X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 069/14*

Datum: 15. April 2014
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Gottfried Schmaltz

DKSH: 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 Generalversammlung der Gesellschaft DKSH wird am 15. April 2014 u.a. neben einer regulären Dividende von CHF 0,95 über eine zusätzliche Sonderdividende von CHF 0,15 beschließen.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung der Eurex-Option (DKSH) auf Aktien der DKSH.

Ex-Tag ist der **17. April 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

DKSH: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von CHF 0,15 auf Aktien der Gesellschaft DKSH

Letzter Cum-Handelstag:
16. April 2014

Ex-Tag:
17. April 2014

Einbezogenes Produkt:
DKSH

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 DKSH-Aktie (CH0126673539) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der DKSH-Aktie an der SIX Swiss Exchange am letzten Cum-Handelstag. Dieser Preis wird zunächst um die reguläre Dividende (CHF 0,95) reduziert. Der daraus resultierende Preis dient zur Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor).

S1	Schlussauktionspreis der Aktie DKSH
S2	S1 minus reguläre Dividende CHF 0,95
S3	S2 minus Sonderdividende CHF 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.

2. 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.

15. April 2014