X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 080/11*

Datum: 18. April 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Corporación Financiera Alba S.A.: 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 Corporación Financiera Alba S.A. hat am 14. April 2011 eine Sonderdividende von EUR 3,00 je Aktie bekannt gegeben.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Corporación Financiera Alba S.A. (CSVG).

Ex-Tag ist der **20. April 2011**.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere.

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

Corporación Financiera Alba S.A.: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von EUR 3,00 auf Aktien der Gesellschaft Corporación Financiera Alba S.A.

Letzter Cum-Handelstag:
19. April 2011

Ex-Tag:
20. April 2011

Einbezogene Produkte:
CSVG

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

Anpassung der ISIN:
Die ISIN der Corporación Financiera Alba S.A.-Aktie (ES0117160111) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der Corporación Financiera Alba S.A.-Aktie an der Bolsa de Madrid am letzten Cum-Handelstag.

S1	Schlussauktionspreis der Corporación Financiera Alba S.A.
S2	S1 minus Sonderdividende
R-Faktor	S2/S1

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 Corporación Financiera Alba S.A.-Aktien mit der Standardkontraktgröße 100 und dem Kürzel CSVH.

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

Sobald der neue Kontrakt zum Handel zur Verfügung steht und keine Verfallmonate mit offenen Positionen im ursprünglichen Kontrakt auf Corporación Financiera Alba S.A.-Aktien (CSVG) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden ab dem 20. April 2011 im ursprünglichen Kontrakt (CSVG) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

Falls für den ursprünglichen Kontrakt auf Corporación Financiera Alba S.A.-Aktien (CSVG) am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts.

18. April 2011