



eurex rundschriften 124/15

Datum: 8. Juli 2015
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendors
Autorisiert von: Edward Backes

Next PLC: Sonderdividende

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Die Gesellschaft Next PLC hat am 29. April 2015 die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von 60,00 britischen Pence pro Aktie bekannt gegeben.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung der Eurex-Aktien-Futures-Kontrakte auf Aktien der Next PLC (NXTI, NXTJ).

Ex-Tag ist der **9. Juli 2015**.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere.



Next PLC: Sonderdividende

Maßnahme:

Ausschüttung einer Sonderdividende von 60,00 britischen Pence auf Aktien der Gesellschaft Next PLC

Letzter Cum-Handelstag:

8. Juli 2015

Ex-Tag:

9. Juli 2015

Einbezogene Produkte:

NXTI, NXTJ

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 Next PLC-Aktie (GB0032089863) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der Next PLC-Aktie an der London Stock Exchange am letzten Cum-Handelstag, dem 8. Juli 2015. Der daraus resultierende Preis dient zur Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor).

S1	Schlussauktionspreis der Aktie Next PLC
S2	S1 minus reguläre Dividende von 100,00 britischen Pence
S3	S2 minus Sonderdividende von 60,00 britischen Pence
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:

$$\text{Kontraktgröße neu} = \text{Kontraktgröße alt} / \text{R-Faktor}$$

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

Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Futures.

3. Einführung eines neuen Kontrakts

Es wird ein neuer Kontrakt eingeführt auf Next PLC-Aktien mit der Standardkontraktgröße 1000 und dem neuen Kürzel NXTK.

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 in den ursprünglichen Kontrakten auf Next PLC-Aktien (NXTI, NXTJ) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesen Kontrakten ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden in den ursprünglichen Kontrakten (NXTI, NXTJ) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.
Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

8. Juli 2015