X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 192/14*

Datum: 27. August 2014
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Edward Backes

RTL Group S.A.: Außerordentliche Zwischendividende

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Der Vorstand der Gesellschaft RTL Group S.A. hat die Ausschüttung einer außerordentlichen Zwischendividende in Höhe von EUR 2,00 pro Aktie beschlossen.

Die außerordentliche Zwischendividende führt zu einer Anpassung der Eurex-Optionen (RGS) und des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts (RGSG) auf Aktien der RTL Group S.A.

Ex-Tag ist der **1. September 2014**.

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
memberservices@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Dr. Thomas Book, Mehtap Dinc,
Michael Peters, Andreas Preuß

ARBN: 101 013 361

RTL Group S.A.: Außerordentliche Zwischendividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer außerordentlichen Zwischendividende von EUR 2,00 auf Aktien der Gesellschaft RTL Group S.A.

Letzter Cum-Handelstag:
29. August 2014

Ex-Tag:
1. September 2014

Einbezogene Produkte:
RGS, RGSG

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 RTL Group S.A.-Aktie (LU0061462528) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der RTL Group S.A.-Aktie an der NYSE Euronext Brüssel am letzten Cum-Handelstag.

S1	Schlussauktionspreis der Aktie RTL Group S.A.
S2	S1 minus außerordentliche Zwischendividende
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 Eurex Flexible Futures.

3. Einführung eines neuen Kontrakts

Es wird ein neuer Eurex Aktien-Futures-Kontrakt eingeführt auf RTL Group S.A.-Aktien mit der Standardkontraktgröße 100 und dem neuen Kürzel RGSH.

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 RTL Group S.A.-Aktien (RGSG) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden im ursprünglichen Kontrakt (RGSG) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

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

27. August 2014