



e u r e x *rundschreiben 221/09*

Datum: Frankfurt, 24. November 2009

Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren

Lloyds Banking Group: Kapitalerhöhung

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Die außerordentliche Hauptversammlung der Gesellschaft Lloyds Banking Group wird am 26. November 2009 über eine Kapitalerhöhung mit Bezugsrecht für die Aktionäre von Lloyds Banking Group im Verhältnis 50:67 zu 37 Pence beschließen. Die Bezugsfrist beginnt am 27. November 2009.

Durch die Kapitalerhöhung wird eine Anpassung des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Lloyds Banking Group (LLOF) erforderlich.

Ex-Tag ist der **27. November 2009**.

Dieses Rundschreiben enthält eine Beschreibung des Anpassungsprozedere.



Lloyds Banking Group: Kapitalerhöhung

Maßnahme:

Kapitalerhöhung mit Bezugsrecht für die Aktionäre der Lloyds Banking Group

Bezugsverhältnis: 50:67

d.h. fünfzig alte Aktien der Lloyds Banking Group berechtigen zum Bezug von siebenundsechzig neuen Aktien der Lloyds Banking Group

Bezugspreis:

37 Pence

Letzter Cum-Tag:

26. November 2009

Ex-Tag:

27. November 2009

Beginn der Bezugsfrist:

27. November 2009

Einbezogene Produkte:

LLOF

Verweis auf zugrunde liegendes Regelwerk:

Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, Ziffer 1.6.7 (3)

Die aktualisierten Kontraktspezifikationen werden ab dem Ex-Tag auf der Eurex-Website eingestellt unter dem Pfad:

www.eurexchange.com > Dokumente > Regelwerke

ISIN:

Die ISIN der Lloyds Banking Group-Aktie (GB0008706128) bleibt unverändert.

Prozedere

Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Der offizielle Schlussauktionspreis der Aktie Lloyds Banking Group an der London Stock Exchange am 26. November 2009 dient zur Ermittlung des R-Faktors:

Der R-Faktor wird mit acht Dezimalstellen ermittelt und berechnet sich wie folgt:

$$R = ((\text{Anzahl Aktien alt} / \text{Anzahl Aktien neu}) * (1 - (\text{Ausgabepreis neue Aktien} / \text{Schlussauktionspreis}))) + (\text{Ausgabepreis neue Aktien} / \text{Schlussauktionspreis})$$

$$R = ((50 / 117) * (1 - (37 / \text{Schlussauktionspreis}))) + (37 / \text{Schlussauktionspreis})$$

1. 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:

$$\text{Kontraktgröße neu} = \text{Kontraktgröße alt} / R\text{-Faktor}$$

Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Cum-Handelstag gelöscht.

2. Einführung eines neuen Kontrakts

Es wird ein neuer Kontrakt eingeführt auf Lloyds Banking Group mit Standardkontraktgröße 1000 und dem neuen Kürzel LLOG.

Am 24. November 2009 wird der neue Kontrakt LLOG mit der Produkt-ISIN DE000A1CQ976 im Eurex[®]-System aufgesetzt. Der Handel beginnt am 30. November 2009.

Sobald der neue Kontrakt zum Handel zur Verfügung steht und keine Serien mit offenen Positionen im ursprünglichen Kontrakt auf Lloyds Banking Group (LLOF) mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

gez. Thomas Lenz

gez. Manfred Weber

Frankfurt, 24. November 2009