X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 222/15*

Datum: 17 Dezember 2015
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Edward Backes

Ebro Food SA: Sonderdividende

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:
keine

Zusammenfassung:

Die Gesellschaft Ebro Foods SA hat die Zahlung einer Sonderdividende in Höhe von EUR 0,15 je Aktie beschlossen.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts (AZUL) auf Aktien der Ebro Foods SA.

Ex-Tag ist der **22. Dezember 2015**.

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

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

ARBN: 101 013 361

Ebro Foods SA: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von EUR 0,15 auf Aktien der Gesellschaft Ebro Foods SA

Letzter Cum-Handelstag:
21. Dezember 2015

Ex-Tag:
22. Dezember 2015

Einbezogenes Produkt:
AZUL

Verweis auf zugrunde liegendes Regelwerk:
Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, Ziffer 1.6.7 (2) und Ziffer 2.6.10.1 (2)

Anpassung der ISIN:
Die ISIN der Ebro Food-Aktie (ES0112501012) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)
Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der Ebro Foods-Aktie an der Bolsa de Madrid am letzten Cum-Handelstag.

S1	Schlussauktionspreis der Aktie Ebro Foods
S2	S1 minus reguläre Dividende
R-Faktor	S2 / S1

2. Anpassung der Kontraktgröße und Variation Margin

Zum Ausgleich der Berechnung der Variation Margin des darauffolgenden 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 TES Flexible Futures.

3. Einführung eines neuen Kontrakts

Es wird ein neuer Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt eingeführt auf Ebro Foods-Aktien mit Standardkontraktgröße 100 und dem neuen Kürzel AZUM.

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 Ebro Foods-Aktien (AZUL) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden im ursprünglichen Kontrakt auf Ebro Foods-Aktien (AZUL) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

Falls für den ursprünglichen Kontrakt auf Ebro Foods-Aktien (AZUL) am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts.

17. Dezember 2015