X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 237/12*

Datum: 1. November 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Federated Investors Inc.: Sonderdividende

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 Federated Investors Inc. hat am 25. Oktober 2012 u.a. die Ausschüttung einer Sonderdividende von USD 1,51 je Aktie beschlossen. Für weitere Informationen hierzu siehe die Website der Gesellschaft unter www.federatedinvestors.com.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Federated Investors Inc. (FIIF).

Ex-Tag ist der **6. November 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
memberservices@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Dr. Thomas Book, Michael Peters,
Andreas Preuß, Peter Reitz,
Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

Federated Investors Inc.: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von USD 1,51 auf Aktien der Gesellschaft Federated Investors Inc.

Letzter Cum-Handelstag:
5. November 2012

Ex-Tag:
6. November 2012

Einbezogenes Produkt:
FIIF

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 Federated Investors Inc.-Aktie (US3142111034) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Abrechnungspreis der Federated Investors Inc.-Aktie am letzten Cum-Handelstag. Dieser Preis wird zunächst um die reguläre Dividende (USD 0,24) reduziert. Der daraus resultierende Preis dient zur Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor).

S1	**Abrechnungspreis der Aktie Federated Investors Inc.**
S2	S1 minus reguläre Dividende
S3	S2 minus Sonderdividende
R-Faktor	S3 / S2

2. Anpassung der Kontraktgröße und Variation Margin

Zum Ausgleich der Berechnung der Variation Margin des darauffolgenden 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 Federated Investors Inc.-Aktien mit Standardkontraktgröße 100 und dem neuen Kürzel FIIG.

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 Federated Investors Inc. (FIIF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden ab dem 6. November 2012 im ursprünglichen Kontrakt (FIIF) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

Falls für den ursprünglichen Kontrakt auf Federated Investors Inc.-Aktien (FIIF) am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts.

1. November 2012