X-pand into the Future

eurex rundschreiben 162/11

Datum: 17. Juni 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Ebro Foods: Sonderdividende, vierte Zahlung

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 155/10, 226/10, 057/11

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 Ebro Foods hat am 31. Mai 2010 bzw. am 1. Juni 2010 u.a. eine Sonderdividende in Höhe von EUR 0,60 beschlossen. Diese wird in vierteljährlichen Zahlungen von jeweils EUR 0,15 gezahlt. Die Zahltermine sind der 1. Oktober 2010, der 23. Dezember 2010, der 4. April 2011 und der 4. Juli 2011.

Diese vier Zahlungen führen zu den jeweiligen Terminen zu einer Anpassung der jeweils existierenden Eurex-Aktien-Futures-Kontrakte auf Aktien der Ebro Foods.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere für die vierte vierteljährliche Zahlung.

Ex-Tag ist der **4. Juli 2011**.

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

Ebro Foods: Sonderdividende, vierte Zahlung

Maßnahme:
Ausschüttung der vierten vierteljährlichen Sonderzahlung von EUR 0,15 auf Aktien der Gesellschaft Ebro Foods

Letzter Cum-Handelstag:
1. Juli 2011

Ex-Tag:
4. Juli 2011

Einbezogene Produkte:
AZUH

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 Ebro Foods-Aktie (ES0112501012) bleibt unverändert.

Prozedere:

Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der Ebro Foods-Aktie an der Bolsa de Madrid am letzten Cum-Handelstag, dem 1. Juli 2011. Dieser Preis wird zunächst um die reguläre Dividende (EUR 0,104, zweite Interimsdividende) reduziert. Der daraus resultierende Preis dient zur Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor).

S1	Schlussauktionspreis der Aktie Ebro Foods
S2	S1 minus reguläre Dividende EUR 0,104
S3	S2 minus Sonderdividende EUR 0,15
R-Faktor	S3/S2

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.

2. Einführung eines neuen Kontrakts

Es wird ein neuer Kontrakt eingeführt auf Ebro Foods-Aktien mit der Standardkontraktgröße 100 und dem neuen Kürzel AZUI.

Der genaue Einführungszeitpunkt wird über das Fenster **Market Supervision Messages** bekannt gegeben.

Sobald der neue Kontrakt zum Handel zur Verfügung steht und keine Verfallmonate mit offenen Positionen im ursprünglichen Kontrakt auf Ebro Foods-Aktien (AZUH) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden ab dem 4. Juli 2011 im ursprünglichen Kontrakt (AZUH) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

Falls für den ursprünglichen Kontrakt auf Ebro Foods (AZUH) am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts.

17. Juni 2011