X-pand into the Future

eurex rundschreiben 269/11

Datum: 7. November 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

MAN SE: Schlussabrechnungspreise

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 114/11, 149/11, 177/11

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

Zielgruppe:

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

Anhang:
Liste der Schlussabrechnungspreise für die Kontrakte der Eurex-Optionen (MAN) und Eurex-Futures (MANG) auf Aktien der MAN SE

Die Gesellschaft Volkswagen AG hat die Übernahme der MAN SE als erfolgreich zustande gekommen erklärt („unconditional“).

Demzufolge werden die bestehenden Positionen in den Serien für die Eurex-Option (MAN) und den Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt (MANG) auf Aktien der MAN SE, wie bereits in den Eurex-Rundschreiben 114/11, 149/11 und 177/11 beschrieben, zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Die Basis für die Bestimmung des fairen Wertes ist der finale Angebotspreis von EUR 95,00.

In der Anlage finden Sie eine Aufstellung dieser theoretisch fairen Werte (Schlussabrechnungspreise) für die entsprechenden Serien der Eurex-Optionskontrakte (MAN) und Eurex-Futures-Kontrakte (MANG) auf Aktien der MAN SE.

Alle Teilnehmer mit offenen Positionen werden am 8. November 2011 ein Fax mit einer Übersicht aller ihrer jeweils offenen Positionen erhalten. Die Buchung des Geldbetrags erfolgt am 8. November 2011 mit Valuta 9. November 2011. Die Positionen werden in der Tagesendverarbeitung vom 9. November 2011 mit Wirkung zum 10. November 2011 ausgebucht.

Für den Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt auf Aktien der MAN SE, Vorzugsaktien - (MA3F), stehen ab dem 8. November 2011 wieder alle verfügbaren Verfallmonate zum Handel zur Verfügung.

eurex

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

Liste der Schlussabrechnungspreise für die Kontrakte der Eurex-Optionen (MAN) und Eurex-Futures (MANG) auf Aktien der MAN SE (MANG)

Kontrakt	Schlussabrechnungspreis
C MAN DEC11 8000	15,20
C MAN DEC11 8400	11,49
C MAN DEC11 8800	8,09
C MAN DEC11 9200	5,35
C MAN DEC11 9600	3,21
C MAN DEC11 10000	1,78
C MAN DEC11 10400	0,94
C MAN DEC11 10800	0,45
C MAN DEC11 11000	0,30
C MAN DEC11 11500	0,11
C MAN DEC11 12000	0,04
C MAN DEC11 12500	0,01
C MAN DEC11 13000	0,01
C MAN MAR12 8000	16,62
C MAN MAR12 9000	9,44
C MAN MAR12 9200	8,36
C MAN MAR12 9600	6,34
C MAN MAR12 10000	4,73
C MAN MAR12 11000	2,11
C MAN MAR12 12000	0,89
C MAN MAR12 13000	0,33
C MAN JUN12 7400	23,01
C MAN JUN12 7600	21,36
C MAN JUN12 7800	19,73
C MAN JUN12 8000	18,26
C MAN JUN12 8200	16,79
C MAN JUN12 8400	15,38
C MAN JUN12 8600	14,09
C MAN JUN12 8800	12,83
C MAN JUN12 9000	11,69
C MAN JUN12 9200	10,62
C MAN JUN12 9400	9,55
C MAN JUN12 9600	8,62
C MAN JUN12 9800	7,82
C MAN JUN12 10000	7
C MAN JUN12 10500	5,32
C MAN JUN12 11000	3,96
C MAN JUN12 11500	2,9
C MAN JUN12 12000	2,16
C MAN JUN12 12500	1,54
C MAN JUN12 13000	1,13
C MAN DEC12 6400	32,38
C MAN DEC12 6800	28,96
C MAN DEC12 7200	25,77
C MAN DEC12 7600	22,71
C MAN DEC12 8000	20,02
C MAN DEC12 8400	17,41

C MAN DEC12 9200	13,11
C MAN DEC12 9600	11,31
C MAN DEC12 10500	8,02
C MAN DEC12 12000	4,42
C MAN JUN13 14000	3,87
C MAN DEC13 6000	37,04
C MAN DEC13 8400	20,88
C MAN DEC13 9200	17,04
C MAN DEC13 10000	13,9
P MAN DEC11 1800	0,01
P MAN DEC11 3600	0,01
P MAN DEC11 4000	0,01
P MAN DEC11 4400	0,01
P MAN DEC11 4800	0,01
P MAN DEC11 5200	0,01
P MAN DEC11 5600	0,01
P MAN DEC11 6000	0,01
P MAN DEC11 6400	0,01
P MAN DEC11 6600	0,01
P MAN DEC11 6800	0,01
P MAN DEC11 7000	0,01
P MAN DEC11 7200	0,01
P MAN DEC11 7600	0,03
P MAN DEC11 8000	0,12
P MAN DEC11 8400	0,4
P MAN DEC11 8800	1,01
P MAN DEC11 9200	2,26
P MAN DEC11 9600	4,12
P MAN DEC11 10400	9,85
P MAN DEC11 11000	15,23
P MAN DEC11 11500	20,06
P MAN MAR12 6400	0,1
P MAN MAR12 6800	0,2
P MAN MAR12 7000	0,28
P MAN MAR12 7200	0,4
P MAN MAR12 7600	0,73
P MAN MAR12 8000	1,29
P MAN MAR12 8400	2,15
P MAN MAR12 8800	3,34
P MAN MAR12 9000	4,07
P MAN MAR12 9200	4,99
P MAN MAR12 9600	6,97
P MAN MAR12 10000	9,36
P MAN JUN12 5800	0,2
P MAN JUN12 6800	0,76
P MAN JUN12 7000	0,95
P MAN JUN12 7200	1,16
P MAN JUN12 7400	1,49
P MAN JUN12 7600	1,83
P MAN JUN12 7800	2,19
P MAN JUN12 8000	2,7
P MAN JUN12 8200	3,23

P MAN JUN12 8400	3,81
P MAN JUN12 8600	4,5
P MAN JUN12 8800	5,23
P MAN JUN12 9000	6,09
P MAN JUN12 9200	7
P MAN JUN12 9400	7,93
P MAN JUN12 9600	9
P MAN JUN12 9800	10,19
P MAN JUN12 10000	11,36
P MAN JUN12 11000	18,32
P MAN JUN12 11500	22,27
P MAN JUN12 13000	35,59
P MAN DEC12 5200	0,43
P MAN DEC12 6000	1,09
P MAN DEC12 6400	1,61
P MAN DEC12 6800	2,3
P MAN DEC12 7200	3,2
P MAN DEC12 7600	4,22
P MAN DEC12 8400	7,03
P MAN DEC12 8800	8,89
P MAN DEC12 9600	13,03
P MAN DEC12 10000	15,47
P MAN DEC12 14000	47,66

MANG DEC11	95,093