

Kapitalmaßnahmeinformation 003

Ausstellungsdatum: 26. November 2024
Wirksamkeitsdatum: 26. November 2024
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Encavis AG
ISIN	DE000A4BGGQ8
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7(7), 1.13.8 (7), 1.26.11 (6), 1.27.8 (7), 2.6.10 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	ECV
Futures-Kontrakt auf Aktien	ECVF
Equity Total Return Future	
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

In einer Mitteilung vom 25 November 2024 wurde bekannt gegeben, dass die Übernahmekonditionen erfüllt sind. Daher werden gemäß den Kontraktspezifikationen der Eurex Deutschland und wie bereits in der Kapitalmaßnahmeinformation 001 beschrieben, bestehende Positionen in den Futures- und Optionskontrakten zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Basis für die Berechnung der fairen Werte ist der Angebotspreis in Höhe von EUR 17,50.

Die Schlussabrechnungspreise für die Futures- und Optionskontrakte mit offenen Positionen finden sich in der unten aufgeführten Tabelle.

Das Clearing System wird für alle offenen Positionen in dem betroffenen Produkt automatisch Closing Transaktionen generieren. Die Closing Transaktion wird zum Fairen Wert (FW) gebucht, welcher am 26.11.2024 als Settlement Preis eingegeben wird. Die entsprechenden Cash Transaktionen (basierend auf dem Fairen Wert) werden generiert und werden als normale Prämie gezahlt bzw. gutgeschrieben (224/226) oder als Variation Margin gezahlt bzw. gutgeschrieben (235/236).

Die resultierenden Cash Balances werden am 26.11.2024 gebucht, mit Wertstellung 27.11.2024. Alle Positionen werden an 26.11.2024 geschlossen. Die Closing Transaktionen (CB012 Account Statement) und die entsprechenden Cash Beträge (CD710 Daily Cash Account CM) werden automatisch in die Reports integriert. Der Handel in den oben genannten Kontrakten ist bereits eingestellt.

Schlussabrechnungspreise für die Futures- und Optionskontrakte mit offenen Positionen:

Zugrundeliegender Angebotspreis als Referenzpreis: EUR 17,50

Kontrakt	Schlussabrechnungspreis
ECV 20DEC2024 PUT 6 0	0,01
ECV 20DEC2024 PUT 7,2 0	0,01
ECV 20DEC2024 CALL 8 0	9,52
ECV 20DEC2024 PUT 8 0	0,01
ECV 20DEC2024 PUT 9 0	0,01
ECV 20DEC2024 PUT 10 0	0,01
ECV 20DEC2024 PUT 11 0	0,01
ECV 20DEC2024 CALL 12 0	5,53
ECV 20DEC2024 PUT 12 0	0,01
ECV 20DEC2024 CALL 14 0	3,54
ECV 20DEC2024 CALL 15 0	2,57
ECV 20DEC2024 CALL 16 0	1,68
ECV 20DEC2024 CALL 17 0	0,97
ECV 20DEC2024 PUT 17 0	0,43
ECV 20DEC2024 CALL 18 0	0,49
ECV 20DEC2024 CALL 19 0	0,22
ECV 20DEC2024 CALL 28 0	0,01
ECV 20JUN2025 PUT 12 0	0,17
ECV 20JUN2025 PUT 14 0	0,45
ECV 20JUN2025 CALL 16 0	2,78
ECV 20JUN2025 PUT 16 0	1,01
ECV 20JUN2025 CALL 18 0	1,72
ECV 20JUN2025 CALL 20 0	0,99
ECV 19DEC2025 PUT 7,2 0	0,1
ECV 19DEC2025 PUT 10 0	0,29
ECV 19DEC2025 PUT 12 0	0,55
ECV 19DEC2025 CALL 14 0	4,88
ECV 19DEC2025 PUT 15,5 0	1,46
ECV 19DEC2025 CALL 18 0	2,56

Kein Open Interest in Futures-Kontrakten auf Aktien (ECVF).