X-pand into the Future

eurex rundschreiben 120/11

Datum: 17. Mai 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz

Banco BPI: Bonus-Aktien

Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- Revision/Security Coordination

Anhänge:
keine

Zusammenfassung:

Die Hauptversammlung der Gesellschaft Banco BPI hat am 27. April 2011 u.a. die Ausgabe von Bonus-Aktien im Verhältnis eine neue Aktie für zehn alte Aktien beschlossen.

Die Ausgabe der Bonus-Aktien führt zu einer Anpassung der Eurex-Aktien-Futures-Kontrakte auf Aktien der Banco BPI (BPIF, BPIG).

Ex-Tag ist der **17. Mai 2011**.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere.

Eurex Deutschland
Börsenplatz 4
60313 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
customer.support@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Thomas Book, Michael Peters,
Andreas Preuß, Peter Reitz,
Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

Banco BPI: Bonus-Aktien

Maßnahme:
Ausgabe von Bonus-Aktien im Verhältnis eine neue Aktie für zehn alte Aktien.

Letzter Cum-Handelstag:
16. Mai 2011

Ex-Tag:
17. Mai 2011

Einbezogene Produkte:
BPIF, BPIG

Anpassung der ISIN:

Die ISIN der Banco BPI-Aktie (PTBPI0AM0004) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Anzahl Aktien alt	10
Anzahl Aktien neu	11
R-Faktor	0,90909091

2. Anpassung der Kontraktgröße und Variation Margin

Zum Ausgleich der Berechnung der Variation Margin des darauf folgenden Börsentages werden die Settlement-Preise vom letzten Cum-Handelstag mit dem R-Faktor multipliziert.

Die neue Kontraktgröße errechnet sich wie folgt:

Kontraktgröße alt 100 / R-Faktor 0,90909091 = 110.0000 Kontraktgröße neu

Kontraktgröße alt 500 / R-Faktor 0,90909091 = 550.0000 Kontraktgröße neu

Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Cum-Handelstag gelöscht.

Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in OTC Flexible Futures.

Bitte beachten Sie: Momentan sind keine offenen Positionen vorhanden. Eine Anpassung findet nur statt, wenn am letzten Cum Handelstag nach Handelsschluss offene Positionen bestehen.

17. Mai 2011