clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 075/17

Datum: 15. August 2017
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

Aktiendividenden-Futures: Anpassung des Preismodells

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 185/14, 144/15, 075/16
Verweis auf Eurex-Clearing-Rundschreiben: 058/13
Kontakt: Eurex Pricing, eurex.pricing@eurexchange.com

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhänge:

1. Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG (Preisverzeichnis)
2. Transaktionsentgelte für Aktiendividenden-Futures für den Zeitraum vom 1. September 2017 bis 31. August 2018

Mit Wirkung zum **1. September 2017** treten die folgenden Maßnahmen der Eurex Clearing AG (Eurex Clearing) für Aktiendividenden-Futures in Kraft:

1. Anpassung des Preismodells für Aktiendividenden-Futures durch die Reduzierung der Anzahl von Dividendenstaffeln von fünf auf drei, wie in Anhang 1 aufgeführt.
2. Klassifizierung der Entgelte für jeden einzelnen Aktiendividenden-Future für den Zeitraum vom **1. September 2017 bis 31. August 2018** (siehe Anhang 2).

Dieses Rundschreiben enthält alle Informationen zur Anpassung des Preismodells sowie die geänderten Abschnitte der relevanten Regelwerke der Eurex Clearing.

Eurex Clearing AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Dr. Hugo Bänziger

Vorstand:
Erik Tim Müller (Vorsitzender),
Heike Eckert (stv. Vorsitzende),
Matthias Graulich,
Thomas Laux,
Manfred Matusza

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
USt-IdNr. DE194821553
Amtsgericht Frankfurt/Main

Aktiendividenden-Futures: Anpassung des Preismodells

Mit Wirkung zum 1. September 2017 treten die folgenden Maßnahmen der Eurex Clearing AG (Eurex Clearing) für Aktiendividenden-Futures in Kraft:

1. Anpassung des Preismodells für Aktiendividenden-Futures durch die Reduzierung der Anzahl von Dividendenstaffeln von fünf auf drei, wie in Anhang 1 aufgeführt.
2. Klassifizierung der Entgelte für jeden einzelnen Aktiendividenden-Future für den Zeitraum vom 1. September 2017 bis 31. August 2018 (siehe Anhang 2).

Dieses Rundschreiben enthält alle Informationen zur Anpassung des Preismodells sowie die geänderten Abschnitte der relevanten Regelwerke der Eurex Clearing.

1. Anpassung des Preismodells für Aktiendividenden-Futures ab dem 1. September 2017

Das Preismodell für Aktiendividenden-Futures umfasst gestaffelte Transaktionsentgelte, die nach der Höhe der zu erwartenden Dividenden zum Referenzdatum der jeweils zugrundeliegenden Aktie differenziert sind.

Um das derzeitige Preismodell zu vereinfachen, wird die Anzahl der Dividendenstaffeln von fünf auf drei reduziert. Dabei werden die Dividendenstaffeln „>=1,00“ mit „0,75-0,99“ und „0,50-0,74“ mit „0,25-0,49“ zusammengefasst. Daraus ergeben sich Änderungen in den Entgelten der entsprechenden Dividendenstaffeln, die der nachfolgenden Tabelle detailliert entnommen werden können.

Gruppenkennung	Währung	Dividende der zugrundeliegenden Aktie	Orderbuch	Off-Book		Dividende der zugrundeliegenden Aktie	Orderbuch	Off-Book
BE21, DE21, ES21, FI21, FR21, GB23, IE21, NL21, IT21	EUR	>= 1,00	1,20	1,80	}	>= 0,75	1,20	1,80
		0,75 – 0,99	1,00	1,50				
		0,50 – 0,74	0,80	1,20	}	0,25 – 0,74	0,70	1,05
		0,25 – 0,49	0,60	0,90				
		< 0,25	0,20	0,30		< 0,25	0,20	0,30
CH21	CHF	>= 1,00	1,60	2,40	}	>= 0,75	1,60	2,40
		0,75 – 0,99	1,30	1,95				
		0,50 – 0,74	1,10	1,65	}	0,25 – 0,74	1,00	1,50
		0,25 – 0,49	0,80	1,20				
		< 0,25	0,30	0,45		< 0,25	0,30	0,45
GB21	GBP	>= 1,00	0,30	0,45	}	>= 0,75	0,30	0,45
		0,75 – 0,99	0,26	0,39				
		0,50 – 0,74	0,20	0,30	}	0,25 – 0,74	0,16	0,24
		0,25 – 0,49	0,10	0,15				
		< 0,25	0,04	0,06		< 0,25	0,04	0,06
GB22, US21, US22	USD	>= 1,00	1,20	1,80	}	>= 0,75	1,20	1,80
		0,75 – 0,99	1,00	1,50				
		0,50 – 0,74	0,80	1,20	}	0,25 – 0,74	0,70	1,05
		0,25 – 0,49	0,60	0,90				
		< 0,25	0,20	0,30		< 0,25	0,20	0,30

Ab dem 1. September 2017 wird das aktualisierte Preisverzeichnis auf der Eurex Clearing-Webseite www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Ressourcen > Regelwerke > Preisverzeichnis

2. Klassifizierung der Entgelte für jeden Aktiendividenden-Future für den Zeitraum vom 1. September 2017 bis 31. August 2018

Die Klassifizierung der Entgelte für jeden Aktiendividenden-Future für den Zeitraum vom 1. September 2017 bis 31. August 2018 basiert auf der zu erwartenden Dividende der jeweils zugrundeliegenden Aktie im kommenden Kalenderjahr am Referenzdatum (31. Juli 2017) und kann Anhang 2 entnommen werden.

Gemäß Ziffer 14 Abs. 3 des Preisverzeichnisses gelten die mit diesem Rundschreiben mitgeteilten Änderungen und Ergänzungen des Preisverzeichnisses als durch das jeweilige Clearing-Mitglied angenommen, sofern dieses nicht durch schriftliche Mitteilung an die Eurex Clearing AG innerhalb von zehn (10) Geschäftstagen nach der Veröffentlichung widerspricht.

Für Fragen oder weitere Informationen kontaktieren Sie bitte das Eurex Pricing Team unter der E-Mail eurex.pricing@eurexchange.com.

15. August 2017

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

3. Transaktionsentgelte für Derivate-Geschäfte (Orderbuch-Geschäfte und Off-Book-Geschäfte an den Eurex-Börsen)

[…]

3.1 Zusammenführung / Erfassung von Derivate-Geschäften

[…]

Die Zuordnung des Entgeltes für Aktiendividenden-Futures erfolgt wie folgt:

Die Zuordnung des Entgeltes eines einzelnen Aktiendividenden-Futures basiert auf der für den Aktiendividenden-Future maßgeblichen Dividende am Stichtag und wird mit Wirkung zum 1. September eines jeden Kalenderjahres festgelegt. Der Stichtag ist der letzte Handelstag im Juli eines jeden Jahres. Die Zuordnung des Entgeltes wird jährlich durch Rundschreiben bekannt gegeben und gilt bis zum 1. September des Folgejahres.

Produkt / Produktgruppe	**Währung**	**Ausführungsart**	**Dividende der zugrundeliegenden Aktie**	**Konten**	**Standard-Entgelt pro Kontrakt** (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	**Reduziertes Entgelt pro Kontrakt** (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	**Schwellenwert** (Kontraktanzahl)
Aktiendividenden-Futures mit in Annex D der Eurex-Kontraktspezifikationen zugewiesener Gruppenkennung							
CH21	CHF	Orderbuch	>= ~~1,000~~0,75	A	1,60	n. a.	n. a.
				P	1,60	n. a.	n. a.
				M	1,60	n. a.	n. a.
			~~0,75 – 0,99~~	~~A~~	~~1,30~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,30~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,30~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,50~~0,25 – 0,74	A	~~1,10~~1,00	n. a.	n. a.
				P	~~1,10~~1,00	n. a.	n. a.
				M	~~1,10~~1,00	n. a.	n. a.

Produkt / Produktgruppe	Währung	Ausführungsart	Dividende der zugrundeliegenden Aktie	Konten	Standard-Entgelt pro Kontrakt (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	Reduziertes Entgelt pro Kontrakt (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	Schwellenwert (Kontraktanzahl)
			~~0,25 – 0,49~~	~~A~~	~~0,80~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,80~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,80~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			< 0,25	A	0,30	n. a.	n. a.
				P	0,30	n. a.	n. a.
				M	0,30	n. a.	n. a.
		Off-Book	>= ~~1,000~~0,75	A	2,40	n. a.	n. a.
				P	2,40	n. a.	n. a.
				M	2,40	n. a.	n. a.
			~~0,75 – 0,99~~	~~A~~	~~1,95~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,95~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,95~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,50~~ 0,25– 0,74	A	~~1,65~~1,50	n. a.	n. a.
				P	~~1,65~~1,50	n. a.	n. a.
				M	~~1,65~~1,50	n. a.	n. a.
			~~0,25 – 0,49~~	~~A~~	~~1,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			< 0,25	A	0,45	n. a.	n. a.
				P	0,45	n. a.	n. a.
				M	0,45	n. a.	n. a.
BE21, DE21, ES21, FI21, FR21, GB23, IE21, NL21, IT21	EUR	Orderbuch	>= ~~1,000~~0,75	A	1,20	n. a.	n. a.
				P	1,20	n. a.	n. a.
				M	1,20	n. a.	n. a.
			~~0,75 – 0,99~~	~~A~~	~~1,00~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,00~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,00~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,50~~ 0,25– 0,74	A	~~0,80~~0,70	n. a.	n. a.
				P	~~0,80~~0,70	n. a.	n. a.
				M	~~0,80~~0,70	n. a.	n. a.
			~~0,25 – 0,49~~	~~A~~	~~0,60~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,60~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,60~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			< 0,25	A	0,20	n. a.	n. a.
				P	0,20	n. a.	n. a.
				M	0,20	n. a.	n. a.

Produkt / Produktgruppe	**Währung**	**Ausführungsart**	**Dividende der zugrundeliegenden Aktie**	**Konten**	**Standard-Entgelt pro Kontrakt** (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	**Reduziertes Entgelt pro Kontrakt** (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	**Schwellenwert** (Kontraktanzahl)
		Off-Book	>= ~~1,000~~0,75	A	1,80	n. a.	n. a.
				P	1,80	n. a.	n. a.
				M	1,80	n. a.	n. a.
			~~0,75 – 0,99~~	~~A~~	~~1,50~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,50~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,50~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,50~~0,25 – 0,74	A	~~1,20~~1,05	n. a.	n. a.
				P	~~1,20~~1,05	n. a.	n. a.
				M	~~1,20~~1,05	n. a.	n. a.
			~~0,25 – 0,49~~	~~A~~	~~0,90~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,90~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,90~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			< 0,25	A	0,30	n. a.	n. a.
				P	0,30	n. a.	n. a.
				M	0,30	n. a.	n. a.
GB21	GBP	Orderbuch	>= ~~1,000~~0,75	A	0,30	n. a.	n. a.
				P	0,30	n. a.	n. a.
				M	0,30	n. a.	n. a.
			~~0,75 – 0,99~~	~~A~~	~~0,26~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,26~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,26~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,50~~0,25 – 0,74	A	~~0,20~~0,16	n. a.	n. a.
				P	~~0,20~~0,16	n. a.	n. a.
				M	~~0,20~~0,16	n. a.	n. a.
			~~0,25 – 0,49~~	~~A~~	~~0,10~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,10~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,10~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			< 0,25	A	0,04	n. a.	n. a.
				P	0,04	n. a.	n. a.
				M	0,04	n. a.	n. a.
		Off-Book	>= ~~1,000~~0,75	A	0,45	n. a.	n. a.
				P	0,45	n. a.	n. a.
				M	0,45	n. a.	n. a.
			~~0,75 – 0,99~~	~~A~~	~~0,39~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,39~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,39~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~

Produkt / Produktgruppe	Währung	Ausführungsart	Dividende der zugrundeliegenden Aktie	Konten	Standard-Entgelt pro Kontrakt (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	Reduziertes Entgelt pro Kontrakt (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	Schwellenwert (Kontraktanzahl)
			~~0,50~~0,25 – 0,74	A	~~0,30~~0,24	n. a.	n. a.
				P	~~0,30~~0,24	n. a.	n. a.
				M	~~0,30~~0,24	n. a.	n. a.
			~~0,25 – 0,49~~	~~A~~	~~0,15~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,15~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,15~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			< 0,25	A	0,06	n. a.	n. a.
				P	0,06	n. a.	n. a.
				M	0,06	n. a.	n. a.
~~GB22~~	~~USD~~	~~Orderbuch~~	~~>= 1,00~~	~~A~~	~~1,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,75 – 0,99~~	~~A~~	~~1,00~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,00~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,00~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,50 – 0,74~~	~~A~~	~~0,80~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,80~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,80~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,25 – 0,49~~	~~A~~	~~0,60~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,60~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,60~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~< 0,25~~	~~A~~	~~0,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
		~~Off-Book~~	~~>= 1,00~~	~~A~~	~~1,80~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,80~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,80~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,75 – 0,99~~	~~A~~	~~1,50~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,50~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,50~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,50 – 0,74~~	~~A~~	~~1,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,20~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,25 – 0,49~~	~~A~~	~~0,90~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,90~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,90~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~

Produkt / Produktgruppe	**Währung**	**Ausführungsart**	**Dividende der zugrundeliegenden Aktie**	**Konten**	**Standard-Entgelt pro Kontrakt** (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	**Reduziertes Entgelt pro Kontrakt** (Kontraktanzahl ≤ Schwellenwert)	**Schwellenwert** (Kontraktanzahl)
			~~< 0,25~~	~~A~~	~~0,30~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,30~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,30~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
GB22, US21, US22	USD	Orderbuch	>= ~~1,000~~,75	A	1,20	n. a.	n. a.
				P	1,20	n. a.	n. a.
				M	1,20	n. a.	n. a.
			~~0,75 – 0,99~~	~~A~~	~~1,00~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,00~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,00~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,50~~0,25~~ –~~ 0,74	A	~~0,80~~0,70	n. a.	n. a.
				P	~~0,80~~0,70	n. a.	n. a.
				M	~~0,80~~0,70	n. a.	n. a.
			~~0,25 – 0,49~~	~~A~~	~~0,60~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,60~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,60~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			< 0,25	A	0,20	n. a.	n. a.
				P	0,20	n. a.	n. a.
				M	0,20	n. a.	n. a.
		Off-Book	>= ~~1,000~~,75	A	1,80	n. a.	n. a.
				P	1,80	n. a.	n. a.
				M	1,80	n. a.	n. a.
			~~0,75 – 0,99~~	~~A~~	~~1,50~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~1,50~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~1,50~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			~~0,50~~ 0,25~~ –~~ 0,74	A	~~1,20~~1,05	n. a.	n. a.
				P	~~1,20~~1,05	n. a.	n. a.
				M	~~1,20~~1,05	n. a.	n. a.
			~~0,25 – 0,49~~	~~A~~	~~0,90~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~P~~	~~0,90~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
				~~M~~	~~0,90~~	~~n. a.~~	~~n. a.~~
			< 0,25	A	0,30	n. a.	n. a.
				P	0,30	n. a.	n. a.
				M	0,30	n. a.	n. a.

[…]

3.4 Barausgleich (Cash Settlement)

[…]

Die Zuordnung des Entgeltes eines einzelnen Aktiendividenden-Futures basiert auf der für den Aktiendividenden-Future maßgeblichen Dividende am Stichtag und wird mit Wirkung zum 1. September eines jeden Kalenderjahres festgelegt. Der Stichtag ist der letzte Handelstag im Juli eines jeden Jahres. Die Zuordnung des Entgeltes wird jährlich durch Rundschreiben bekannt gegeben und gilt bis zum 1. September des Folgejahres.

Produkt / Produktgruppe	Währung	Dividende der zugrunde liegenden Aktie	Entgelt pro Kontrakt	Maximales Entgelt für Kontrakte auf den gleichen Basiswert je A-, P- und M-Konto
Aktiendividenden-Futures mit in Annex D der Eurex-Kontrakspezifikationen zugewiesener Gruppenkennung				
CH21	CHF	>= ~~1,00~~0,75	1,60	n. a.
		~~0,75 – 0,99~~	~~1,30~~	
		~~0,50~~0,25 ~~–~~ 0,74	~~1,10~~1,00	
		~~0,25 – 0,49~~	~~0,80~~	
		< 0,25	0,30	
BE21, DE21, ES21, FI21, FR21, GB23, IE21, IT21, NL21	EUR	>= ~~1,00~~0,75	1,20	n. a.
		~~0,75 – 0,99~~	~~1,00~~	
		~~0,50~~0,25 ~~–~~ 0,74	~~0,80~~0,70	
		~~0,25 – 0,49~~	~~0,60~~	
		< 0,25	0,20	
GB21	GBP	>= ~~1,00~~0,75	0,30	n. a.
		~~0,75 – 0,99~~	~~0,26~~	
		~~0,50~~ 0,25 ~~–~~ 0,74	~~0,20~~0,16	
		~~0,25 – 0,49~~	~~0,10~~	
		< 0,25	0,04	
~~GB22~~	US~~D~~	~~>= 1,00~~	~~1,20~~	~~n. a.~~
		~~0,75 – 0,99~~	~~1,00~~	
		~~0,50 – 0,74~~	~~0,80~~	
		~~0,25 – 0,49~~	~~0,60~~	
		~~< 0,25~~	~~0,20~~	
GB22, US21, US22	USD	>= ~~1,00~~0,75	1,20	n. a.
		~~0,75 – 0,99~~	~~1,00~~	
		~~0,50~~0,25 ~~–~~ 0,74	~~0,80~~0,70	
		~~0,25 – 0,49~~	~~0,60~~	
		< 0,25	0,20	

[…]

****

Transaktionsentgelte für Aktiendividenden-Futures für den Zeitraum vom 1. September 2017 bis 31. August 2018

Gruppen kennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
BE21	I2TK	Anheuser-Busch InBev Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
CH21	A2BB	ABB Dividend Futures	1,601~~,10~~	2,401~~,65~~	1,601~~,10~~	CHF
CH21	A2DE	Adecco Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	C2FR	Cie Financière Richemont Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	C5SG	Credit Suisse Dividend Futures	1,00~~0,80~~	1,501~~,20~~	1,00~~0,80~~	CHF
CH21	C3SG	Credit Suisse Group Dividend Futures	1,00~~0,80~~	1,501~~,20~~	1,00~~0,80~~	CHF
CH21	C4SG	Credit Suisse Group Dividend Futures	1,00~~0,80~~	1,501~~,20~~	1,00~~0,80~~	CHF
CH21	G2EB	Geberit Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	G2IV	Givaudan Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	B2AE	Julius Bär Gruppe Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	H2OL	LafargeHolcim Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	N2ES	Nestlé Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	N2OV	Novartis Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	R2OG	Roche Holding Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	S2GS	SGS Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	U2HR	Swatch Group (bearer shares) Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	S5RE	Swiss Re Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	S4RE	Swiss Re Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF

Gruppenkennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
CH21	S2CM	Swisscom Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	U2BS	UBS Dividend Futures	1,001,10	1,501,65	1,001,10	CHF
CH21	U3BS	UBS Dividend Futures	1,001,10	1,501,65	1,001,10	CHF
CH21	U4BS	UBS Dividend Futures	1,001,10	1,501,65	1,001,10	CHF
CH21	Z2UR	Zurich Financial Services Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
DE21	A2DS	Adidas Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	A2LV	Allianz Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	B2AS	BASF Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	B2AY	Bayer Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	B2MW	BMW Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	C2EC	CECONOMY Dividend Futures	1,201,00	1,801,50	1,201,00	EUR
DE21	C2ON	Continental Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	D2AI	Daimler Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	D2BK	Deutsche Bank Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
DE21	D3BK	Deutsche Bank Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
DE21	D4BK	Deutsche Bank Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
DE21	D3B1	Deutsche Börse Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	D2PW	Deutsche Post Dividend Futures	1,201,00	1,801,50	1,201,00	EUR
DE21	D2TE	Deutsche Telekom Dividend Futures	0,700,80	1,051,20	0,700,80	EUR
DE21	E3OA	E.ON Dividend Futures	0,700,20	1,050,30	0,700,20	EUR
DE21	E2OA	E.ON-Uniper Dividend Futures	0,700,20	1,050,30	0,700,20	EUR

Gruppenkennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
DE21	F2RE	Fresenius Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR
DE21	H2EN	Henkel pref. Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	S2DF	K+S Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR
DE21	L2IN	Linde Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	L2HA	Lufthansa Dividend Futures	0,70~~0,60~~	1,05~~0,90~~	0,70~~0,60~~	EUR
DE21	M2RK	Merck Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	255C	Metro-Ceconomy Basket Dividend Futures	1,20~~1,00~~	1,80~~1,50~~	1,20~~1,00~~	EUR
DE21	M2UV	Münchener Rück Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	R3WE	RWE Dividend Futures	0,70~~0,60~~	1,05~~0,90~~	0,70~~0,60~~	EUR
DE21	S3AP	SAP Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	S3IE	Siemens Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	T2KA	ThyssenKrupp Dividend Futures	0,20~~0,60~~	0,30~~0,90~~	0,20~~0,60~~	EUR
DE21	V2W3	VW pref. Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
ES21	B3BV	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Dividend Futures	0,20~~0,60~~	0,30~~0,90~~	0,20~~0,60~~	EUR
ES21	S2SD	Banco Santander Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
ES21	S3SD	Banco Santander Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
ES21	I2BE	Iberdrola Dividend Futures	0,70~~0,20~~	1,05~~0,30~~	0,70~~0,20~~	EUR
ES21	I5XD	Inditex Dividend Futures	0,70~~0,60~~	1,05~~0,90~~	0,70~~0,60~~	EUR
ES21	I6XD	Inditex Dividend Futures	0,70~~0,60~~	1,05~~0,90~~	0,70~~0,60~~	EUR
ES21	I7XD	Inditex Dividend Futures	0,70~~0,60~~	1,05~~0,90~~	0,70~~0,60~~	EUR
ES21	I8XD	Inditex Dividend Futures	0,70~~0,60~~	1,05~~0,90~~	0,70~~0,60~~	EUR

Gruppenkennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
ES21	R2EP	Repsol Dividend Futures	1,20~~0,60~~	1,80~~0,90~~	1,20~~0,60~~	EUR
ES21	R3EP	Repsol Dividend Futures	1,20~~0,60~~	1,80~~0,90~~	1,20~~0,60~~	EUR
ES21	T2NE	Telefónica Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR
ES21	T3NE	Telefónica Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR
FI21	E2IA	Elisa Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FI21	F2OT	Fortum Dividend Futures	1,20~~1,00~~	1,80~~1,50~~	1,20~~1,00~~	EUR
FI21	V2LM	Metso Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FI21	N3OA	Nokia Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
FI21	N4OA	Nokia Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
FI21	N2DB	Nordea Bank Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR
FI21	S2MP	Sampo Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	A2CR	Accor Dividend Futures	1,20~~1,00~~	1,80~~1,50~~	1,20~~1,00~~	EUR
FR21	A3IR	Air Liquide Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	A4IR	Air Liquide Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	A5IR	Air Liquide Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	E2AS	Airbus Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	A3OM	ALSTOM Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR
FR21	A2XA	AXA Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	B2NP	BNP Paribas Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	B2YG	Bouygues Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	C3AR	Carrefour Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR

Gruppen kennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
FR21	X2CA	Crédit Agricole Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR
FR21	B2SN	Danone Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	E2DF	Electricité de France Dividend Futures	0,70~~0,60~~	1,05~~0,90~~	0,70~~0,60~~	EUR
FR21	E3DF	Electricité de France Dividend Futures	0,70~~0,60~~	1,05~~0,90~~	0,70~~0,60~~	EUR
FR21	G2ZF	ENGIE Dividend Futures	0,70~~1,00~~	1,05~~1,50~~	0,70~~1,00~~	EUR
FR21	E2SL	Essilor International Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	P2PX	Kering Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	L2OR	L'Oréal Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	M2OH	LVMH Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	M3OH	LVMH Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	F2TE	Orange Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR
FR21	P2ER	Pernot-Ricard Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	P2U4	Publicis Groupe Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	R2NL	Renault Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S2EJ	Safran Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	G2OB	Saint-Gobain Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S2NW	Sanofi Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S3ND	Schneider Electric Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S2GE	Société Générale Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	T2OT	TOTAL Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	V3AC	Vallourec Dividend Futures	0,70~~0,60~~	1,05~~0,90~~	0,70~~0,60~~	EUR

Gruppen kennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
FR21	V2VD	Veolia Environnement Dividend Futures	1,20~~0,80~~	1,80~~1,20~~	1,20~~0,80~~	EUR
FR21	S2QU	Vinci Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S3QU	Vinci Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	V3VU	Vivendi Universal Dividend Futures	0,70~~1,00~~	1,05~~1,50~~	0,70~~1,00~~	EUR
FR21	V4VU	Vivendi Universal Dividend Futures	0,70~~1,00~~	1,05~~1,50~~	0,70~~1,00~~	EUR
FR21	V5VU	Vivendi Universal Dividend Futures	0,70~~1,00~~	1,05~~1,50~~	0,70~~1,00~~	EUR
GB21	A2V	Aviva Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	B2A	BAE Systems Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	B3AR	Barclays Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	B2P	BP Dividend Futures	0,16~~0,10~~	0,24~~0,15~~	0,16~~0,10~~	GBP
GB21	B2AT	British American Tobacco Dividend Futures	0,30	0,45	0,30	GBP
GB21	B2T	BT Group Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	C2NA	Centrica Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	D2GE	Diageo Dividend Futures	0,16~~0,20~~	0,24~~0,30~~	0,16~~0,20~~	GBP
GB21	G3SK	GlaxoSmithKline Dividend Futures	0,30~~0,20~~	0,45~~0,30~~	0,30~~0,20~~	GBP
GB21	G4SK	GlaxoSmithKline Dividend Futures	0,30~~0,20~~	0,45~~0,30~~	0,30~~0,20~~	GBP
GB21	N2G	National Grid Dividend Futures	0,16~~0,10~~	0,24~~0,15~~	0,16~~0,10~~	GBP
GB21	N3G	National Grid Dividend Futures	0,16~~0,10~~	0,24~~0,15~~	0,16~~0,10~~	GBP
GB21	R2TZ	Rio Tinto Dividend Futures	0,30~~0,26~~	0,45~~0,39~~	0,30~~0,26~~	GBP
GB21	B2G	Royal Dutch Shell B Dividend Futures	0,30~~0,26~~	0,45~~0,39~~	0,30~~0,26~~	GBP
GB21	S2VT	Severn Trent Dividend Futures	0,30~~0,26~~	0,45~~0,39~~	0,30~~0,26~~	GBP

Gruppenkennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
GB21	S2SE	SSE Dividend Futures	0,300,26	0,450,39	0,300,26	GBP
GB21	T2SC	Tesco Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	V4O	Vodafone Group Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	M2RW	WM Morrison Supermarkets Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB22	A2AL	Anglo American Dividend Futures	0,700,60	1,050,90	0,700,60	USD
GB22	A2ZN	AstraZeneca Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
GB22	B2LT	BHP Billiton Basket Dividend Futures	0,701,00	1,051,50	0,701,00	USD
GB22	B3LT	BHP Billiton Dividend Futures	0,701,00	1,051,50	0,701,00	USD
GB22	H2SB	HSBC Dividend Futures	0,700,60	1,050,90	0,700,60	USD
GB23	R2DA	Royal Dutch Shell Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
IE21	C2RG	CRH Dividend Futures	0,700,80	1,051,20	0,700,80	EUR
IT21	A2SG	Assicurazioni Generali Dividend Futures	1,200,80	1,801,20	1,200,80	EUR
IT21	E2NL	Enel Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
IT21	E2NT	Eni Dividend Futures	1,200,80	1,801,20	1,200,80	EUR
IT21	I3ES	Intesa Sanpaolo Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
IT21	T2QI	Telecom Italia Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
IT21	U2EI	Terna Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
IT21	C3RI	UniCredit Dividend Futures	0,700,20	1,050,30	0,700,20	EUR
IT21	C4RI	UniCredit Dividend Futures	0,700,20	1,050,30	0,700,20	EUR
NL21	A2EN	AEGON Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
NL21	A2HO	Ahold Delhaize Dividend Futures	0,700,80	1,051,20	0,700,80	EUR

Gruppen kennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
NL21	A3HO	Ahold Delhaize Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR
NL21	A2KU	Akzo Nobel Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
NL21	I2SP	Arcelor Mittal Dividend Futures	0,70~~0,20~~	1,05~~0,30~~	0,70~~0,20~~	EUR
NL21	I3SP	Arcelor Mittal Dividend Futures	0,70~~0,20~~	1,05~~0,30~~	0,70~~0,20~~	EUR
NL21	I4SP	Arcelor Mittal Dividend Futures	0,70~~0,20~~	1,05~~0,30~~	0,70~~0,20~~	EUR
NL21	A2SM	ASML Holding Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
NL21	L2DV	Gemalto Dividend Futures	0,70~~0,60~~	1,05~~0,90~~	0,70~~0,60~~	EUR
NL21	I2NN	ING Dividend Futures	0,70~~0,80~~	1,05~~1,20~~	0,70~~0,80~~	EUR
NL21	D2SM	Koninklijke DSM Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
NL21	P2HI	Philips Dividend Futures	1,20~~1,00~~	1,80~~1,50~~	1,20~~1,00~~	EUR
NL21	K3PN	Royal KPN Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
NL21	K4PN	Royal KPN Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
NL21	K5PN	Royal KPN Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
NL21	K6PN	Royal KPN Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
NL21	U2BL	Unibail-Rodamco Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
NL21	U2NI	Unilever NV Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
US21	M2MM	3M Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	M2OF	Altria Group Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	B2AC	Bank of America Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	USD
US21	B2MY	Bristol-Myers Squibb Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	C2VX	Chevron Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD

Gruppenkennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
US21	C2IT	Citigroup Dividend Futures	0,70~~0,20~~	1,05~~0,30~~	0,70~~0,20~~	USD
US21	G2EC	General Electric Dividend Futures	1,20~~1,00~~	1,80~~1,50~~	1,20~~1,00~~	USD
US21	I2BM	IBM Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	J2NJ	Johnson & Johnson Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	J2PM	JPMorgan Chase Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	M2CD	McDonald's Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	P2EP	PepsiCo Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	P2FE	Pfizer Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	P2M	Philip Morris International Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	K2OF	The Coca-Cola Company Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	W2MT	Wal-Mart Stores Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US22	A2MZ	Amazon.com Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	USD
US22	A2AP	Apple Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US22	C2SC	Cisco Systems Dividend Futures	1,20~~1,00~~	1,80~~1,50~~	1,20~~1,00~~	USD
US22	I2NT	Intel Dividend Futures	1,20~~1,00~~	1,80~~1,50~~	1,20~~1,00~~	USD
US22	M2ST	Microsoft Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD

Die Zuordnung des Entgeltes eines einzelnen Aktiendividenden-Futures basiert auf der für den Aktiendividenden-Future maßgeblichen Dividende am jeweiligen Stichtag mit Wirksamkeit zum 1. September jeden Jahres und wird jeweils durch Rundschreiben bekannt gegeben. Stichtag ist der letzte Handelstag im Juli eines jeden Jahres.

Wird in einem Aktiendividenden-Future aufgrund einer Kapitalmaßnahme in der zugrundeliegenden Aktie ein Nachfolgeprodukt zum Handel zugelassen, gelten die dem Vorgängerprodukt zugewiesene Transaktionsentgelte auch für das Nachfolgeprodukt.