X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 263/13*

Datum: 10. Dezember 2013
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

3i Group plc: Sonderdividende

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:
keine

Zusammenfassung:

Die Gesellschaft 3i Group plc hat am 14. November 2013 eine Zwischendividende von 6,70 britischen Pence je Aktie beschlossen. Davon sind gemäß Mitteilung der Gesellschaft 4,00 britische Pence als Sonderdividende anzusehen.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der 3i Group plc (IIIF).

Ex-Tag ist der **11. Dezember 2013**.

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

Geschäftsführung:
Dr. Thomas Book, Mehtap Dinc,
Michael Peters, Andreas Preuß,
Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

3i Group plc: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von 4,00 britischen Pence auf Aktien der Gesellschaft 3i Group plc

Letzter Cum-Handelstag:
10. Dezember 2013

Ex-Tag:
11. Dezember 2013

Einbezogenes Produkt:
IIIF

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

Anpassung der ISIN:
Die ISIN der 3i Group plc-Aktie (GB00B1YW4409) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der 3i Group plc-Aktie an der London Stock Exchange am letzten Cum-Handelstag. Dieser Preis wird zunächst um die reguläre Dividende reduziert. Der daraus resultierende Preis dient zur Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor):

S1	Schlussauktionspreis der Aktie 3i Group plc
S2	S1 minus reguläre Dividende von 2,70 britischen Pence
S3	S2 minus Sonderdividende von 4,00 britischen Pence
R-Faktor	S3 / S2

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.

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

3. Einführung eines neuen Kontrakts

Es wird ein neuer Kontrakt eingeführt auf 3i Group plc-Aktien mit der Standardkontraktgröße 1000 und dem neuen Kürzel IIIG.

Der genaue Einführungszeitpunkt wird in einem separaten Eurex-Rundschreiben bekannt gegeben.

Sobald der neue Kontrakt zum Handel zur Verfügung steht und keine Serien mit offenen Positionen im ursprünglichen Kontrakt auf 3i Group plc-Aktien (IIIF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden im ursprünglichen Kontrakt (IIIF) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

Falls für den ursprünglichen Kontrakt auf 3i Group plc (IIIF) am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts.

10. Dezember 2013