X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 188/11*

Datum: 15. Juli 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Parmalat S.p.A.: Schlussabrechnungspreise

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 122/11

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 Gesellschaft Groupe Lactalis S.A. hat die Übernahme der Parmalat S.p.A. als erfolgreich zustande gekommen erklärt („unconditional“).

Demzufolge werden die bestehenden Positionen in den Serien für die Eurex-Option auf Aktien der Parmalat S.p.A. (P4I), wie bereits im Eurex-Rundschreiben 122/11 beschrieben, zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Die Basis für die Bestimmung des fairen Wertes ist der finale Angebotspreis von EUR 2,60.

Der theoretisch faire Wert (Schlussabrechnungspreis) für die entsprechende Serie der Eurex-Option auf Aktien der Parmalat S.p.A. (P4I), in der noch offene Positionen vorhanden sind, ist wie folgt:

P P4I SEP11 200 = 0,0130.

Alle Teilnehmer mit offenen Positionen werden am 15. Juli 2011 ein Fax mit einer Übersicht aller ihrer jeweils offenen Positionen erhalten. Die Buchung des Geldbetrages erfolgt am 15. Juli 2011 mit Valuta 18. Juli 2011. Die Positionen werden in der Tagesendverarbeitung vom 18. Juli 2011 mit Wirkung zum 19. Juli 2011 ausgebucht.

Für den Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt auf Parmalat S.p.A. (P4IG) sind keine Positionen vorhanden.

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