds   | Kurswert=0 EUR                            |
| 847    | Future auf Indexfonds   | Kurswert=0 EUR                            |
| 848    | Future auf Zinssatz   | Kurswert=0 EUR                            |
| 849    | Future auf Währung  | Kurswert=0 EUR                            |
| 850    | Future auf synthetische Anleihe   | Kurswert=0 EUR                            |
| 851    | Future auf Anleihe (ohne synthetische Anleihe)                                  | Kurswert=0 EUR                            |
| 852    | Future auf Geldmarktsatz  | Kurswert=0 EUR                            |
| 853    | Future auf Aktien-Index   | Kurswert=0 EUR                            |
| 854    | Option auf Future auf Sonstiges   | Kurswert=0 EUR                            |
| 855    | Option auf Aktien-Index   | Kurswert=0 EUR                            |
| 856    | Option auf Währung  | Kurswert=0 EUR                            |
| 857    | Option auf Aktie  | Kurswert=0 EUR                            |
| 858    | Future auf Aktie  | Kurswert=0 EUR                            |
| 859    | Option auf Future auf Aktie   | Kurswert=0 EUR                            |
| 860    | Option auf Anleihe (ohne synthetische Anleihe)                                  | Kurswert=0 EUR                            |
| 861    | Option auf Future auf Anleihe (ohne synthetische Anleihe)                       | Kurswert=0 EUR                            |
| 862    | Option auf synthetische Anleihe   | Kurswert=0 EUR                            |
| 863    | Option auf Future auf synthetische Anleihe                                      | Kurswert=0 EUR                            |
| 864    | Option auf Future auf Aktien-Index  | Kurswert=0 EUR                            |
| 865    | Option auf Renten-Index   | Kurswert=0 EUR                            |
| 866    | Future auf Renten-Index   | Kurswert=0 EUR                            |
| 867    | Option auf Future auf Renten-Index  | Kurswert=0 EUR                            |
| 868    | Option auf sonstigen Index  | Kurswert=0 EUR                            |
| 869    | Future auf sonstigen Index  | Kurswert=0 EUR                            |
| 870    | Option auf Future auf sonstigen Index   | Kurswert=0 EUR                            |
| 871    | Option auf Future auf Währung   | Kurswert=0 EUR                            |
| 872    | Option auf Zinssatz   | Kurswert=0 EUR                            |
| 873    | Option auf Future auf Zinssatz  | Kurswert=0 EUR                            |
| 874    | Option auf Geldmarktsatz  | Kurswert=0 EUR                            |
| 875    | Option auf Future auf Geldmarktsatz   | Kurswert=0 EUR                            |
| 876    | Option auf Commodity (außer Edelmetall)   | Kurswert=0 EUR                            |
| 877    | Future auf Commodity (außer Edelmetall)   | Kurswert=0 EUR                            |
| 878    | Option auf Future auf Commodity (außer Edelmetall)                              | Kurswert=0 EUR                            |
| 879    | Option auf Basket   | Kurswert=0 EUR                            |
| 880    | Future auf Basket   | Kurswert=0 EUR                            |
| 881    | Option auf Future auf Basket  | Kurswert=0 EUR                            |
| 882    | Option auf Swap   | Kurswert=0 EUR                            |
| 883    | Future auf Swap   | Kurswert=0 EUR                            |
| 884    | Option auf Future auf Swap  | Kurswert=0 EUR                            |
| 885    | Option auf Sonstiges  | Kurswert=0 EUR                            |
| 886    | Future auf Sonstiges  | Kurswert=0 EUR                            |
| 887    | Product-Spreads   | Kurswert=0 EUR                            |
| 888    | Option auf Gold   | Kurswert=0 EUR                            |
| 889    | Future auf Gold   | Kurswert=0 EUR                            |
| 890    | Option auf Future auf Gold  | Kurswert=0 EUR                            |
| 891    | Option auf Silber   | Kurswert=0 EUR                            |
| 892    | Future auf Silber   | Kurswert=0 EUR                            |
| 893    | Option auf Future auf Silber  | Kurswert=0 EUR                            |
| 894    | Option auf Platin   | Kurswert=0 EUR                            |
| 895    | Future auf Platin   | Kurswert=0 EUR                            |
| 896    | Option auf Future auf Platin  | Kurswert=0 EUR                            |
| 897    | Single-Hedgefonds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 898    | Dach-Hedgefonds   | Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979 |
| 900    | Optionsscheine (Covered Warrants auf Aktien m. Knock Out-Charakter)             | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 901    | Optionsscheine (Covered Warrants auf Investmentanteile mit Knock Out-Charakter) | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 902    | Optionsscheine (Covered Warrants auf Renten m. Knock Out-Charakter)             | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 903    | Optionsscheine (Warrants auf Währung m. Knock Out-Charakter)                    | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 904    | Optionsscheine (Warrants auf Gold m. Knock Out-Charakter)                       | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 905    | Optionsscheine (Warrants auf Silber m. Knock Out-Charakter)                     | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 906    | Optionsscheine (Warrants auf Future m. Knock Out-Charakter)                     | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 907    | Optionsscheine (Warrants auf Options m. Knock Out-Charakter)                    | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 908    | Optionsscheine (Warrants auf Renten-Index m. Knock Out-Charakter)               | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 909    | Optionsscheine (Warrants auf Aktien-Index m. Knock Out-Charakter)               | Kurswert=Emissionspreis                   |
| 910    | Optionsscheine (Warrants auf Optionen-Index m. Knock Out-Charakter)             | Kurswert=Emissionspreis                   |

| WP-Art  | Bezeichnung   | Regel zur Ermittlung der Ersatzparität          |
|---------|---|---|
| 911     | Optionsscheine (Warrants auf Wertpapierkorb m. Knock Out-Charakter)                                 | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 912     | Optionsscheine (Warrants auf Währungskorb m. Knock Out-Charakter)                                   | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 913     | Optionsscheine (Warrants auf Zertifikate m. Knock Out-Charakter)                                    | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 914     | Optionsscheine (Warrants auf sonstige Werte m. Knock Out-Charakter)                                 | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 915     | Optionsscheine (Warrants auf Rohstoff m. Knock Out-Charakter)                                       | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 916     | Optionsscheine (Covered) auf Indexkorb m. Knock Out-Charakter)                                      | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 917     | Index-Zertifikate mit sonstigem Underlying, Optionsschein und Knock Out-Charakter                   | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 918     | Index-Zertifikate mit Underlying Edelmetall/Edelmetall-Index, Optionsschein und Knock Out-Charakter | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 919     | Index-Zertifikate mit Underlying Aktien, Optionsschein und Knock Out-Charakter                      | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 920     | Index-Zertifikate mit Underlying Aktien-Index, Optionsschein und Knock Out-Charakter                | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 921     | Index-Zertifikate mit Underlying Renten, Optionsschein und Knock Out-Charakter                      | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 922     | Index-Zertifikate mit Underlying Renten-Index, Optionsschein und Knock Out-Charakter                | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 923     | Index-Zertifikate mit Underlying Währung, Optionsschein und Knock Out-Charakter                     | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 924     | Optionsscheine (Warrants) auf Edelmetall (ohne Gold, Silber, Platin)                                | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 925     | Optionsscheine (Warrants) auf Edelmetall (ohne Gold, Silber, Platin) mit Knock Out-Charakter        | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 926     | Optionsschein (Warrants) auf Platin mit Knock Out-Charakter   | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 927     | Covered Warrants auf Zertifikate  | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 928     | Covered Warrants auf Wertpapierkorb   | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 929     | Covered Warrants auf Wertpapierkorb mit Knock -Out-Charakter  | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 930     | Covered Warrants auf Zertifikate mit Knock -Out-Charakter   | Kurswert=Emissionspreis                         |
| 931     | REITS   | Kurswert=Durchschnittskurs dt. Aktien<br>846998 |
| 932     | Palladium   | Kurswert=0 EUR                                  |
| 933     | Rohöl   | Kurswert=0 EUR                                  |
| 948     | Volatilitäts-Index  | Kurswert=0 EUR                                  |
| 949     | Swap-Satz   | Kurswert=0 EUR                                  |
| 950     | Sonstige Indices  | Kurswert=0 EUR                                  |
| 951     | Aktien-Index  | Kurswert=0 EUR                                  |
| 952     | Renten-Index  | Kurswert=0 EUR                                  |
| 953     | Optionen-Index  | Kurswert=0 EUR                                  |
| 954     | Währung   | Kurswert=0 EUR                                  |
| 955     | Geldmarktsatz/sonstiger Zinssatz  | Kurswert=0 EUR                                  |
| 956     | Cross-Rate  | Kurswert=0 EUR                                  |
| 957     | Rohstoffe   | Kurswert=0 EUR                                  |
| 958     | Strom   | Kurswert=0 EUR                                  |
| 959-990 | Reserviert für bankinterne Verwendung, keine Belegung von WM  | Kurswert=0 EUR                                  |
| 991     | Reserviert für bankinterne Verwendung, Interims Aktie, keine Belegung von WM                        | Kurswert=1                                      |
| 992     | Reserviert für bankinterne Verwendung, Interims Rente, keine Belegung von WM                        | Nennwert=100                                    |
| 993     | Reserviert für bankinterne Verwendung, Interims Invest, keine Belegung von WM                       | Kurswert=1                                      |
| 994     | Reserviert für bankinterne Verwendung, allgemein Renten, keine Belegung von WM                      | Nennwert=100                                    |
| 995     | Reserviert für bankinterne Verwendung, keine Belegung von WM  | Kurswert=1                                      |
| 996     | Reserviert für bankinterne Verwendung, keine Belegung von WM  | Kurswert=1                                      |
| 998     | Reserviert für bankinterne Verwendung, keine Belegung von WM  | Kurswert=1                                      |
| 999     | Sonstige  | Kurswert=1                                      |

1. Formel Zerobonds:

Kurs = Ausst-Rendite x Ablaufzeit/Gesamtlaufzeit + Emissionskurs wobei

Ausst-Rendite = 100 - Emissionskurs,

Gesamtlaufzeit = Differenz in Monaten zwischen Emissionstag und Zinslaufende bzw. letztem Tilgungstermin und

Ablaufzeit = Differenz in Monaten zwischen Emissionstag und Bewertungsdatum ist.



---

**Kontakt**

[marketing@clearstream.com](mailto:marketing@clearstream.com)  
[www.clearstream.com](http://www.clearstream.com)

**Veröffentlicht von**

**Clearstream Banking Frankfurt**

**Eingetragene Adresse**

Clearstream Banking AG, Frankfurt  
Neue Börsenstraße 1  
60487 Frankfurt am Main

**Postanschrift**

Clearstream Banking  
60485 Frankfurt am Main

Dezember 2008

Dokument-Nummer: F-CI02

---