X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 101/12*

Datum: 14. Mai 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Sixt AG: Bonusdividende

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:

Keine

Zusammenfassung:

Die Hauptversammlung der Gesellschaft Sixt AG wird am 6. Juni 2012 u.a. über eine Dividende von EUR 0.75 je Stammaktie beschließen. Darin sind EUR 0,15 Bonusdividende enthalten.

Die Bonusdividende führt zu einer Anpassung der Eurex-Option auf Aktien der Sixt AG (SIX2) wie bereits am 15. März 2012 über das Fenster **Market Supervision Messages** bekannt gegeben.

Ex-Tag ist der **7. Juni 2012**.

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

ARBN: 101 013 361

Sixt AG: Bonusdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Bonusdividende von EUR 0,15 auf Aktien der Gesellschaft Sixt AG

Letzter Cum-Handelstag:
6. Juni 2012

Ex-Tag:
7. Juni 2012

Einbezogenes Produkt:
SIX2

Verweis auf zugrunde liegendes Regelwerk:
Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, Ziffer 2.6.10.1 (2).

Anpassung der ISIN:
Die ISIN der Sixt AG-Aktie (DE0007231326) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Ermittlung dient der Schlussauktionspreis der Sixt AG-Aktie im Handelssystem Xetra® am letzten Cum-Handelstag. Dieser Preis wird zunächst um die reguläre Dividende reduziert. Der daraus resultierende Preis dient zur Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor).

S1	Schlussauktionspreis der Aktie Sixt AG
S2	S1 minus reguläre Dividende EUR 0,60
S3	S2 minus Bonusdividende EUR 0,15
R-Faktor	S3 / S2

2. Anpassung der Basispreise und Kontraktgrößen

Die bestehenden Basispreise werden mit dem R-Faktor multipliziert.

Die Kontraktgröße wird durch den R-Faktor dividiert.

Die Versionsnummer der bestehenden Serien erhöht sich um 1.

Die angepassten Basispreise und Kontraktgrößen werden unmittelbar nach Handelsschluss des letzten Cum-Handelstages über das Fenster **Market Supervision Messages** bekannt gegeben.

Neue Serien mit der Standardkontraktgröße 100 und der Versionsnummer 0 werden mit Wirkung zum Ex-Tag eingeführt.

Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Cum-Handelstag gelöscht.

Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in OTC Flexible Options.

3. Ausübungen

Bei Ausübung einer angepassten Serie findet grundsätzlich ein Barausgleich für den nicht ganzzahligen Teil der neuen Kontraktgröße statt.

Bei angepassten Serien ab der Version 2 kann es zu Abweichungen im Lieferprozess kommen. Im Report RPTTA111 (All Active/Inactive Series) sind die Teile der Kontraktgröße dargestellt, für welche bei der Ausübung einer angepassten Serie ein Barausgleich stattfindet.

14. Mai 2012