

6. Oktober 2010

[Kunde]

[Datum]

Indexswap mit Price Return und [Barausgleich] [Lieferung] [Wahlrecht] Ref.-Nr. [ ]

Sehr geehrte Damen und Herren,

wir bestätigen Ihnen folgenden, auf der Grundlage unseres Rahmenvertrages für Finanztermingeschäfte und des diesen ergänzenden Anhangs für Wertpapierderivate („Anhang“) getätigten Einzelabschluss:

**Allgemeine Regelungen:**

Rahmenvertragsdatum: [ ]

Abschlussdatum:<sup>1</sup> [ ]

Anfangsdatum: [ ] [vorbehaltlich einer Anpassung entsprechend Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages] [ohne Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 des Rahmenvertrages]<sup>2</sup>

Enddatum: [ ] [vorbehaltlich einer Anpassung entsprechend Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages] [ohne Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 des Rahmenvertrages]<sup>3</sup>

Wertpapierindex: [DAX] [DJ Euro Stoxx 50]  
[(WKN [ ])] [(ISIN [ ])]  
[(Bloomberg Ticker [ ])] [(Reuters [ ])]

[Indexsponsor]:<sup>4</sup> [ [ ] ]

Gesamtausgleich („Total Return“): nicht vereinbart<sup>5</sup>

---

<sup>1</sup> Wenn die Geschäftsbestätigung auch dazu genutzt werden soll, dem Vertragspartner die wesentlichen Informationen über die Ausführung des Geschäfts zu übermitteln (§ 31 Abs. 8 WpHG i.V.m. § 8 WpDVerO) wäre in den Fällen, in denen der Vertragspartner ein Privatkunde ist, neben dem Abschlussdatum auch der Abschlusszeitpunkt aufzunehmen.

<sup>2</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages („modifiziert folgend“) erfolgen soll.

<sup>3</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages („modifiziert folgend“) erfolgen soll.

<sup>4</sup> Nur erforderlich, wenn eine andere als die in Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Indexsponsor“ bestimmte Einrichtung vereinbart wird.

<sup>5</sup> Dividenden, die ggf. über die Zahlung von Ausschüttungsbeträgen ausgeglichen werden könnten, fallen bei Wertpapierindizes nicht an.

|  |   |
|--|---|
| Vertragswahrung:                          | [ ]   |
| [Preisfeststellungstag:] <sup>6</sup>      | [ [ ] ]   |
| [Wahrungskurs:] <sup>7</sup>              | [ [ ] ]   |
| [Wertpapierborse:] <sup>8</sup>           | [ [Die nach den Bestimmungen des Konzept fur die Indexwerte mageblichen organisierten Markte oder Handelssysteme] [Frankfurter Wertpapierborse] [XETRA-Handelssystem der Deutsche Borse AG] [ ] ]  |
| [Terminborse:] <sup>9</sup>               | [Eurex] [Euronext] [LIFFE] [MEFF] [IDEM] [ ]  |
| Bankarbeitstag:                            | [Finanzplatz [ ] ]<br>[TARGET-Tag<br>„TARGET-Tag“ ist jeder Tag, an dem TARGET2 (das Transeuropaische Automatisierte Echtzeit-Brutto-Express-Zahlungsverkehrssystem der EZB) fur die Abwicklung von Zahlungen in Euro geoffnet ist.] <sup>10</sup> |
| Berechnungsstelle:                         | [Bank] [Vertragspartner] [, aber fur Zwecke der Berechnung des Geldbetrages im Falle einer vorzeitigen Beendigung mit Barausgleich: [Bank] [Vertragspartner] [beide Parteien] <sup>11</sup> ]  |
| Mehrfachborsen: <sup>12</sup>             | [Vereinbart] [Nicht vereinbart]   |
| Terminborsenstandard: <sup>13</sup>       | [Vereinbart] [Nicht vereinbart]   |
| [Borsenvergleichskontrakt:] <sup>14</sup> | [ [ ] ]<br>[(WKN [ ]) ] [(ISIN [ ]) ]   |
| <b>Regelungen betreffend Abwicklung:</b>   |   |
| Art der Abwicklung:                        | [Barausgleich] [Lieferung] [Wahlrecht]  |
| Zahler der Ausgleichsbetrage:             | [ [ ] ] <sup>15</sup>   |

<sup>6</sup> Nur erforderlich, wenn der Anfangspreis, Knock-in-Schwellenwert oder Knock-out-Schwellenwert nicht vereinbart wird, sondern nach Nr. 3 Abs. 6 des Anhangs von der Berechnungsstelle ermittelt werden soll.

<sup>7</sup> Nur erforderlich, wenn der Referenzpreis in einer anderen Wahrung als der Vertragswahrung ausgedruckt ist und die Umrechnung nicht auf Grundlage der von der EZB veroffentlichten EUR-Referenzkurse erfolgen soll (Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Wahrungskurs“ und Nr. 3 Abs. 2 Satz 1 des Anhangs).

<sup>8</sup> Nur erforderlich, wenn die Wertpapierborse nicht von der Berechnungsstelle bestimmt werden soll (Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Berechnungsstelle“).

<sup>9</sup> Nur erforderlich, wenn Terminborse nicht diejenige Derivateborse sein soll, an der Futures und Optionen auf den Wertpapierindex gehandelt werden (Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Terminborse“).

<sup>10</sup> Nur erforderlich, wenn „TARGET-Tag“ oder „Euro-Zahlung“ vereinbart wird.

<sup>11</sup> Nur erforderlich, wenn fur den Fall „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ (Nr. 22 des Anhangs) eine andere Partei oder Stelle die Berechnung vornehmen soll.

<sup>12</sup> Mit der Vereinbarung von „Mehrfachborsen“, machen die Parteien von Nr. 5 Abs. 3 des Anhangs Gebrauch. Angepasst werden die Definitionen von „Borsengeschaftstag“, „regularer Handelstag“ und „Wertermittlungszeitpunkt“. Daruber hinaus werden die bei Marktstorungen zur Anwendung kommenden Regelungen modifiziert. Die Regelung ist sinnvoll, wenn fur die Indexwerte unterschiedliche Wertpapierborsen mageblich sind.

<sup>13</sup> Mit der Vereinbarung von „Terminborsenstandard“, machen die Parteien von Nr. 5 Abs. 4 des Anhangs Gebrauch. Die Vereinbarung hat zur Folge, dass fur die Ermittlung des Endpreises bzw. Referenzpreises der Borsenabrechnungspreis mageblich wird. Daruber hinaus werden samtliche von der Terminborse vorgenommenen Anpassungen des Borsenvergleichskontrakts auf den Einzelabschluss ubertragen.

<sup>14</sup> Nur erforderlich, wenn von Nr. 5 Abs. 4 Buchstabe (d) des Anhangs, Definition von „Borsenvergleichskontrakt“ abgewichen wird.

|   |  |
|---|--|
|   | [ [ ], falls der für den betreffenden Wertermittlungstag ermittelte Ausgleichsbetrag positiv ist und [ ] falls der für den betreffenden Wertermittlungstag ermittelte Ausgleichsbetrag negativ ist.] <sup>16</sup><br>[Hat die wahlberechtigte Partei „Lieferung“ gewählt oder gilt „Lieferung“ als vereinbart [ ] und hat die wahlberechtigte Partei „Barausgleich“ vereinbart oder gilt „Barausgleich“ als vereinbart [ ], falls der für den betreffenden Wertermittlungstag ermittelte Ausgleichsbetrag positiv ist und [ ] falls der für den betreffenden Wertermittlungstag ermittelte Ausgleichsbetrag negativ ist.] <sup>17</sup> |
| [Währung der Ausgleichsbeträge:] <sup>18</sup>      | [ [ ] ]  |
| Bezugsbetrag für den Ausgleichsbetrag:              | [ [ ] ]  |
| [Multiplikator:] <sup>19</sup>                      | [ [ ] ]  |
| Anpassung des Bezugsbetrages:                       | [Vereinbart] [Nicht vereinbart]  |
| [Wahlberechtigte Partei:] <sup>20</sup>             | [ [ ] ]  |
| [Erklärungstag:] <sup>21</sup>                      | [ [ ] ]  |
| [Ersatzabwicklung:] <sup>22</sup>                   | [Lieferung]  |
| [Fälligkeitstage für die Abwicklung:] <sup>23</sup> | [Jeweils der [ ] vom [ ] (einschließlich) bis zum [ ] (einschließlich) [, vorbehaltlich einer Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages] [, ohne Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 des Rahmenvertrages <sup>24</sup> ].]<br>[Jeweils der [ [zweite] [ ] Bankarbeitstag] [ [zweite] [ ] Abwicklungsgeschäftstag] [letzte Tag eines Abwicklungszyklusses] nach einem Wertermittlungstag] <sup>25</sup>   |
| [Abwicklungssystem:] <sup>26</sup>                  | [ [Clearstream Banking AG, Frankfurt] [ ] ]  |

<sup>15</sup> Anwendbar, wenn „Lieferung“ vereinbart wird.

<sup>16</sup> Anwendbar, wenn „Barausgleich“ vereinbart wird.

<sup>17</sup> Anwendbar, wenn „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>18</sup> Nur erforderlich, wenn „Wahlrecht“ oder „Barausgleich“ vereinbart wird und wenn die Währung der Ausgleichsbeträge von der Vertragswährung abweicht.

<sup>19</sup> Nur erforderlich, wenn ein anderer als der in Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Multiplikator“ bestimmte Faktor „Eins“ vereinbart wird.

<sup>20</sup> Nur erforderlich, wenn „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>21</sup> Nur erforderlich, wenn „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>22</sup> Nur erforderlich, wenn „Wahlrecht“ vereinbart wird und nicht „Barausgleich“ (Nr. 4 Abs. 6 des Anhangs) gelten soll.

<sup>23</sup> Nur erforderlich, wenn der Fälligkeitstage für die Abwicklung nicht nach Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Fälligkeitstag für die Abwicklung“ in Abhängigkeit von den Wertermittlungstagen bestimmt werden sollen.

<sup>24</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages erfolgen soll.

<sup>25</sup> Anwendbar, wenn die Abhängigkeit der Fälligkeitstage für die Abwicklung von den vereinbarten Wertermittlungstagen von Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Fälligkeitstag für die Abwicklung“ abweichen soll.

<sup>26</sup> Nur erforderlich, wenn ein anderes als das in Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Abwicklungssystem“ bestimmte Abwicklungssystem (das „führende nationale Abwicklungssystem“) vereinbart wird. Das Abwicklungssystem ist primär von Bedeutung, wenn „Lieferung“ oder „Wahlrecht“ vereinbart wird. In diesem Fall sind die Indexwerte über das Abwicklungssystem zu liefern (Nr. 4 Abs. 1 des Anhangs) und bestimmt sich das Vorliegen einer Abwicklungsstörung (Nr. 12 Abs. 1 des Anhangs) danach, ob die Lieferung im Abwicklungssystem unmöglich geworden ist. Darüber hinaus hat das Abwicklungssystem jedoch auch Bedeutung für die Bestimmung des „Abwicklungsgeschäftstages“ und des „Abwicklungszyklusses“ bzw. für die nachträgliche Korrektur von Kursen, Indexständen oder Preisen (Nr. 23 des An-

|  |   |
|--|---|
| [Abwicklungszyklus:] <sup>27</sup>                               | [ [Zwei Abwicklungsgeschäftstage] [ ] ]   |
| [Abwicklungsstörung:] <sup>28</sup>                              | [ [Verschiebung] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich <sup>29</sup> ] ]  |
| <b>[Regelungen betreffend Ausgleichsbeträge:]<sup>30</sup></b>   |   |
| [Anfangspreis:] <sup>31</sup>                                    | [ [ ] [Wie von der Berechnungsstelle am Preisfeststellungstag ermittelt] ]  |
| [Geldbetrag je Indexpunkt:] <sup>32</sup>                        | [ [ ] ]   |
| <b>[Regelungen betreffend Wertermittlung:]<sup>33</sup></b>      |   |
| [Wertermittlungstage:] <sup>34</sup>                             | [Jeweils der [ ] vom [ ] (einschließlich) bis zum [ ] (einschließlich) [, vorbehaltlich einer Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages] [, ohne Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 des Rahmenvertrages <sup>35</sup> .] |
| [Durchschnittskursermittlungstage:]                              | [ [ [ ], [ ], [ ] und [ ]. ]<br>[Jeder der [ ] <sup>36</sup> dem [ ] [Anfangsdatum] [jeweiligen Wertermittlungstag] unmittelbar vorausgehenden regulären Handelstage.] ]  |
| [Wertermittlungszeitpunkt:] <sup>37</sup>                        | [ [ ] Uhr (Ortszeit in [ ]) ]   |
| [Marktstörungen:] <sup>38</sup>                                  | [Ersatzwertpapierbörse <sup>39</sup> ] [Modifizierte Verschiebung] [Nichtberücksichtigung]  |
| [Ersatzwertpapierbörse:] <sup>40</sup>                           | [ [ ] ]   |
| <b>[Regelungen betreffend Knock-in / Knock-out]<sup>41</sup></b> |   |
| [Knock-in-Ereignis:] <sup>42</sup>                               | [ [ ] ]   |

hangs). Es kann daher Sinn machen, das Abwicklungssystem auch dann zu vereinbaren, wenn „Barausgleich“ vereinbart wird.

<sup>27</sup> Nur erforderlich, wenn eine andere als die in Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Abwicklungszyklus“ bestimmte Anzahl von Tagen (die sich nach den für die Wertpapierbörse maßgeblichen Regeln bestimmt) vereinbart wird.

<sup>28</sup> Nur erforderlich, wenn „Lieferung“ oder „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>29</sup> Diese Regelung ist den 2002 ISDA Equity Derivatives Definitions unbekannt.

<sup>30</sup> Nur erforderlich, wenn für die Abwicklung „Barausgleich“ oder „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>31</sup> Nur erforderlich, wenn für die Abwicklung „Barausgleich“ oder „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>32</sup> Nur erforderlich, wenn für die Abwicklung „Barausgleich“ oder „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>33</sup> Nur erforderlich, wenn Durchschnittskursermittlungstage oder abweichende Wertermittlungstage oder ein abweichender Wertermittlungszeitpunkt oder eine abweichende Marktstörungsregelung vereinbart werden.

<sup>34</sup> Nur erforderlich, wenn andere als die in Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Wertermittlungstag“ bestimmten Tage („ein Abwicklungszyklus vor dem Fälligkeitstag für die Abwicklung“) vereinbart werden.

<sup>35</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages erfolgen soll.

<sup>36</sup> Bitte die Anzahl angeben.

<sup>37</sup> Nur erforderlich, wenn ein anderer als der in Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Wertermittlungszeitpunkt“ bestimmte Zeitpunkt (regulärer Handelsschluss an der Wertpapierbörse) oder, falls „Mehrfachbörsen“ vereinbart wird, ein anderer als der in Nr. 5 Abs. 3 Buchstabe (a) des Anhangs bestimmte Zeitpunkt vereinbart wird.

<sup>38</sup> Nur erforderlich, wenn nicht die Ersatzregelung „Verschiebung“ vereinbart wird (Nr. 11 Abs. 3 des Anhangs).

<sup>39</sup> Diese Regelung ist den 2002 ISDA Equity Derivatives Definitions unbekannt.

<sup>40</sup> Nur erforderlich, wenn für den Fall der Marktstörung vereinbart wird, dass die Referenzkurse einer Ersatzwertpapierbörse herangezogen werden sollen.

<sup>41</sup> Nur erforderlich, wenn ein Knock-in- oder ein Knock-out-Ereignis vereinbart wird.

<sup>42</sup> Nur erforderlich, wenn als Knock-in-Ereignis ein anderes Ereignis als das Erreichen oder Durchbrechen eines Schwellenwertes vereinbart wird.

|   |  |
|---|--|
| [Knock-in-Schwellenwert:]                         | [ [ ] [Wie von der Berechnungsstelle am Preisfeststellungstag ermittelt] ]   |
| [Folge des Eintritts des Knock-in-Ereignisses:]   | [ [Der Anspruch auf Zahlung des Ausgleichsbetrages entsteht.] [Der Anspruch auf Lieferung der Indexwerte entsteht.] [Die Änderung wird wirksam.] ]   |
| [Änderung:] <sup>43</sup>                         | [ [ ] ]  |
| [Knock-out-Ereignis:] <sup>44</sup>               | [ [ ] ]  |
| [Knock-out-Schwellenwert:]                        | [ [ ] [Wie von der Berechnungsstelle am Preisfeststellungstag ermittelt] ]   |
| [Folge des Eintritts des Knock-out-Ereignisses:]  | [Der Anspruch auf Zahlung des Ausgleichsbetrages erlischt.] [Der Anspruch auf Lieferung der Indexwerte erlischt.]  |
| [Referenzwertermittlungszeitraum:] <sup>45</sup>  | [Vom [ ] (einschließlich) bis zum [ ] (einschließlich)]  |
| [Referenzwertermittlungstag:]                     | [ [ ] ]  |
| [Referenzwertermittlungszeitpunkt:] <sup>46</sup> | [ [ ] ]  |
| <b>Regelungen betreffend variable Beträge:</b>    |  |
| Zahler der variablen Beträge:                     | [ [ ] ], falls der für den betreffenden Berechnungszeitraum ermittelte variable Satz positiv ist und [ [ ] ], falls der für den betreffenden Berechnungszeitraum ermittelte variable Satz negativ ist.] [keine der Parteien, falls der für den betreffenden Berechnungszeitraum ermittelte variable Satz negativ oder null ist.] |
| Bezugsbetrag:                                     | [Der auf den betreffenden Berechnungszeitraum jeweils anwendbare Bezugsbetrag für den Ausgleichsbetrag] [ [ ] ]  |

<sup>43</sup> Falls mit Eintritt der aufschiebenden Bedingung (Knock-in) eine Änderung des Einzelabschlusses gelten soll, wäre hier der Text der Änderung (z.B. „Anfangspreis ist [ [ ] ]“ oder „Für die Ausübung gilt Wahlrecht“) aufzunehmen.

<sup>44</sup> Nur erforderlich, wenn als Knock-out-Ereignis ein anderes Ereignis als das Erreichen oder Durchbrechen eines Schwellenwertes vereinbart wird.

<sup>45</sup> Nur erforderlich, wenn ein von Nr. 10 Abs. 4 des Anhangs abweichender Zeitraum vereinbart wird.

<sup>46</sup> Nur erforderlich, wenn ein anderer als der in Nr. 10 Abs. 4 des Anhangs bestimmte Zeitpunkt (der Wertermittlungszeitpunkt) vereinbart wird.

|  |  |
|--|--|
| [Währung der variablen Beträge:] <sup>47</sup>                       | [[ ]]  |
| Variabler Satz:  | Die Summe aus (i) Basis-Satz und (ii) Spread   |
| Spread:  | [minus] [ ]% p. a.   |
| Basis-Satz:  | [[ ]-Monats-[ ]][ [ ]-Monats-EURIBOR]  |
| Bestimmung des Basis-Satzes:   | [[ ]-Monats-[ ]][ [ ]-Monats-EURIBOR ist der Satz für [ ]-Monatsgelder in Euro gemäß Bildschirm-Veröffentlichung durch Reuters Services auf der Seite „EURIBOR01“ für den Zeitpunkt 11.00 Uhr in Brüssel am zweiten TARGET-Tag vor dem Beginn des jeweiligen Berechnungszeitraums („Feststellungstag“).] |
| [Variabler Satz für den ersten Berechnungszeitraum:]                 | [[ ]% p. a.]   |
| [Variabler Betrag für den ersten Berechnungszeitraum:] <sup>48</sup> | [[ ]]  |
| Rundungen:   | Der Basis-Satz ist gegebenenfalls kaufmännisch auf den nächsten [1/1.000] [1/10.000] [1/100.000] Prozentpunkt auf- oder abzurunden.  |
| Fälligkeitstage für variable Beträge:                                | [Jeweils der [ ] vom [ ] (einschließlich) bis zum [ ] (einschließlich) [, vorbehaltlich einer Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages] [, ohne Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 des Rahmenvertrages <sup>49</sup> ].]<br>[Jeder Fälligkeitstag für Ausgleichsbeträge]                     |
| Quotient:  | [ ] <sup>50</sup>  |
| [Berechnungszeitraum für variable Beträge:] <sup>51</sup>            | [Fälligkeitstag/Fälligkeitstag]  |
| <b>[Regelungen betreffend Anfangs- und Endbeträge:]</b>              |  |
| [Zahler des Anfangsbetrages:]  | [[ ]]  |
| [Anfangsbetrag:]   | [[ ]]  |
| [Fälligkeitstag für den Anfangsbetrag:]                              | [[ ]] [, vorbehaltlich einer Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages] [ohne Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 des Rahmenvertrages <sup>52</sup> ]. ]   |

<sup>47</sup> Nur erforderlich, wenn die Währung der variablen Beträge von der Vertragswährung abweicht.

<sup>48</sup> Nur erforderlich, wenn die Fälligkeitstage nicht angepasst werden sollen.

<sup>49</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages erfolgen soll.

<sup>50</sup> Sofern der vereinbarte Quotient nicht in Nr. 6 Abs. 5 des Rahmenvertrages oder in einer von den Parteien gegebenenfalls abgeschlossenen Zusatzvereinbarung zum Rahmenvertrag (2002 Bank-Verlag Köln, Vordruck 44.022 (04/02)) enthalten ist, wäre hier zusätzlich zur Kurzbezeichnung (z.B. "30/360") die Definition des Quotienten aufzunehmen.

<sup>51</sup> Nur erforderlich, wenn abweichend von Nr. 6 Abs. 6 Satz 1 des Rahmenvertrages „Fälligkeitstag/Fälligkeitstag“ vereinbart wird.

<sup>52</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages („modifiziert folgend“) erfolgen soll.

|                                     |  |
|-------------------------------------|--|
| [Zahler des Endbetrages:]           | [ [ ] ]  |
| [Endbetrag:]                        | [ [ ] ]  |
| [Fälligkeitstag für den Endbetrag:] | [ [ ] ], vorbehaltlich einer Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 [(a)] [(b)] des Rahmenvertrages] [ohne Anpassung nach Nr. 3 Abs. 5 des Rahmenvertrages <sup>53</sup> ]. ] |

**Besondere Ereignisse:**

|  |  |
|--|--|
| [Indexstörungen:] <sup>54</sup>                    | [(a) Veränderung des Indexes:<br>[Neuberechnung durch Berechnungsstelle] [Verhandlung] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich]<br>(b) Beendigung des Indexes:<br>[Neuberechnung durch Berechnungsstelle] [Verhandlung] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich]<br>(c) Störung des Indexes:<br>[Neuberechnung durch Berechnungsstelle] [Verhandlung] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich] ] |
| [Illiquider Markt:] <sup>55</sup>                  | [Vereinbart]   |
| [Änderung der Rechtslage:] <sup>56</sup>           | [Vereinbart]   |
| [Insolvenzantrag:] <sup>57</sup>                   | [Vereinbart]   |
| [Gescheiterte Absicherung:]                        | [Vereinbart]   |
| [Verteuerung der Absicherung:]                     | [Vereinbart]   |
| [Gescheitertes Wertpapierdarlehen:]                | [Vereinbart]   |
| [Verteuerung von Wertpapierdarlehen:]              | [Vereinbart]   |
| [Absichernde Partei:] <sup>58</sup>                | [ [ ] ]  |
| [Maximales Darlehensentgelt:] <sup>59</sup>        | [ [ ] ]  |
| [Anfängliches Darlehensentgelt:] <sup>60</sup>     | [ [ ] ]  |
| Anpassungen nach Nr. 3 Abs. 5 des Rahmenvertrages: | Soweit vorstehend keine abweichende Vereinbarung getroffen wird, erfolgen Anpassungen nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages („modifiziert folgend“).   |

<sup>53</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages („modifiziert folgend“) erfolgen soll.

<sup>54</sup> Nur erforderlich, wenn andere als die in Nr. 14 Abs. 3 des Anhangs vorgesehenen Ersatzregelungen („Neuberechnung durch Berechnungsstelle“ im Falle von „Störung des Indexes“ und „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ in allen übrigen Fällen) vereinbart werden.

<sup>55</sup> Nur erforderlich, wenn „Lieferung“ oder „Wahlrecht“ vereinbart wird und die Regelung „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ nach Nr. 13 Abs. 2 des Anhangs zur Anwendung kommen soll.

<sup>56</sup> Nur erforderlich, wenn die Regelung „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ nach Nr. 18 Abs. 3 des Anhangs zur Anwendung kommen soll.

<sup>57</sup> Nur erforderlich, wenn die Regelung „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ nach Nr. 18 Abs. 3 des Anhangs zur Anwendung kommen soll.

<sup>58</sup> Nur erforderlich, wenn für eine der Absicherungsstörungen die in Nr. 19 Abs. 2 des Anhangs vorgesehene Regelung gewählt wird.

<sup>59</sup> Nur erforderlich, wenn „gescheitertes Wertpapierdarlehens“ vereinbart wird.

<sup>60</sup> Nur erforderlich, wenn „Verteuerung von Wertpapierdarlehen“ vereinbart wird.

Benachrichtigungen: [ ]

An die Bank: [ ]

An den Vertragspartner: [ ]

Ihr Konto: [ ]

Unser Konto: [ ]

[Makler:] [[ ]]

[Index Disclaimer:] Beiden Parteien ist bekannt, dass dieser Einzelabschluss von dem Indexsponsor nicht gefördert, unterstützt, verkauft oder zum Verkauf empfohlen wird und der Indexsponsor keinerlei Aussagen oder irgendwelche direkten oder indirekten Zusicherungen in Bezug auf Ergebnisse abgibt, welche durch die Verwendung des Indexes oder des Indexstandes zu irgendeinem bestimmten Zeitpunkt erzielt werden können. Der Indexsponsor übernimmt gegenüber niemandem die Haftung (weder für Fahrlässigkeit noch in sonstiger Weise) für Fehler des Indexes und der Indexsponsor ist nicht verpflichtet, auf solche Fehler hinzuweisen. Der Indexsponsor macht keinerlei direkte oder indirekte Aussagen in Bezug auf die Zweckmäßigkeit, ein Risiko hinsichtlich dieses Einzelabschlusses zu übernehmen oder einzugehen. Keine der Parteien übernimmt gegenüber der anderen Partei eine Haftung für eine Handlung oder ein Versäumnis des Indexsponsors in Verbindung mit der Berechnung, Anpassung oder Erhaltung des Indexes. Außer im Falle der Offenlegung vor dem Abschlussdatum, sichern die Parteien zu, dass sie oder deren Beteiligungsgesellschaften weder eine Beteiligung an oder Kontrolle über den Index oder den Indexsponsor noch eine Kontrolle über die Berechnung, Zusammenstellung oder Verbreitung des Indexes haben. Obgleich die Berechnungsstelle Informationen über den Index aufgrund von öffentlich zugänglichen Quellen, die sie als verlässlich ansieht, erhält, wird sie diese Information nicht selbstständig überprüfen. Demnach werden keinerlei direkten oder indirekten Aussagen gemacht, Zusicherungen abgegeben oder Verpflichtungen übernommen und keine der Parteien, deren Beteiligungsgesellschaften oder die Berechnungsstelle übernehmen die Verantwortung für die Richtigkeit, Vollständigkeit und Aktualität von Informationen über den Index.

Besondere Vereinbarungen: [Keine] [ ]



Diese Bestätigung erhalten Sie als Telefax [und in Briefform<sup>61</sup>]. Falls Sie bei deren Prüfung Abweichungen von den vereinbarten Bestimmungen des Einzelabschlusses feststellen, bitten wir Sie, uns unverzüglich zu benachrichtigen.

Die Richtigkeit der vorstehenden Angaben erklären Sie bitte durch Gegenzeichnung und Rücksendung dieser Bestätigung.

Mit freundlichen Grüßen  
[Bank]

\_\_\_\_\_  
[Unterschrift]

\_\_\_\_\_  
[Unterschrift]

Gegenbestätigt:  
[Vertragspartner]

\_\_\_\_\_  
[Ort, Datum]

\_\_\_\_\_  
[Unterschrift]

\_\_\_\_\_  
[Unterschrift]

<sup>61</sup> Nur erforderlich, wenn die andere Partei nach Nr. 2 Abs. 2 des Rahmenvertrages eine unterzeichnete Ausfertigung des Einzelabschlusses verlangt.