X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 088/11*

Datum: 21. April 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Citigroup Inc.: Zusammenlegung von Aktien, ISIN-Änderung

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:
keine

Zusammenfassung:

Die Hauptversammlung der Gesellschaft Citigroup Inc. hat am 21. April 2011 eine Aktienzusammenlegung im Verhältnis 1:10 beschlossen.

Dies hat eine Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Citigroup Inc. (CITF) zur Folge.

Ex-Tag ist der **9. Mai 2011**.

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

Citigroup Inc.: Zusammenlegung von Aktien, ISIN-Änderung

Maßnahme:
Aktienzusammenlegung im Verhältnis eine neue Aktie der Citigroup Inc. für je zehn bestehende Citigroup Inc.-Aktien

Letzter Cum-Handelstag:
6. Mai 2011

Ex-Tag:
9. Mai 2011

Einbezogenes Produkt:
CITF

Regelwerk:
Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, Ziffer 1.6.7 (4).

ISIN:
Aufgrund der ISIN-Änderung der Aktie Citigroup Inc. wird sich mit Wirkung zum 9. Mai 2011 die Basiswert-ISIN des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Citigroup Inc. (CITF) ändern. Das Kürzel sowie die Produkt-ISIN bleiben unverändert:

Produkt-kürzel alt/neu	Basiswert-ISIN alt	Basiswert-ISIN neu	Produkt-ISIN alt/neu
CITF	US1729671016	US1729674242	DE000A0XWZ18

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Anzahl alte Aktien	10
Anzahl neue Aktien	1
R-Faktor	10.00000000

2. Anpassung der Kontraktgröße und Variation Margin

Die neue Kontraktgröße errechnet sich wie folgt:

Kontraktgröße alt 100 / R-Faktor 10.00000000 = 10.0000 Kontraktgröße neu

Zum Ausgleich der Berechnung der Variation Margin des darauf folgenden Börsentages werden die Settlement-Preise vom letzten Cum-Handelstag mit dem R-Faktor multipliziert.

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 Aktien-Futures-Kontrakt eingeführt auf Citigroup Inc. mit der Standardkontraktgröße 100 und dem Kürzel CITG.

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 Citigroup Inc. (CITF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden ab dem 9. Mai 2011 im ursprünglichen Kontrakt (CITF) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

21. April 2011