X-pand into the Future

# eurex rundschreiben 229/09

**Datum:** Frankfurt, 4. Dezember 2009
**Empfänger:** Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren

## Atrium European Real Estate Limited: Sonderdividende

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

**Zielgruppe:**

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

**Anhänge:**

Keine

**Zusammenfassung:**

Die Gesellschaft Atrium European Real Estate Limited hat am 1. Dezember 2009 die Zahlung einer Interimsdividende von EUR 0,03 je Aktie sowie die Zahlung einer Sonderdividende von EUR 0,50 je Aktie bekannt gegeben.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung der bestehenden Serien der Eurex-Option auf Aktien der Atrium European Real Estate Limited (ODD) und des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Atrium European Real Estate Limited (ODDF).

Ex-Tag ist der **9. Dezember 2009**.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere.

Eurex Deutschland
Neue Börsenstraße 1
60487 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, Thomas Lenz,
Michael Peters, Andreas Preuß,
Peter Reitz, Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

# Atrium European Real Estate Limited: Sonderdividende

**Maßnahme:**
Ausschüttung einer Sonderdividende von EUR 0,50 auf Aktien der Gesellschaft Atrium European Real Estate Limited

**Letzter Cum-Handelstag:**
8. Dezember 2009

**Ex-Tag:**
9. Dezember 2009

**Einbezogene Produkte:**
ODD/ODDF

**Verweis auf zugrunde liegendes Regelwerk:**
Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, Ziffer 1.6.7 (2) und Ziffer 2.6.10.1 (2).

Die aktualisierten Kontraktspezifikationen werden ab dem Ex-Tag auf der Eurex-Website eingestellt unter dem Pfad:

**www.eurexchange.com > Dokumente > Regelwerke**

**Anpassung der ISIN:**

Die ISIN der Atrium European Real Estate Limited-Aktie (JE00B3DCF752) bleibt unverändert.

## Prozedere:

**Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)**

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der Atrium European Real Estate Limited-Aktie an der Wiener Börse am letzten Cum-Handelstag, dem 8. Dezember 2009:

| | |
|---|---|
| **Schlussauktionspreis der Aktie Atrium** | S1 |
| **S1 minus Interimsdividende** | S2 |
| **S2 minus Sonderdividende** | S3 |
| **R-Faktor** | S3/S2 |

## Optionen

**1. Anpassung der Basispreise und Kontraktgrößen**

Die bestehenden Basispreise werden mit dem R-Faktor multipliziert.

Die Kontraktgröße wird durch den R-Faktor dividiert.

Die Versionsnummer der bestehenden Serien erhöht sich um 1.

Die angepassten Basispreise und Kontraktgrößen werden unmittelbar nach Handelsschluss des letzten Cum-Handelstages über das Fenster **Market Supervision Messages** bekannt gegeben.

Neue Serien mit der Standardkontraktgröße 100 und der Versionsnummer 0 werden mit Wirkung zum Ex-Tag eingeführt.

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

Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Cum-Handelstag gelöscht.

**Falls am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung.**

**2. Ausübungen**

Bei Ausübung einer angepassten Serie findet grundsätzlich ein Barausgleich für den nicht ganzzahligen Teil der neuen Kontraktgröße statt.

Bei angepassten Serien ab der Version 2 kann es zu Abweichungen im Lieferprozess kommen. Im Report RPTTA111 (All Active / Inactive Series) sind die Teile der Kontraktgröße dargestellt, für welche bei der Ausübung einer angepassten Serie ein Barausgleich stattfindet.

## Futures

**1. Anpassung der Kontraktgröße und Variation Margin**

Die Anpassung erfolgt mit demselben R-Faktor wie für die Optionen.

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 Atrium European Real Estate Limited-Aktien mit der Standardkontraktgröße 100 und dem neuen Kürzel ODDG.

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

Sobald der neue Kontrakt zum Handel zur Verfügung steht und keine Serien mit offenen Positionen im ursprünglichen Kontrakt auf Atrium European Real Estate Limited-Aktien (ODDF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

**Falls für den ursprünglichen Kontrakt auf Atrium European Real Estate Limited (ODDF) am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts.**

gez. Thomas Lenz gez. Manfred Weber

Frankfurt, 4. Dezember 2009