X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 099/12*

Datum: 14. Mai 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

conwert Immobilien Invest SE: Zusätzliche Ausschüttung

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 conwert Immobilien Invest SE wird am 31. Mai 2012 zusätzlich zu der regulären Dividende von EUR 0,20 je Aktie über eine zusätzliche Ausschüttung von EUR 0,15 je Aktie beschließen.

Die zusätzliche Ausschüttung führt zu einer Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der conwert Immobilien Invest SE (CORF), wie bereits am 29. März 2012 über das Fenster **Market Supervision Messages** bekannt gegeben.

Ex-Tag ist der **4. Juni 2012**.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere.

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

conwert Immobilien Invest SE: Zusätzliche Ausschüttung

Maßnahme:
Zusätzliche Ausschüttung von EUR 0,15 auf Aktien der Gesellschaft conwert Immobilien Invest SE

Letzter Cum-Handelstag:
1. Juni 2012

Ex-Tag:
4. Juni 2012

Einbezogenes Produkt:
CORF

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 conwert Immobilien Invest SE-Aktie (AT0000697750) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der conwert Immobilien Invest SE-Aktie an der Wiener Börse 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 conwert Immobilien Invest SE
S2	S1 minus reguläre Dividende EUR 0,20
S3	S2 minus zusätzliche Ausschüttung EUR 0,15
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 conwert Immobilien Invest SE-Aktien mit der Standardkontraktgröße 100 und dem neuen Kürzel CORG.

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 conwert Immobilien Invest SE-Aktien (CORF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden ab dem 4. Juni 2012 in diesem Kontrakt (CORF) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

Falls für den ursprünglichen Kontrakt auf conwert Immobilien Invest SE (CORF) am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts.

14. Mai 2012