

Kapitalmaßnahmeinformation 001

Ausstellungsdatum: 12. Dezember 2024
Wirksamkeitsdatum: Wird noch bekannt gegeben
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Compugroup Medical SE
ISIN	DE000A288904
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	COG
Futures-Kontrakt auf Aktien	COGF
Equity Total Return Future	-
Stock Tracking Future	-
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	-

Die Unternehmen Compugroup Medical SE und CVC Capital Partners Plc haben in einer gemeinsamen Pressemitteilung am 9. Dezember 2024 bekannt gegeben, dass CVC Capital Partners Plc beabsichtigt, den Aktionären der Compugroup Medical SE ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre der Compugroup Medical SE EUR 22,00 in bar für jede Stammaktie erhalten. Für weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe die Website der Gesellschaft.

Nachfolgend möchten wir Sie über die potenziellen Auswirkungen dieser Transaktion auf die oben aufgeführten Kontrakte informieren.

Prozedere

Fair Value Methode

Die Eurex-Optionen, der Eurex Aktien-Futures-Kontrakt, sowie der Eurex Aktiendividenden-Future auf Compugroup Medical SE werden zum theoretisch fairen Wert abgerechnet, sofern die Voraussetzungen in den Kontrakt-spezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer 1.6.7 (7) für Eurex Aktien-Futures-Kontrakte und Ziffer 2.6.10.1 (7) für Eurex Options-Kontrakte, erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in Compugroup Medical SE -Kontrakten unverändert fortgeführt. Für die Berechnung des theoretischen fairen Wertes werden folgende Parameter festgelegt:

Option

Implizite Volatilität

Für jede Serie wird eine implizite Volatilität festgelegt. Diese bestimmt sich nach dem Durchschnitt der impliziten Volatilität der täglichen Settlement-Preise, die an den zehn Börsentagen, die der Ankündigung des Angebots vorausgingen (25. November 2024 bis 6. Dezember 2024), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet.

Verfallsjahr	Verfallsmonat	Basispreis	Implizite Volatilität
2025	2	15	50,02
2025	2	15,5	49,45
2025	2	16	49,01
2025	2	16,5	48,67
2025	2	17	48,39
2025	2	17,5	48,11
2025	2	18	47,84
2025	2	18,5	47,53
2025	2	19	47,28
2025	2	19,5	47,05
2025	2	20	46,50
2025	2	21	46,27
2025	2	22	46,37
2025	3	12	54,43
2025	3	13	51,88
2025	3	14	49,83
2025	3	15	48,28
2025	3	16	47,22
2025	3	17	46,66
2025	3	18	46,39
2025	3	19	46,32
2025	3	20	46,41
2025	3	22	46,96
2025	3	24	47,88

2025	3	26	48,30
2025	3	28	49,24
2025	3	30	49,37
2025	3	36	49,43
2025	6	12	47,34
2025	6	13	45,44
2025	6	14	43,97
2025	6	15	42,94
2025	6	16	42,32
2025	6	17	42,06
2025	6	18	42,03
2025	6	19	42,18
2025	6	20	42,46
2025	6	22	43,28
2025	6	24	44,29
2025	6	26	45,37
2025	6	28	46,44
2025	6	30	47,45
2025	6	32	48,38
2025	9	17	40,33
2025	9	18	39,97
2025	9	19	39,74
2025	9	20	39,60
2025	9	22	39,57
2025	9	24	39,74
2025	12	10	45,40
2025	12	12	41,47
2025	12	14	38,73
2025	12	16	36,97
2025	12	18	36,00
2025	12	20	35,60
2025	12	24	35,76
2025	12	28	36,55
2025	12	32	37,57
2025	12	36	38,63
2026	6	28	36,04
2026	6	32	36,71
2026	6	36	37,46
2026	6	40	38,22
2026	12	44	37,84
2026	12	48	38,40
2026	12	52	38,94

Option und Single Stock Future

Zinssatz und Dividende

Bei der Ermittlung des fairen Wertes werden implizite Zinssätze zugrunde gelegt. Folgende Dividendendaten werden bei der Bestimmung der impliziten Volatilität verwendet und bei der Festlegung der fairen Werte zugrunde gelegt, sofern der Abrechnungstag der Kontrakte vor dem Ex-Tag liegt:

Dividendenbetrag in Euro	Ex-Tag
0,6647	15-Mai-2025
0,4500	21-Mai-2026

Mit sofortiger Wirkung werden für die Eurex-Optionen, den Eurex Future auf Compugroup Medical SE in der Regel keine neuen Serien mehr eingeführt. Serien ohne offene Positionen werden gelöscht.

Über den weiteren Ablauf werden wir Sie informieren, sofern Änderungen bzw. neue Informationen im Verlauf der Transaktion dies erforderlich machen.