



Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 01. August 2019
Wirksamkeitsdatum: Wird noch bekanntgegeben
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Cobham PLC
ISIN	GB00B07KD360
Regelwerk	Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7(7), 1.13.8 (7), 2.6.10 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	
Futures-Kontrakt auf Aktien	COBF
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

Die Unternehmen Cobham PLC und Bidco haben in einer gemeinsamen Pressemitteilung am 25. Juli 2019 bekannt gegeben, dass Bidco beabsichtigt, den Aktionären der Cobham PLC ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre der Cobham PLC GBp 165,00 in bar für jede Stammaktie erhalten. Für weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe die Website der Gesellschaft unter www.cobhaminvestors.com.

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



Prozedere

Fair Value Methode

Der Eurex Aktien-Futures-Kontrakt auf Cobham PLC wird 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, 1.14.8 (7) für Eurex Aktiendividenden-Future-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 Cobham PLC Kontrakten unverändert fortgeführt. Für die Berechnung des theoretischen fairen Wertes werden folgende Parameter festgelegt:

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 GBp	Ex-Tag
0,400	10.10.2019
1,000	30.02.2020
0,400	08.10.2020
1,000	29.04.2021
0,400	07.10.2021

Mit sofortiger Wirkung werden für den Eurex Future auf Cobham PLC 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.