X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 263/12*

Datum: 3. Dezember 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Costco Wholesale 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 Costco Wholesale Corporation hat am 28. November 2012 die Ausschüttung einer Sonderdividende von USD 7,00 je Aktie bekanntgegeben.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Costco Wholesale Corporation (COSF).

Ex-Tag ist der **6. 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

Costco Wholesale Corporation: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von USD 7,00 auf Aktien der Gesellschaft Costco Wholesale Corporation

Letzter Cum-Handelstag:
5. Dezember 2012

Ex-Tag:
6. Dezember 2012

Einbezogenes Produkt:
COSF

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 Costco Wholesale Corporation-Aktie (US22160K1051) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

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

S1	Abrechnungspreis der Aktie Costco Wholesale 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 Costco Wholesale Corporation-Aktien mit der Standardkontraktgröße 100 und dem neuen Kürzel COSG.

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 Costco Wholesale Corporation-Aktien (COSF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Ferner werden ab dem 6. Dezember 2012 im ursprünglichen Kontrakt (COSF) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt. Bestehende Verfallmonate ohne offene Positionen werden vom Handel ausgesetzt.

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

3. Dezember 2012