

CORPORATE ACTION NOTICE

This Notice applies to the following market:

Paris Market

Notice No: CA/2006/244/P

ISSUE DATE: 17 August 2006

EFFECTIVE DATE: 4 September 2006

EQUITY OPTIONS

DAIMLER CHRYSLER AG

DELISTING

This Notice is issued pursuant to the Corporate Actions Policy for Euronext.liffe markets, which is available on the Euronext website at www.euronext.com/derivatives/rules. It requires the immediate attention of members' staff involved with the trading and settlement of Euronext.liffe equity products. Members should ensure that clients are made aware of the arrangements detailed in this Notice.

1. **Contracts:** Daimler Chrysler AG Equity Option Contract, American style (LE1).
2. **Background:** Daimler Chrysler AG has requested to de-list the Daimler Chrysler AG Ordinary shares from the Euronext Cash Market.
3. **Effective Date:** Monday 4 September 2006.
4. **Contract Adjustments:** The option class LE1 will be de-listed, subject to no objection of the regulator. All outstanding positions will be settled in cash using the fair value method.
5. **Implied Volatility:** For each individual series, an implied volatility will be determined in order to calculate the fair value of such series.
 - (a) The implied volatilities shall be determined from the Daily Settlement Price of each respective series over the ten business days preceding the effective date (Monday 4 September 2006), being the period from 21 August 2006 to 1 September 2006 inclusive.
 - (b) In determining the implied volatilities, dividend forecasts will be used as published by Markit Dividends on the ten business days preceding the effective date.

Web site: www.euronext.com/derivatives

The Euronext Derivatives Markets ("Euronext.liffe") include the markets for derivatives operated by Euronext Amsterdam, Euronext Brussels, Euronext Lisbon, Euronext Paris and LIFFE Administration and Management, referred to respectively as the Amsterdam, Brussels, Lisbon, Paris and London markets.

(c) The interest rates used for the calculation of the implied volatilities are the relevant Euribor rates on the ten business days preceding the effective date.

(d) For the calculations of the implied volatilities the closing prices of the Daimler Chrysler AG shares listed on Deutsche Börse shall be used as published on the ten business days preceding the effective date.

6. Fair Value: The fair value settlement prices shall be calculated using the average of the implied volatilities calculated in accordance with section 5 of this Notice, leaving out the highest and the lowest volatility observation for each series, in accordance with the Corporate Action Policy.

Furthermore, in determining fair value prices, Euronext.liffe will use Markit Dividends forecasts as well as the relevant Euribor interest rates and the closing price of Daimler Chrysler AG shares on Deutsche Börse as published on Friday 1 September 2006.

7. Suspension: Maturities with no open interest in the option class LE1 (December 06, March 07 and June 07) are suspended as from the close of business on Thursday 17 August 2005.

For further information in relation to this Notice, please contact:

Euronext.liffe:

Quality of Derivative Markets +31 (0) 20 550 4296 DerivativesCorporateActions@liffe.com

LCH.Clearnet:

Jean-Bertrand Lesparre +33 (0) 1 7037 6646 Jean-Bertrand.Lesparre@lchclearnet.com

OPÉRATION SUR TITRE

Cet avis concerne le marché suivant:

Marché Paris

Notice No: CA/2006/244/P

DATE DE PUBLICATION: 17 août 2006

DATE EFFECTIVE: 4 septembre 2006

OPTIONS SUR ACTIONS INDIVIDUELLES

DAIMLER CHRYSLER AG

DELISTING / RADIATION

Cet avis se réfère à la **Politique d'Opérations sur Titres**, disponible sur le site Web d'Euronext à www.euronext.com/derivatives/rules. Il requiert l'attention immédiate du personnel des Membres en charge de la négociation et de la compensation des options sur actions négociables d'Euronext.Liffe. Les Membres sont priés d'informer leurs clients des décisions décrites dans ce Bulletin.

1. **Contrats:** Options sur actions Daimler Chrysler AG de style américain (LE1).
2. **Détail:** Daimler Chrysler AG a demandé la radiation des actions Daimler Chrysler AG d'Euronext Paris.
3. **Date effective:** Le lundi 4 septembre 2006.
4. **Ajustements des contrats:** La classe d'options LE1 sera délistée, sauf objection du régulateur. Toutes les positions ouvertes seront liquidées selon la méthode de la Juste Valeur.
5. **Volatilité implicite:** Une volatilité implicite sera déterminée pour chaque série pour calculer les prix à leur Juste Valeur.
 - (a) Les volatilités implicites seront basées sur les cours de clôture officiels des options Daimler Chrysler AG les 10 jours ouvrables précédant le lundi 4 septembre 2006, soit la période du 21 août 2006 au 1er septembre 2006 inclusive.
 - (b) Lors du calcul des volatilités implicites les dividendes utilisés seront ceux publiés par Markit Dividends les dix jours ouvrables précédant le lundi 4 septembre 2006.
 - (c) Les taux d'intérêt utilisés pour les calculs des volatilités implicites, seront les taux Euribor publiés les dix jours ouvrables précédant le lundi 4 septembre 2006.

(d) Lors du calcul des volatilités implicites, les cours de clôture des actions Daimler Chrysler AG listées sur Deutsche Börse seront utilisés les dix jours ouvrables précédant le lundi 4 septembre 2006.

- 6. Juste Valeur:** La Juste Valeur sera calculée en utilisant la moyenne des volatilités implicites calculées conformément au paragraphe 5 de la présente Notice, excluant l'observation la plus élevée et l'observation la plus basse de la période de dix jours sous revue, selon la Politique d'Opérations sur Titres.

En outre, en déterminant des prix Juste Valeur, Euronext.liffe emploiera des prévisions de dividendes de Markit Dividends, les taux d'intérêt appropriés d'Euribor et le cours de clôture des actions de Daimler Chrysler AG listées sur Deutsche Börse comme édité le vendredi 1er septembre 2006.

- 7. Suspension:** Les maturités sans positions ouvertes pour la classe LE1 (décembre 06, mars 07 et juin 07) seront suspendues à partir de la clôture de la journée de Bourse du jeudi 17 août 2006.

Pour de plus amples informations concernant cet avis, nous vous prions de bien vouloir contacter:

Euronext.liffe:

Quality of Derivative Markets +31 (0) 20 550 4296 DerivativesCorporateActions@liffe.com

LCH.Clearnet:

Jean-Bertrand Lesparre +33 (0) 1 7037 6646 Jean-Bertrand.Lesparre@lchclearnet.com