X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 042/13*

Datum: 15. März 2013
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

DKSH Holding AG: Sonderdividende

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:
keine

Zusammenfassung:

Die Generalversammlung der Gesellschaft DKSH Holding AG wird im April 2013 zusätzlich zu einer ordentlichen Dividende von CHF 0,80 über eine Sonderdividende von CHF 0,15 beschließen.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung der Eurex-Optionen auf Aktien der DKSH Holding AG (DKSH), wie bereits am 12. März 2013 über das Fenster **Market Supervision Messages** bekannt gegeben.

Ex-Tag ist der **18. April 2013**.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere.

eurex

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
memberservices@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

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

ARBN: 101 013 361

DKSH Holding AG: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von CHF 0,15 auf Aktien der Gesellschaft DKSH Holding AG

Letzter Cum-Handelstag:
17. April 2013

Ex-Tag:
18. April 2013

Einbezogenes Produkt:
DKSH

Verweis auf zugrunde liegendes Regelwerk:
Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, Ziffer 2.6.10.1 (2).

Anpassung der ISIN:
Die ISIN der DKSH Holding AG-Aktie (CH0126673539) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der DKSH Holding AG-Aktie an der SIX Swiss Exchange am letzten Cum-Handelstag. Dieser Preis wird zunächst um die ordentliche Dividende reduziert. Der daraus resultierende Preis dient zur Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor).

S1	Schlussauktionspreis der Aktie DKSH Holding AG
S2	S1 minus ordentliche Dividende
S3	S2 minus Sonderdividende
R-Faktor	S3 / S2

2. Anpassung der Basispreise und Kontraktgrößen

Die bestehenden Basispreise werden mit dem R-Faktor multipliziert.

Die Kontraktgröße wird durch den R-Faktor dividiert.

Die Versionsnummer der bestehenden Serien erhöht sich um 1.

Die angepassten Basispreise und Kontraktgrößen werden unmittelbar nach Handelsschluss des letzten Cum-Handelstages über das Fenster **Market Supervision Messages** bekannt gegeben.

Neue Serien mit der Standardkontraktgröße 100 und der Versionsnummer 0 werden mit Wirkung zum Ex-Tag eingeführt.

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

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

3. Ausübungen

Bei Ausübung einer angepassten Serie findet grundsätzlich ein Barausgleich für den nicht ganzzahligen Teil der neuen Kontraktgröße statt.

Bei angepassten Serien ab der Version 2 kann es zu Abweichungen im Lieferprozess kommen. Im Report RPTTA111 (All Active/Inactive Series) sind die Teile der Kontraktgröße dargestellt, für welche bei der Ausübung einer angepassten Serie ein Barausgleich stattfindet.

15. März 2013