X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 138/14*

Datum: 24. Juni 2014
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Edward Backes

Kingfisher PLC: Sonderdividende

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:

Die Gesellschaft Kingfisher PLC hat am 29. Mai 2014 die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von 4,20 britischen Pence bekannt gegeben.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Kingfisher PLC (KGFF).

Ex-Tag ist der **25. Juni 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

Kingfisher PLC: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von 4,20 britischen Pence auf Aktien der Gesellschaft Kingfisher PLC

Letzter Cum-Handelstag:
24. Juni 2014

Ex-Tag:
25. Juni 2014

Einbezogenes Produkt:
KGFF

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 Kingfisher PLC-Aktie (GB0033195214) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der Kingfisher PLC-Aktie an der London Stock Exchange am letzten Cum-Handelstag. Der daraus resultierende Preis dient zur Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor).

S1	Schlussauktionspreis der Aktie Kingfisher PLC
S2	S1 minus Sonderdividende 4,20 britische Pence
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 OTC Flexible Futures.

2. Einführung eines neuen Kontrakts

Es wird ein neuer Kontrakt eingeführt auf Kingfisher PLC-Aktien mit der Standardkontraktgröße 1000 und dem Kürzel KGFG.

Der genaue Einführungszeitpunkt wird in einem separaten Eurex-Rundschreiben bekannt gegeben.

Sobald der neue Kontrakt zum Handel zur Verfügung steht und keine Serien mit offenen Positionen im ursprünglichen Kontrakt auf Kingfisher PLC-Aktien (KGFF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

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

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

24. Juni 2014