

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: Mai 2009

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 (2009). Alle Rechte vorbehalten.

Clearstream Banking ist ein Unternehmen der Gruppe Deutsche Börse.

Inhalt

1. Allgemeines	1
1.1 Gültigkeit	1
1.2 Rechnungswährung	1
1.3 Zahlungsbedingungen	1
1.4 Rechnungsempfängerkonzept	1
2. Grundlegende Konzepte, Erläuterungen und Beispiele	2
2.1 Depotführung	2
2.2 Wertpapierüberträge und Zahlungsaufträge	4
2.3 Kommunikation	6
3. Depotführung	7
3.1 Rentenwerte	7
3.2 Aktienwerte	9
3.3 Optionsscheine	11
3.4 Verbriefte Rohstoffe der Deutschen Börse Commodities GmbH (DBCo)	11
4. Wertpapierüberträge, Zahlungsaufträge und damit verbundene Kommunikation	12
4.1 Börsengeschäfte,	12
4.2 OTC-Transaktionen ² ,	12
4.3 Cross-Border Transaktionen	14
4.4 Sonstige Wertpapiertransaktionen	14
5. Depotservice	15
5.1 Dienstleistungen Tresor	15
5.2 Dienstleistungen Emissionen	16
5.3 Dienstleistungen aus Kapitaldiensten und Steuern	17
5.4 Dienstleistungen Namensaktien	18
6. Kommunikation	19
6.1 Depotservice bezogene Kommunikation	19
6.2 Statement of Holdings: Volumenbezogenes Rabattschema	19
6.3 Sonstige Meldungen	19
6.4 CASCADE File-Transfer in ISO7775 zusätzlicher Pauschalbetrag	19
7. Dienstleistungen für die Geldverrechnung über die Deutsche Bundesbank	20
7.1 Verspätete Bereitstellung von Deckung gemäß Dispositionssaldo	20
7.2 Manueller Ausgleich der Geldkonten, täglich oder monatlich	20
8. Wertpapierleihe	21
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	22
8.5 Collateral Swap	22

9. Xemac®	23
9.1 Collateral Management	23
9.2 Über Xemac an CBF übereignete Sicherheiten1,	23
9.3 Leitungspreise für optionale Xemac Standleitungen	23
10. Abgeltungsteuer Taxbox Service	24
10.1 Einmaliges Setup inklusive Anbindung (Erhebung für jeden fachlichen Teilnehmer). . .	24
10.2 Senden von Datensätzen (Preis pro Datensatz).	24
10.3 Empfangen von Datensätzen (Preis pro Datensatz).	24
11. Sonderarbeiten, Beratungsdienstleistungen sowie manuelle Tätigkeiten	24
11.1 Stundensatz für Sonderarbeiten	24
11.2 Tagessatz für Beratungs- und Sonderdienstleistungen	24
11.3 Zuschlag für manuelle Tätigkeiten	24
Anhang 1 - Instrumentkategorisierung	25
Anhang 2 - Kursbewertungsverfahren zur Depotgebührenberechnung	29
Anhang 3 - Ersatzparitäten zur Bewertung von Wertpapieren ohne aktuellen Kurswert	31
Anhang 4 - CASCADE File-Transfer: Migration von ISO7775 auf ISO15022 Standard	37

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. Mai 2009**. Änderungen dieses Verzeichnisses werden den Kunden entsprechend mitgeteilt und auf der Clearstream Banking Internetseite unter 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-Rabattstafel

Anhand des nachfolgenden Beispiels lässt sich die Logik der diskreten Rabattstafeln 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 Rabattstafel setzt sich wie folgt zusammen:

Depotwert (in Mio. EUR) Kurswert von bis		Teilvolumen Mio. EUR	Zugehöriger Preis in Basispunkten (0,01%)	Monatliches Entgelt (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
Summe/Jahr		35.000		1.605.000
Monatsbelastung				1.605.000 / 12 133.750

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 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
Summe Bestand p.r.t.		31	402.000 402.000/31=12.968

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 70.000	GS Euroland Wertpapiere 10.000
Wertpapierübertrag (vor Abzug Rabatt):	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
Transaktionsentgelt gesamt (vor Abzug Rabatt):	0,625 Euro	1,225 Euro
./.. Volumenrabatt:	7,5 %	7,5 %
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
Transaktionsentgelt gesamt (nach Abzug Rabatt):	0,578 Euro	1.133 Euro
Wertpapierüberträge im Monat (nach Abzug Rabatt):	16.187,50 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
Transaktionsentgelt gesamt (nach Abzug Rabatt):	40.468,75 Euro	11.331,25 Euro

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

Anzahl der Transaktionen im Monat	DVP 70.000	FOP 2.500	DVP RTS 3.000	Cross-Border ¹ 2.000
Wertpapierübertrag (vor Abzug Rabatt):	0,125 Euro	0,125 Euro	0,500 Euro	1.40 Euro
Zahlungsauftrag (vor Abzug Rabatt):	0,300 Euro	-	0,500 Euro	0,300 Euro
Kommunikationspauschale (vor Abzug Rabatt):	0,200 Euro	0,200 Euro	0,200 Euro	0,200 Euro
Transaktionsentgelt gesamt (vor Abzug Rabatt):	0,625 Euro	0,325 Euro	1,200 Euro	2,200 Euro
./. Volumenrabatt:	7,5 %	7,5 %	7,5 %	0,0 %
Wertpapierübertrag (nach Abzug Rabatt):	0,116 Euro	0,116 Euro	0,463 Euro	1.40 Euro
Zahlungsauftrag (nach Abzug Rabatt):	0,278 Euro	-	0,463 Euro	0,300 Euro
Kommunikationspauschale (nach Abzug Rabatt):	0,185 Euro	0,185 Euro	0,185 Euro	0,200 Euro
Transaktionsentgelt gesamt (nach Abzug Rabatt):	0,578 Euro	0,301 Euro	1,110 Euro	2,200 Euro
Wertpapierüberträge im Monat (nach Abzug Rabatt):	8.093,75 Euro	289,06 Euro	1.387,50 Euro	2,800 Euro
Zahlungsaufträge im Monat (nach Abzug Rabatt):	19.425,00 Euro	-	1.387,50 Euro	600,00 Euro
Kommunikationspauschale im Monat (nach Abzug Rabatt):	12.950,00 Euro	462,50 Euro	555,00 Euro	400,00 Euro
Transaktionsentgelt gesamt (nach Abzug Rabatt):	40.468,75 Euro	751,56 Euro	3.330,00 Euro	3.800,00 Euro

1. gilt nicht für den DTCC Link, für welchen ein Cross Border Wertpapierübertrag 2.00 EUR kostet.

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“

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

3. Depotführung

3.1 Rentenwerte

3.1.1 Rentenwerte und ähnliche effektive Papiere einschließlich Aktienwerte in Prozentnotierung

Depotvolumen (in Mio. EUR)		Kategorie I
Nominalwert		In effektiven Einzelkunden verbriefte Renten
von	bis	
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 (in Mio. EUR)		Kategorie II
Nominalwert		In Dauerglobalurkunden sowie Schuldbuchforderungen verbriefte Renten
von	bis	
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 GS¹: Europäische Renten via Cross-Border-Links, außer schweizer Werte

Depotvolumen (in Mio. EUR) Nominalwert von bis		Europäische GS-Renten (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 SIX SIS, Zürich

Depotvolumen (in Mio. EUR) Nominalwert von bis		Schweizer GS-Renten (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 (in Mio. EUR) Nominalwert von bis		US GS-Renten (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 (in Mio. EUR) Nominalwert von bis		Int. Renten in Girosammelverwahrung (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 (in Mio. EUR)		Aktien, Investmentfonds und ähnliche Papiere
Kurswert 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: Europäische Aktien via Cross-Border-Links, außer schweizer Werte

Depotvolumen (in Mio. EUR)		Europäische GS-Aktien
Kurswert 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 SIX SIS, Zürich

Depotvolumen (in Mio. EUR)		Schweizer GS-Aktien
Kurswert 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 (in Mio. EUR)		US GS-Aktien
Kurswert 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 (in Mio. EUR)		Int. Aktien in Girosammelverwahrung
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)¹

Depotvolumen (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 SIX SIS, Zürich

Depotvolumen (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 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 (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^{1, 2}

4.1.1 Abwicklung

Abwicklung	GS und STR (EUR)	GS US und Euroland ¹ (EUR)
Wertpapierübertrag	0,250	0,850
Zahlungsauftrag (MwSt frei)	0,300	0,300
Kommunikationspauschale	0,075	0,075
Abwicklungsentgelt gesamt	0,625	1,225

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^{2, 3}

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
Abwicklungsentgelt gesamt	0,625	1,200

- 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 Abwicklung¹

Abwicklung	Wertpapierübertrag		
	über CBL EUR	über DTCC EUR	über CSD-Link ¹ EUR
Wertpapierübertrag ²	1,400	2,000	1,400
Zahlungsauftrag (MwSt frei)	0,300	0,300	0,300
Kommunikationspauschale	0,200	0,200	0,200
Abwicklungsentgelt gesamt	1,900	2,500	1,900

1. Cross-Border Wertpapierüberträge über die CSD-Links von/zu Euroclear Belgium, Euroclear Finland, Euroclear France, Euroclear Netherlands, Iberclear, Monte Titoli, OeKB und SIX SIS.
2. 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 ¹ , 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) zzgl. Bearbeitungsentgelt (pro Posten) zzgl. Fremdkosten ²	8,00 3,00
5.1.10 Abwicklungsentgelt bei Auslieferung Gold im Zusammenhang mit der Ausübung von Xetra-Gold ³	50,00
5.1.11 Zusätzliches Abwicklungsentgelt bei Auslieferung von LBMA-Standardbarren im Zusammenhang mit der Ausübung von Xetra-Gold ⁴	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[®] 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 ¹	25,00
5.2.5 Treuhänderservice (Entgelt p.a.) ²	
- 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 ¹	12,50
5.3.5	Zweitschrift Kundenabrechnung Kapitaldienste	25,00
5.3.6	Kauf- und Verkauf von Bezugsrechten ^{2 3}	0,1%
		Min. 26,50 Max 500
5.3.7	Instruktion einer Kapitalmaßnahme via SWIFT ^c	25,00
Stimmrechtsvertretung ⁴		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 ⁵		EUR
5.3.10	Bearbeitung von Wohnsitzbescheinigungen/Steuerzertifikaten und Steuererstattungsanträgen ⁶	35,00
5.3.11	Bearbeitung von Online-Wohnsitzbescheinigungen/-Steuerzertifikaten ⁷	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 ⁸	15,00
5.3.15	ProAct Tax Reclaim Service: Manuelle Bearbeitung ^h	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 und einem Maximim von EUR 500.
- 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 Annahmetermin 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

Dienstleistungen für Banken und Emittenten		EUR
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

Dienstleistungen für Banken		EUR
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 zzgl. Fremdkosten (Versicherungs- und Versandspesen; siehe Punkt 5.1.9)	50,00
5.4.7	Erstellung von Bestands- bzw. Emittententransaktionslisten auf Anforderung (pro Auszug)	5,00
5.4.8	Bestandsquery für Namensaktien (pro Datensatz - Min. EUR 5,00 bzw. Max. EUR 100,00 pro Query)	0,01

Dienstleistungen für Emittenten		EUR
5.4.9	Standardaufnahme neuer Emittenten in CASCADE-RS ¹	4.000,00
5.4.10	Kapitalmaßnahme in einer CASCADE-RS Gattung ^a	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 Kommunikation¹

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 Min. 60,00

6.4 CASCADE File-Transfer in ISO7775 zusätzlicher Pauschalbetrag²

Position	Zeitraum	pro Monat (EUR)
6.4.1	von 1. Dezember 2009 bis 31. Dezember 2010	25.000
6.4.2	von 1. Januar 2011	50.000

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 stellt.
2. Für die Anbindung entstehen zusätzliche Entgelte, die der Provider Deutsche Börse Systems (DBS) für CASCADE sowie die Datenfernübertragung in ISO7775 format in Rechnung stellt. Weitere Informationen erhalten Sie unter "[Anhang 4 - CASCADE File-Transfer: Migration von ISO7775 auf ISO15022 Standard](#)" auf Seite 37

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	1,50 % p.a.

1. Es wird ein Mindestentgelt für die automatische Leihe von Indexzertifikaten (ETFs) und ausländischen Aktien in Girosammelverwahrung in Höhe von EUR 30,00 berechnet.

8.2 Case by Case Borrowing and Lending Service (FCL)

Position		Aktien/Renten	Mindestentgelt (EUR)
8.2.1	Vergütung Verleiher	nach Vereinbarung ¹	20,00
8.2.2	Vergütung Clearstream Banking	1/3 der Entleihrate max 0,5% p.a.	10,00
8.2.3	Nutzungsentgelt Entleiher	nach Vereinbarung ^a	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) ¹	Aktien (Bp.)	Renten (Bp.)
8.3.2	Vergütung 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. > 20.000 Mio.	1,8 1,5	0,8 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
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 Collateral Swap

Position	Aktien	Renten
8.5.1 Vergütung Verleiher	nach Vereinbarung	nach Vereinbarung

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

Position	Aktien	Renten
8.5.3 Nutzungsentgelt Entleiher	nach Vereinbarung	nach Vereinbarung

9. Xemac®

9.1 Collateral Management¹

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

Allokationsvolumen (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 Allokationsvolumen (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^{1, 2}

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	Leitungsinstallation (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). ¹	5.000,00
10.2 Senden von Datensätzen (Preis pro Datensatz). ²	0,15
10.3 Empfangen von Datensätzen (Preis pro Datensatz). ³	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

Anhang 1 - Instrumentkategorisierung

WP-Gruppe/ 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	Rentenwerte und ähnliche Papiere, Kategorie 2
34	
35	
40	
41	
42	
43	
66	
67	
68	
102	
127	
132	
133	
134	
136	
137	
138	
139	
199	
200	
202	
	Rentenwerte und ähnliche Papiere, Kategorie 1

**WP-Gruppe/
Verwahrmöglichkeit**

1-1
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/ 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	
69	
70	
111	Optionsscheine
71	
72	
76	
77	
78	Bezugsrechte = keine Depotgebühren
79	
80	
88	
27	
28	Reichsmark-Werte = keine Depotgebühren

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 / Rentenbereich = Kurzläufer / Terminhandel = Kurse durch Maklerangaben / 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 ¹
181	Zero-Bonds	Zerobond-Formel ¹
182	Zero-Wandelanleihen	Zerobond-Formel ¹
183	Zero-Optionsanleihen cum Optionsschein	Zerobond-Formel ¹
184	Zero-Optionsanleihen ex Optionsschein	Zerobond-Formel ¹
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 ¹
239	Convertible Medium-Term Notes	Nennwert=100
240	Zero-Convertible Medium-Term Notes	Zerobond-Formel ¹
241	Exchangeable Medium-Term Notes	Nennwert=100
242	Zero-Exchangeable Medium-Term Notes	Zerobond-Formel ¹
243	Zero-Doppelwährung-Medium-Term Notes	Zerobond-Formel ¹
244	Inflationsindizierte Anleihen	Nennwert=100
245	Inflation Linked Medium-Term Notes	Nennwert=100
246	Zero Bond mit Tilgungsabhängigkeit	Zerobond-Formel ¹
247	Zero Medium-Term Notes mit Tilgungsabhängigkeit	Zerobond-Formel ¹
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/ Emissionspreis sonst "0"
522	Deutsche Spitzen-Konten/Aktien	Kurswert=Emittenten Ursprung/ Emissionspreis sonst "0"
523	Ausländische Spitzen-Konten/Aktien	Kurswert=Emittenten Ursprung/ 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) aktienähnlich	Kurswert=0 EUR
527	Units (aus verschiedenen Wertpapieren zusammengesetzte) rentenähnlich	Kurswert=0 EUR
528	Certificats d' Investissement représentatifs de droits pécuniaires (Loi 83-1 Art.20)	Kurswert=0 EUR
529	Wandelgenüßrechte/-scheine (gem. §10 Abs.5 KWG)	Kurswert=1
530	Wandelgenüßrechte/-scheine (sonstige)	Kurswert=1
531	Genüßrechte/-scheine (gem. §10 Abs.5 KWG)	Kurswert=1
532	Genüßrechte/-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 ¹
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: Alle Ausländischen bzw. Deutschen bis 70% Aktienanteil	Kurswert=Duchschnittskurs dt. Inv. 846979
814	Gemischte Fonds: 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- 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 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.

Anhang 4 - CASCADE File-Transfer: Migration von ISO7775 auf ISO15022 Standard

Zusatzpauschale für die Nutzung von File-Transfer ISO7775

Sollten Kunden die Umstellung nicht bis zum 1. Dezember 2009 umsetzen können, kann Clearstream Banking auf Anfrage das Format ISO7775 auch über dieses Datum hinaus weiter zur Verfügung stellen. Allerdings muss Clearstream Banking, aufgrund des entstehenden Mehraufwandes, den betroffenen Kunden zusätzlich einen Pauschalbetrag in Höhe von EUR 25.000 pro Monat, für den Zeitraum 1. Dezember 2009 bis 31. Dezember 2010 und ab 1. Januar 2011 in Höhe von EUR 50.000 pro Monat in Rechnung stellen. Dieser Pauschalbetrag wird dem Kunden nicht auf Kontenbasis, sondern auf Basis der gesellschaftsrechtlichen Entität berechnet.

Hintergrund

Im Rahmen der CASCADE File-Transfer Kommunikation werden bereits heute rund 95 % des anfallenden Nachrichtenvolumens im ISO15022 Format abgebildet. Clearstream Banking arbeitet kontinuierlich daran, die wenigen verbliebenen Nachrichtentypen im ISO7775 ebenfalls auf das aktuelle Format zu übertragen.

Die durch fachliche und regulatorische Anpassungen erforderlichen Entwicklungsaufwendungen für erweiterte oder neue Funktionalitäten wurden bisher und werden auch in Zukunft nur für das aktuelle ISO15022 Format umgesetzt. Ein Parallelbetrieb von ISO7775 kann aufgrund der Fokussierung auf den aktuellen Standard nur für eine Übergangszeit möglich sein.

Leerseite

Kontakt

marketing@clearstream.com
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

Mai 2009

Dokument-Nummer: F-CI02
