X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 008/16*

Datum: 13. Januar 2016
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Edward Backes

Next PLC: Sonderdividende

Kontakt: Derivatives Trading Operations, T +49-69-211-1 12 10

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- Revision/Security Coordination

Anhänge:
keine

Zusammenfassung:

Die Gesellschaft Next PLC hat die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von 60 britischen Pence pro Aktie bekannt gegeben.

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

Ex-Tag ist der **14. Januar 2016**.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere.

eurex

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

ARBN: 101 013 361

Next PLC: Sonderdividende

Maßnahme:
Ausschüttung einer Sonderdividende von 60 britischen Pence auf Aktien der Gesellschaft Next PLC

Letzter Cum-Handelstag:
13. Januar 2016

Ex-Tag:
14. Januar 2016

Einbezogenes Produkt:
NXTJ

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 Next PLC-Aktie (GB0032089863) bleibt unverändert.

Prozedere:

1. Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Als Basis für die Anpassung dient der Schlussauktionspreis der Next 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 Next PLC
S2	S1 minus Sonderdividende von 60 britischen 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 TES Flexible Futures.

3. Einführung eines neuen Kontrakts

Es wird ein neuer Kontrakt eingeführt auf Next PLC-Aktien mit der Standardkontraktgröße 1000 und dem neuen Kürzel NXTK.

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 Next PLC-Aktien (NXTJ) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

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

13. Januar 2016