X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 151/12*

Datum: 13. Juli 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Andreas Preuß

Johnson Matthey PLC: Sonderdividende, Zusammenlegung von Aktien, ISIN-Änderung

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 Hauptversammlung der Gesellschaft Johnson Matthey PLC wird am 25. Juli 2012 über eine Sonderdividende in Höhe von pence 100 an ihre Aktionäre sowie eine Aktienzusammenlegung im Verhältnis 21:22 beschliessen. Aufgrund der Aktienzusammenlegung wird sich die ISIN ändern. Weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe auf der Website der Gesellschaft unter www.matthey.com.

Dies hat eine Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Johnson Matthey PLC (JMAF) zur Folge.

Ex-Tag ist der **6. August 2012**.

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

ARBN: 101 013 361

Johnson Matthey PLC: Sonderdividende, Zusammenlegung von Aktien, ISIN-Änderung

Maßnahme:
Sonderdividende von pence 100 sowie Aktienzusammenlegung im Verhältnis 21 neue Aktien der Johnson Matthey PLC für je 22 bestehende Johnson Matthey PLC-Aktien.

Letzter Cum-Handelstag:
3. August 2012

Ex-Tag:
6. August 2012

Einbezogenes Produkt:
JMAF

Regelwerk:
Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, Ziffern 1.6.7 (2) und 1.6.7 (4).

ISIN:
Aufgrund der ISIN-Änderung der Aktie Johnson Matthey PLC wird sich mit Wirkung zum 6. August 2012 die Basiswert-ISIN des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Johnson Matthey PLC (JMAF) ändern. Das Kürzel sowie die Produkt-ISIN bleiben unverändert:

Produkt-kürzel alt/neu	Basiswert-ISIN alt	Basiswert-ISIN neu	Produkt-ISIN alt/neu
JMAF	GB0004764071	GB00B70FPS60	DE000A0SYB60

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der Johnson Matthey PLC-Aktie an der London Stock Exchange am letzten Cum-Handelstag.

Der aus der Aktienzusammenlegung resultierende R-Faktor von 1,04761905 (Anzahl Aktien alt 22 dividiert durch Anzahl Aktien neu 21) fließt wie folgt in die Berechnung ein:

S1	Schlussauktionspreis der Johnson Matthey PLC-Aktie
S2	S1 minus pence 100
R-Faktor	S2/S1 * 1,04761905

2. Anpassung der Kontraktgröße und Variation Margin

Die neue Kontraktgröße errechnet sich wie folgt:

Kontraktgröße neu = Kontraktgröße alt / R-Faktor

Zum Ausgleich der Berechnung der Variation Margin des darauf folgenden Börsentages werden die Settlement-Preise vom letzten Cum-Handelstag mit dem R-Faktor multipliziert.

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 Aktien-Futures-Kontrakt eingeführt auf Johnson Matthey PLC mit der Standard-kontraktgröße 1000 und dem Kürzel JMAG.

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

Sobald der neue Kontrakt zum Handel zur Verfügung steht und keine Verfallmonate mit offenen Positionen im ursprünglichen Kontrakt auf Johnson Matthey PLC (JMAF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden ab dem 6. August 2012 im ursprünglichen Kontrakt (JMAF) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

Falls für den ursprünglichen Kontrakt auf Johnson Matthey PLC-Aktien (JMAF) am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts. Die ISIN-Änderung wird auf jeden Fall vorgenommen.

13. Juli 2012