X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 006/14*

Datum: 7. Januar 2014
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Edward Backes

Cermaq ASA: 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 Hauptversammlung der Gesellschaft Cermaq ASA wird am 7. Januar 2014 u.a. über die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von NOK 51,00 beschließen. Die Sonderdividende hat eine Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Cermaq ASA (CEQF) zur Folge.

Ex-Tag ist der **8. Januar 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

Cermaq ASA: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von NOK 51,00 auf Aktien der Gesellschaft Cermaq ASA

Letzter Cum-Handelstag:
7. Januar 2014

Ex-Tag:
8. Januar 2014

Einbezogenes Produkt:
CEQF

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

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der Cermaq ASA-Aktie an der Oslo Børs ASA umgerechnet in Euro mit dem offiziellen Referenzkurs der EZB am letzten Cum-Handelstag, dem 7. Januar 2014. Der daraus resultierende Preis dient zur Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor).

S1	Schlussauktionspreis der Aktie Cermaq ASA*
S2	S1 minus Sonderdividende*
R-Faktor	S2 / S1

* umgerechnet in Euro mit dem offiziellen Referenzkurs der EZB am 7. Januar 2014

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.

3. Einführung eines neuen Kontrakts

Es wird ein neuer Kontrakt eingeführt auf Cermaq ASA-Aktien mit der Standardkontraktgröße 100 und dem neuen Kürzel CEQG.

Der genaue Einführungszeitpunkt wird über das Fenster **Market Supervision Messages** bekannt gegeben.

Sobald der neue Kontrakt zum Handel zur Verfügung steht und keine Verfallmonate mit offenen Positionen im ursprünglichen Kontrakt auf Cermaq ASA-Aktien (CEQF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden ab dem 8. Januar 2014 keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

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

7. Januar 2014