X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 136/10*

Datum: Frankfurt, 15. Juli 2010

Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren

Banque Cantonale Vaudoise: Nennwertrückzahlung

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Die Generalversammlung der Gesellschaft Banque Cantonale Vaudoise hat am 29. April 2010 zusätzlich zu der regulären Dividende von CHF 21,00 eine Nennwertrückzahlung von CHF 10,00 beschlossen.

Die Nennwertrückzahlung führt zu einer Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Banque Cantonale Vaudoise (BCVF), wie bereits am 25. Februar 2010 im Fenster **Market Supervision Messages** mitgeteilt.

Ex-Tag ist der **16. Juli 2010**.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere.

Eurex Deutschland
Neue Börsenstraße 1
60487 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

Banque Cantonale Vaudoise: Nennwertrückzahlung

Maßnahme:
Nennwertrückzahlung von CHF 10,00 auf Aktien der Gesellschaft Banque Cantonale Vaudoise

Letzter Cum-Handelstag:
15. Juli 2010

Ex-Tag:
16. Juli 2010

Einbezogene Produkte:
BCVF

Verweis auf zugrunde liegendes Regelwerk:
Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, Ziffer 1.6.7 (2).

Anpassung der ISIN:
Die ISIN der Banque Cantonale Vaudoise-Aktie (CH0015251710) bleibt unverändert.

Prozedere:

Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der Banque Cantonale Vaudoise-Aktie an der SIX Swiss Exchange am 15. Juli 2010.

S1	Schlussauktionspreis der Aktie Banque Cantonale Vaudoise
S2	S1 minus CHF 10,00
R-Faktor	S2/S1

1. 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 neu = Kontraktgröße alt / R-Faktor

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.

Aktuell bestehen keine offenen Positionen im Aktien-Futures-Kontrakt auf Banque Cantonale Vaudoise (BCVF). Eine Anpassung dieses Aktien-Futures-Kontrakts findet nur dann statt, wenn offene Positionen am Ende des Handelstages am 15. Juli 2010 bestehen.

signed: Jürg Spillmann signed: Manfred Weber

Frankfurt, 15. Juli 2010