

6. Oktober 2010

[Kunde]

[Datum]

Wertpapierswap mit [Total Return] [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>

Wertpapier: [Stammaktie] [Vorzugsaktie] [ ] des Emittenten [(WKN [ ])] [(ISIN [ ])]

Emittent: [ ]

Anzahl der Wertpapiere: [ ]

Gesamtausgleich („Total Return“): [Vereinbart] [Nicht vereinbart]

Vertragswährung: [ ]

<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.

[Kurs:] <sup>4</sup>	[ [Geldkurs] [Briefkurs] [Mittelkurs] [fortlaufend notierter Kurs] [letzter quotierter Kurs] [letzter gehandelter Kurs] [Schlusskurs] [Schlussauktionskurs] [Intraday-Auktionskurs] [ ] ]
[Preisfeststellungstag:] <sup>5</sup>	[ [ ] ]
[Währungskurs:] <sup>6</sup>	[ [ ] ]
[Wertpapierbörse:] <sup>7</sup>	[ [Frankfurter Wertpapierbörse] [XETRA-Handelssystem der Deutsche Börse AG] [ ] ]
[Terminbörse:] <sup>8</sup>	[Eurex] [Euronext] [LIFFE] [MEFF] [IDEM] [ ]
Bankarbeitstag:	[Finanzplatz [ ] ] [TARGET-Tag „TARGET-Tag“ ist jeder Tag, an dem TARGET2 (das Transeuropäische Automatisierte Echtzeit-Brutto-Express-Zahlungsverkehrssystem der EZB) für die Abwicklung von Zahlungen in Euro geöffnet ist.] <sup>9</sup>
Berechnungsstelle:	[Bank] [Vertragspartner] [, aber für Zwecke der Berechnung des Geldbetrages im Falle einer vorzeitigen Beendigung mit Barausgleich: [Bank] [Vertragspartner] [beide Parteien] <sup>10</sup> ]

### **Regelungen betreffend Abwicklung:**

Art der Abwicklung:	[Barausgleich] [Lieferung] [Wahlrecht]
Zahler der Ausgleichsbeträge:	[ [ ] ] <sup>11</sup> [ [ ] ], falls der für den betreffenden Wertermittlungstag ermittelte Ausgleichsbetrag positiv ist und [ ] falls der für den betreffenden Wertermittlungstag ermittelte Ausgleichsbetrag negativ ist.] <sup>12</sup> [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>13</sup>

<sup>4</sup> Nur erforderlich, wenn für die Abwicklung „Barausgleich“ oder „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>5</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>6</sup> Nur erforderlich, wenn der Referenzpreis in einer anderen Währung als der Vertragswährung ausgedrückt ist und die Umrechnung nicht auf Grundlage der von der EZB veröffentlichten EUR-Referenzkurse erfolgen soll (Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Währungskurs“ und Nr. 3 Abs. 2 Satz 1 des Anhangs).

<sup>7</sup> Nur erforderlich, wenn die Wertpapierbörse nicht von der Berechnungsstelle bestimmt werden soll (Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Berechnungsstelle“).

<sup>8</sup> Nur erforderlich, wenn Terminbörse nicht diejenige Derivatebörse sein soll, an der Futures und Optionen auf das Wertpapier gehandelt werden (Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Terminbörse“).

<sup>9</sup> Nur erforderlich, wenn „TARGET-Tag“ oder „Euro-Zahlung“ vereinbart wird.

<sup>10</sup> Nur erforderlich, wenn für den Fall „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ (Nr. 22 des Anhangs) eine andere Partei oder Stelle die Berechnung vornehmen soll.

<sup>11</sup> Anwendbar, wenn „Lieferung“ vereinbart wird.

[Währung der Ausgleichsbeträge:] <sup>14</sup>	[ [ ] ]
Bezugsbetrag für den Ausgleichsbetrag:	[ ]
Anpassung des Bezugsbetrages:	[Vereinbart] [Nicht vereinbart]
[Wiederanlage von Ausschüttungsbeiträgen:] <sup>15</sup>	[ [Vereinbart] [Nicht vereinbart] ]
[Wahlberechtigte Partei:] <sup>16</sup>	[ [ ] ]
[Erklärungstag:] <sup>17</sup>	[ [ ] ]
[Ersatzabwicklung:] <sup>18</sup>	[Lieferung]
[Fälligkeitstage für die Abwicklung:] <sup>19</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>20</sup> .] [Jeweils der [ [zweite] [ ] Bankarbeitstag] [ [zweite] [ ] Abwicklungsgeschäftstag] [letzte Tag eines Abwicklungszyklusses] nach einem Wertermittlungstag] <sup>21</sup>
[Abwicklungssystem:] <sup>22</sup>	[ [Clearstream Banking AG, Frankfurt] [ ] ]
[Abwicklungszyklus:] <sup>23</sup>	[ [Zwei Abwicklungsgeschäftstage] [ ] ]
[Abwicklungsstörung:] <sup>24</sup>	[ [Verschiebung] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich <sup>25</sup> ] ]
<b>[Regelungen betreffend Ausgleichsbeträge:]<sup>26</sup></b>	
[Anfangspreis:] <sup>27</sup>	[ [ ] [Wie von der Berechnungsstelle am Preisfeststellungstag ermittelt] ]

<sup>12</sup> Anwendbar, wenn „Barausgleich“ vereinbart wird.

<sup>13</sup> Anwendbar, wenn „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>14</sup> Nur erforderlich, wenn „Wahlrecht“ oder „Barausgleich“ vereinbart wird und wenn die Währung der Ausgleichsbeträge von der Vertragswährung abweicht.

<sup>15</sup> Nur anwendbar, wenn auch „Gesamtausgleich“ vereinbart wird.

<sup>16</sup> Nur erforderlich, wenn „Wahlrecht“ vereinbart wird.

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

<sup>18</sup> Nur erforderlich, wenn „Wahlrecht“ vereinbart wird und nicht „Barausgleich“ (Nr. 4 Abs. 6 des Anhangs) gelten soll.

<sup>19</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>20</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages erfolgen soll.

<sup>21</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>22</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 Wertpapiere 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 oder Preisen (Nr. 23 des Anhangs). Es kann daher Sinn machen, das Abwicklungssystem auch dann zu vereinbaren, wenn „Barausgleich“ vereinbart wird.

<sup>23</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>24</sup> Nur erforderlich, wenn „Lieferung“ oder „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>25</sup> Diese Regelung ist den 2002 ISDA Equity Derivatives Definitions unbekannt.

<sup>26</sup> Nur erforderlich, wenn für die Abwicklung „Barausgleich“ oder „Wahlrecht“ vereinbart wird.

[Multiplikator:] <sup>28</sup>	[ [ ] ]
<b>[Regelungen betreffend Wertermittlung:]<sup>29</sup></b>	
[Wertermittlungstage:] <sup>30</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>31</sup> .]
[Durchschnittskursermittlungstage:]	[ [ [ ], [ ], [ ] und [ ]. ] [Jeder der [ ] <sup>32</sup> dem [ ] [Anfangsdatum] [jeweiligen Wertermittlungstag] unmittelbar vorausgehenden regulären Handelstage. ] ]
[Wertermittlungszeitpunkt:] <sup>33</sup>	[ [ ] Uhr (Ortszeit in [ ]) ]
[Marktstörungen:] <sup>34</sup>	[Ersatzwertpapierbörse <sup>35</sup> ] [Modifizierte Verschiebung] [Nichtberücksichtigung]
[Ersatzwertpapierbörse:] <sup>36</sup>	[ [ ] ]
<b>[Regelungen betreffend Knock-in / Knock-out]<sup>37</sup></b>	
[Knock-in-Ereignis:] <sup>38</sup>	[ [ ] ]
[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 Wertpapiere entsteht.] [Die Änderung wird wirksam. ] ]
[Änderung:] <sup>39</sup>	[ [ ] ]
[Knock-out-Ereignis:] <sup>40</sup>	[ [ ] ]

<sup>27</sup> Nur erforderlich, wenn für die Abwicklung „Barausgleich“ oder „Wahlrecht“ vereinbart wird.

<sup>28</sup> Nur erforderlich, wenn für die Abwicklung „Barausgleich“ oder „Wahlrecht“ und wenn ein anderer als der in Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Multiplikator“ bestimmte Faktor „Eins“ vereinbart wird.

<sup>29</sup> Nur erforderlich, wenn Durchschnittskursermittlungstage oder abweichende Wertermittlungstage oder ein abweichender Wertermittlungszeitpunkt oder eine abweichende Marktstörungenregelung vereinbart werden.

<sup>30</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>31</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages erfolgen soll.

<sup>32</sup> Bitte die Anzahl angeben.

<sup>33</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) vereinbart wird.

<sup>34</sup> Nur erforderlich, wenn nicht die Ersatzregelung „Verschiebung“ vereinbart wird (Nr. 11 Abs. 3 des Anhangs).

<sup>35</sup> Diese Regelung ist den 2002 ISDA Equity Derivatives Definitions unbekannt.

<sup>36</sup> Nur erforderlich, wenn für den Fall der Marktstörung vereinbart wird, dass die Referenzkurse einer Ersatzwertpapierbörse herangezogen werden sollen.

<sup>37</sup> Nur erforderlich, wenn ein Knock-in- oder ein Knock-out-Ereignis vereinbart wird.

<sup>38</sup> Nur erforderlich, wenn als Knock-in-Ereignis ein anderes Ereignis als das Erreichen oder Durchbrechen eines Schwellenwertes vereinbart wird.

<sup>39</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>40</sup> Nur erforderlich, wenn als Knock-out-Ereignis ein anderes Ereignis als das Erreichen oder Durchbrechen eines Schwellenwertes vereinbart wird.

[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 Wertpapiere erlischt.]
[Referenzwertermittlungszeitraum:] <sup>41</sup>	[Vom [ ] (einschließlich) bis zum [ ] (einschließlich)]
[Referenzwertermittlungstag:]	[ [ ] ]
[Referenzwertermittlungszeitpunkt:] <sup>42</sup>	[ [ ] ]
<b>[Regelungen betreffend Ausschüttungsbeträge:]<sup>43</sup></b>	
[Zahler der Ausschüttungsbeträge:]	[ [ ] ]
[Währung der Ausschüttungsbeträge:] <sup>44</sup>	[ [ ] ]
[Dividende:]	[Die vom Emittenten zu zahlende Dividende [einschließlich einer <sup>45</sup> ] [ohne die] vom Emittenten zu zahlende Sonderdividende – wie nachstehend unter „Besondere Ereignisse“ vereinbart, [zuzüglich einer] [ohne die <sup>46</sup> ] an der „Quelle“ von der zuständigen Steuerbehörde oder vom Emittenten für deren Rechnung einzubehaltenden Steuer oder Abgabe und ohne Berücksichtigung der von einer zuständigen Steuerbehörde gegebenenfalls gewährten Steuergutschrift oder einer von ihr gegebenenfalls festgesetzten oder von einer Steuergutschrift zum Abzug gebrachten sonstigen Steuer oder Abgabe.] ]
[Ausschüttungsfaktor:] <sup>47</sup>	[ [ ] ]
[Zeitpunkt, zu dem die Dividende als ausgeschüttet gilt:] <sup>48</sup>	[Register] [Ankündigung] [Gesetz] [Ex-Dividende]
[Fälligkeitstage für Ausschüttungsbeträge:]	[Jeweils der Fälligkeitstag für die Abwicklung, der unmittelbar auf die betreffende Ausschüttungsperiode folgt.]
[Ausschüttungsperiode:] <sup>49</sup>	[Fälligkeitstag/Fälligkeitstag]
<b>Regelungen betreffend variable Beträge:</b>	
Zahler der variablen Beträge:	[ ], falls der für den betreffenden Berechnungszeitraum

<sup>41</sup> Nur erforderlich, wenn ein von Nr. 10 Abs. 4 des Anhangs abweichender Zeitraum vereinbart wird.

<sup>42</sup> Nur erforderlich, wenn ein anderer als der in Nr. 10 Abs. 4 des Anhangs bestimmte Zeitpunkt (der Wertermittlungszeitpunkt) vereinbart wird.

<sup>43</sup> Nur erforderlich, wenn „Gesamtausgleich“ vereinbart wird.

<sup>44</sup> Nur erforderlich, wenn die Währung der Ausschüttungsbeträge von der Vertragswährung abweicht.

<sup>45</sup> Anwendbar, wenn vereinbart wird, dass Sonderdividenden ebenfalls ausgeschüttet werden sollen.

<sup>46</sup> Anwendbar, wenn Nettodividende vereinbart wird.

<sup>47</sup> Nur erforderlich, wenn nicht „Eins“ (Nr. 6 Abs. 3 des Anhangs) vereinbart wird.

<sup>48</sup> Nur erforderlich, wenn das Wertpapier eine Aktie und keine Schuldverschreibung ist und von der Regelung „Zahlungseingang“ (Nr. 6 Abs. 2 (e) des Anhangs) abgewichen werden soll.

<sup>49</sup> Nur erforderlich, wenn abweichend von Nr. 6 Abs. 3 des Anhangs, Definition von „Ausschüttungsperiode“ „Fälligkeitstag/Fälligkeitstag“ vereinbart wird.

	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] [ ]
[Währung der variablen Beträge:] <sup>50</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>51</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>52</sup> ].] [Jeder Fälligkeitstag für Ausgleichsbeträge]
Quotient:	[ ] <sup>53</sup>
[Berechnungszeitraum für variable Beträge:] <sup>54</sup>	[Fälligkeitstag/Fälligkeitstag]

**[Regelungen betreffend Anfangs- und Endbeträge:]**

<sup>50</sup> Nur erforderlich, wenn die Währung der variablen Beträge von der Vertragswährung abweicht.

<sup>51</sup> Nur erforderlich, wenn die Fälligkeitstage nicht angepasst werden sollen.

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

<sup>53</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>54</sup> Nur erforderlich, wenn abweichend von Nr. 6 Abs. 6 Satz 1 des Rahmenvertrages „Fälligkeitstag/Fälligkeitstag“ vereinbart wird.

[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>55</sup> ]. ]
[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>56</sup> ]. ]

### **Besondere Ereignisse:**

[Wertverwässerung oder -anreicherung:] <sup>57</sup>	[ [Optionsbörsenanpassung] [Anpassung durch Berechnungsstelle] ]
[Sonderdividende:] <sup>58</sup>	[ [ ] ]
[Einführung des Euro:] <sup>59</sup>	[Wird der Handel und die Quotierung der Kurse des Wertpapiers an der Wertpapierbörse auf Euro umgestellt, so gilt: „Anpassung durch Berechnungsstelle“. Erforderliche Umrechnungen erfolgen zum offiziellen Umrechnungskurs oder, falls ein solcher nicht besteht, zu dem von der Berechnungsstelle für den Wertermittlungszeitpunkt festgestellten Devisen-Mittelkurs.]
[Umwandlung:] <sup>60</sup>	<p>[(a) Aktie für Aktie: [Ersatzleistung] [Optionsbörsenanpassung] [Anpassung durch Berechnungsstelle] [Modifizierte Anpassung durch Berechnungsstelle] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich]</p> <p>(b) Sonstige Leistungen für Aktie: [Ersatzleistung] [Optionsbörsenanpassung] [Anpassung durch Berechnungsstelle] [Modifizierte Anpassung durch Berechnungsstelle] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich]</p> <p>(c) Gemischte Gegenleistung für Aktie: [Ersatzleistung] [Gemischte Anpassung] [Optionsbörsenanpassung] [Anpassung durch Berechnungsstelle] [Modifizierte Anpassung durch Berechnungsstelle] [Vorzeitige</p>

<sup>55</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages („modifiziert folgend“) erfolgen soll.

<sup>56</sup> Nur erforderlich, wenn die Anpassung nicht nach Nr. 3 Abs. 5 (c) des Rahmenvertrages („modifiziert folgend“) erfolgen soll.

<sup>57</sup> Nur erforderlich, wenn das Wertpapier eine Aktie und keine Schuldverschreibung ist und eine andere als die in Nr. 15 Abs. 3 des Anhangs vorgesehene Regelung „Anpassung durch Berechnungsstelle“ vereinbart wird.

<sup>58</sup> Nur erforderlich, wenn das Wertpapier eine Aktie und keine Schuldverschreibung ist und die Feststellung, ob eine Ausschüttung als Sonderdividende zu qualifizieren ist, nicht der Berechnungsstelle überlassen werden soll (Nr. 2 Abs. 1 des Anhangs, Definition von „Sonderdividende“). Die Sonderdividende hat Bedeutung für die Frage, ob eine Wertverwässerung nach Nr. 15 Abs. 2 Buchstabe (b)(D) des Anhangs vorliegt.

<sup>59</sup> Nur erforderlich, wenn das Wertpapier am Abschlussdatum in einer anderen Währung als Euro ausgedrückt ist oder gehandelt wird und die Einführung des Euro während der Laufzeit des Geschäfts nicht auszuschließen ist.

	Beendigung mit Barausgleich] ]
[Erwerbsangebot:] <sup>61</sup>	<p>(a) Aktie für Aktie:  [Ersatzleistung] [Optionsbörsenanpassung] [Anpassung durch Berechnungsstelle] [Modifizierte Anpassung durch Berechnungsstelle] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich]</p> <p>(b) Sonstige Leistungen für Aktie:  [Ersatzleistung] [Optionsbörsenanpassung] [Anpassung durch Berechnungsstelle] [Modifizierte Anpassung durch Berechnungsstelle] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich]</p> <p>(c) Gemischte Gegenleistung für Aktie:  [Ersatzleistung] [Gemischte Anpassung] [Optionsbörsenanpassung] [Anpassung durch Berechnungsstelle] [Modifizierte Anpassung durch Berechnungsstelle] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich] ]</p>
[Wahlrechte der Inhaber der Aktie:] <sup>62</sup>	[Steht den Inhabern der Aktie im Falle „Gemischte Gegenleistung für Aktie“ ein Wahlrecht dahin gehend zu, dass die Gegenleistung ganz oder teilweise aus sonstigen Leistungen besteht, so kann - abweichend von Nr. 16 Abs. 6 des Anhangs - der Käufer das Wahlrecht ausüben. Die Erklärung über die Ausübung darf dem Verkäufer nicht später als am zweiten regulären Handelstag vor dem Tag, an dem die Inhaber der Aktie das Wahlrecht spätestens ausüben müssen, zugehen, andernfalls steht das Wahlrecht dem Verkäufer zu.]
[Verstaatlichung:] <sup>63</sup>	[ [Verhandlung] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich] [Optionsbörsenanpassung] ]
[Insolvenz:] <sup>64</sup>	[ [Verhandlung] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich] [Optionsbörsenanpassung] ]
[Delisting:] <sup>65</sup>	[ [Verhandlung] [Vorzeitige Beendigung mit Barausgleich] [Optionsbörsenanpassung] ]
[Illiquider Markt:] <sup>66</sup>	[Vereinbart]
[Änderung der Rechtslage:] <sup>67</sup>	[Vereinbart]

<sup>60</sup> Nur erforderlich, wenn das Wertpapier eine Aktie und keine Schuldverschreibung ist und eine andere Regelung als „Ersatzleistung“ vereinbart wird (Nr. 16 Abs. 5 des Anhangs).

<sup>61</sup> Nur erforderlich, wenn das Wertpapier eine Aktie und keine Schuldverschreibung ist und eine andere Regelung als „Ersatzleistung“ vereinbart wird (Nr. 16 Abs. 5 des Anhangs).

<sup>62</sup> Nur erforderlich, wenn das Wertpapier eine Aktie und keine Schuldverschreibung ist und von Nr. 16 Abs. 6 des Anhangs (Ausübung des Wahlrechts durch die Berechnungsstelle) abgewichen werden soll.

<sup>63</sup> Nur erforderlich, wenn eine andere Regelung als „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ vereinbart wird (Nr. 17 Abs. 5 des Anhangs).

<sup>64</sup> Nur erforderlich, wenn eine andere Regelung als „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ vereinbart wird (Nr. 17 Abs. 5 des Anhangs).

<sup>65</sup> Nur erforderlich, wenn eine andere Regelung als „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ vereinbart wird (Nr. 17 Abs. 5 des Anhangs).

<sup>66</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>67</sup> Nur erforderlich, wenn die Regelung „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ nach Nr. 18 Abs. 3 des Anhangs zur Anwendung kommen soll.

[Insolvenzantrag:] <sup>68</sup>	[Vereinbart]
[Gescheiterte Absicherung:]	[Vereinbart]
[Verteuerung der Absicherung:]	[Vereinbart]
[Gescheitertes Wertpapierdarlehen:]	[Vereinbart]
[Verteuerung von Wertpapierdarlehen:]	[Vereinbart]
[Absichernde Partei:] <sup>69</sup>	[ [ ] ]
[Maximales Darlehensentgelt:] <sup>70</sup>	[ [ ] ]
[Anfängliches Darlehensentgelt:] <sup>71</sup>	[ [ ] ]
[Optionsbörse:] <sup>72</sup>	[Eurex] [Euronext] [LIFFE] [MEFF] [IDEM] [ ]
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“).
Benachrichtigungen:	[ ]
An die Bank:	[ ]
An den Vertragspartner:	[ ]
Ihr Konto:	[ ]
Unser Konto:	[ ]
[Makler:]	[ [ ] ]
Besondere Vereinbarungen:	[Keine] [ ]

Diese Bestätigung erhalten Sie als Telefax [und in Briefform<sup>73</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]

<sup>68</sup> Nur erforderlich, wenn die Regelung „vorzeitige Beendigung mit Barausgleich“ nach Nr. 18 Abs. 3 des Anhangs zur Anwendung kommen soll.

<sup>69</sup> Nur erforderlich, wenn für eine der Absicherungsstörungen die in Nr. 19 Abs. 2 des Anhangs vorgesehene Regelung gewählt wird.

<sup>70</sup> Nur erforderlich, wenn „gescheitertes Wertpapierdarlehens“ vereinbart wird.

<sup>71</sup> Nur erforderlich, wenn „Verteuerung von Wertpapierdarlehen“ vereinbart wird.

<sup>72</sup> Nur erforderlich, wenn „Optionsbörsenanpassung“ oder „Anpassung durch Berechnungsstelle“ vereinbart wird.

<sup>73</sup> Nur erforderlich, wenn die andere Partei nach Nr. 2 Abs. 2 des Rahmenvertrages eine unterzeichnete Ausfertigung des Einzelabschlusses verlangt.

---

[Unterschrift]

---

[Unterschrift]

Gegenbestätigt:  
[Vertragspartner]

---

[Ort, Datum]

---

[Unterschrift]

---

[Unterschrift]