X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 074/12*

Datum: 13. April 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Julius Bär-Basket: Sonderdividende in Julius Bär Gruppe AG

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 049/12

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

Zielgruppe:	**Anhänge:**
Ü Front Office/Handel Ü Middle + Backoffice Ü Revision/Security Coordination	keine

Aufgrund der Anpassung wegen der Sonderdividende in Julius Bär Gruppe AG hat sich die Anzahl der Julius Bär Gruppe AG-Aktien im Julius Bär-Basket (BAEB) wie folgt geändert:

1,011377 (alt: 1,000000 dividiert durch R-Faktor 0,98875141)

Ab dem **13. April 2012** besteht der Julius Bär-Basket demzufolge aus 1,011377 Julius Bär Gruppe AG-Aktien sowie 1,000000 GAM Holding AG-Aktien.

Bei Ausübung der Basket-Option ist für einen Kontrakt (50 Aktien) ein Basket bestehend aus nun 50,5689 Julius Bär Gruppe AG-Aktien und unverändert 50 GAM Holding AG-Aktien zu liefern gegen Bezahlung von Kontraktgröße (50) multipliziert mit dem Basispreis. 0,5689 Aktien werden am Ausübungstag mit dem Schlusspreis der Julius Bär Gruppe AG-Aktie an der SIX Swiss Exchange in bar abgerechnet, d.h. automatisch vom ausmachenden Betrag abgezogen:

Lieferung eines Kontrakts = 50 Julius Bär Gruppe AG-Aktien plus 50 GAM Holding AG-Aktien plus 0,5689 Julius Bär Gruppe AG-Aktien (werden automatisch vom ausmachenden Betrag abgezogen)

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

ARBN: 101 013 361