X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 260/12*

Datum: 30. November 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Michael Peters

Carnival Corporation: 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 Carnival Corporation hat am 16. November 2012 die Ausschüttung einer Sonderdividende von USD 0,50 beschlossen.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Carnival Corporation (CVCF).

Ex-Tag ist der **5. Dezember 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:
Dr. Thomas Book, Michael Peters,
Andreas Preuß, Peter Reitz,
Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

Carnival Corporation: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von USD 0,50 auf Aktien der Gesellschaft Carnival Corporation

Letzter Cum-Handelstag:
4. Dezember 2012

Ex-Tag:
5. Dezember 2012

Einbezogenes Produkt:
CVCF

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 Carnival Corporation-Aktie (PA1436583006) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Abrechnungspreis der Carnival Corporation-Aktie am letzten Cum-Handelstag.

S1	Abrechnungspreis der Aktie Carnival Corporation
S2	S1 minus Sonderdividende
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.

3. Einführung eines neuen Kontrakts

Es wird ein neuer Kontrakt eingeführt auf Carnival Corporation-Aktien mit der Standardkontraktgröße 100 und dem neuen Kürzel CVCG.

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 Carnival Corporation-Aktien (CVCF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden ab dem 5. Dezember 2012 im ursprünglichen Kontrakt (CVCF) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

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

30. November 2012