X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 218/11*

Datum: 6. September 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Rhodia S.A.: Schlussabrechnungspreise

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 074/11, 204/11

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:
keine

Die Gesellschaft Solvay S.A. hat die Übernahme der Rhodia S.A. als erfolgreich zustande gekommen („unconditional“) erklärt.

Demzufolge werden die bestehenden Positionen in den Serien für die Eurex-Option auf Aktien der Rhodia S.A. (RHDI), wie bereits im Eurex-Rundschreiben 074/11 beschrieben, zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Die Basis für die Bestimmung des fairen Wertes ist der finale Angebotspreis von EUR 31,60.

Die theoretisch fairen Werte (Schlussabrechnungspreise) für die entsprechenden Serien der Eurex-Option auf Aktien der Rhodia S.A. (RHDI), in denen noch offene Positionen vorhanden sind, sind wie folgt:

C RHDI DEC11 2300 = EUR 8,79	C RHDI DEC11 2400 = EUR 7,85
P RHDI DEC11 2400 = EUR 0,16	C RHDI DEC11 2500 = EUR 6,97

Alle Teilnehmer mit offenen Positionen werden am 7. September 2011 ein Fax mit einer Übersicht aller ihrer jeweils offenen Positionen erhalten. Die Buchung des Geldbetrages erfolgt am 7. September 2011 mit Valuta 8. September 2011. Die Positionen werden in der Tagesendverarbeitung vom 8. September 2011 mit Wirkung zum 9. September 2011 ausgebucht.

Für den Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt auf Rhodia S.A. (RHDG) sind keine Positionen vorhanden.

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