X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 166/11*

Datum: 24. Juni 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

Fondiaria-Sai: Kapitalerhöhung

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:

Der Vorstand der Fondiaria-Sai hat am 22. Juni 2011 eine Kapitalerhöhung mit Bezugsrecht für die Aktionäre der Fondiaria-Sai im Verhältnis 1:2 bekannt gegeben. Der Bezugspreis für die neuen Aktien beträgt EUR 1,50. Die Bezugsfrist beginnt am 27. Juni 2011.

Durch die Kapitalerhöhung wird eine Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Fondiaria-Sai (SOAH) erforderlich.

Ex-Tag ist der **27. Juni 2011**.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere.

Bitte beachten Sie: Eine Anpassung erfolgt nur, wenn das Bezugsrecht einen positiven Wert hat.

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

Fondiaria-Sai: Kapitalerhöhung

Maßnahme:
Kapitalerhöhung mit Bezugsrecht für die Aktionäre der Fondiaria-Sai

Bezugsverhältnis:
1:2, d.h. eine alte Aktie der Fondiaria-Sai berechtigt zum Bezug von zwei neuen Aktien der Fondiaria-Sai

Bezugspreis:
EUR 1,50

Letzter Cum-Tag:
24. Juni 2011

Ex-Tag:
27. Juni 2011

Beginn der Bezugsfrist:
27. Juni 2011

Einbezogenes Produkt:
SOAH

Verweis auf zugrunde liegendes Regelwerk:
Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, Ziffer 1.6.7 (3).

ISIN:
Die ISIN der Fondiaria-Sai-Aktie (IT0001463071) bleibt unverändert.

Prozedere

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Der offizielle Schlussauktionspreis der Fondiaria-Sai-Aktie an der Borsa Italiana am letzten Cum-Handelstag dient zur Ermittlung des R-Faktors.

Der R-Faktor wird mit acht Dezimalstellen ermittelt und berechnet sich wie folgt:

R = ((Anzahl Aktien alt / Anzahl Aktien neu) * (1 - (Ausgabepreis neue Aktien / Schlussauktionspreis)))
+ (Ausgabepreis neue Aktien / Schlussauktionspreis)

R = ((1 / 3) * (1 - (1,50 / Schlussauktionspreis))) + (1,50 / Schlussauktionspreis)

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 neu = Kontraktgröße alt / R-Faktor

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

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

24. Juni 2011