



Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 23. Mai 2016
Wirksamkeitsdatum: Wird noch bekannt gegeben
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Aixtron SE
ISIN	DE000A0WMPJ6
Regelwerk	Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, Ziffer(n) 1.6.7(7), 1.14.8 (7), 2.6.10 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	AIX
Futures-Kontrakt auf Aktien	AIXF
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

Das Unternehmen Aixtron SE hat in einer Ad-hoc Mitteilung am 23. Mai 2016 bekannt gegeben, dass Grand Chip Investment GmbH beabsichtigt, den Aktionären der Aixtron SE ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre der Aixtron SE EUR 6,00 in bar für jede Stammaktie erhalten. Für weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe die Website der Gesellschaft unter www.aixtron.com.

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



Prozedere

Fair Value Methode

Die Eurex-Optionen und der Eurex Aktien-Futures-Kontrakt auf Aixtron SE werden zum theoretisch fairen Wert abgerechnet, sofern die Voraussetzungen in den Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, 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 Aixtron 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 (09. Mai 2016 bis 20. Mai 2016), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet.

Option und Single Stock Future

Zinssatz und Dividende

Bei der Ermittlung des fairen Wertes werden implizite Zinssätze zugrunde gelegt. Als Dividende wurde bei der Bestimmung der impliziten Volatilität ein Wert von EUR 0,00 verwendet. Mit sofortiger Wirkung werden für die Eurex-Optionen und den Eurex Future auf Aixtron 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.

Zusätzlich aufgeführte Strikes

Verfalljahr	Verfallmonat	Basispreis	implizite Volatilität
2016	Juni	540	78,75
2016	Juni	560	78,75
2017	März	640	61,97
2017	Juni	680	59,85

Verfalljahr	Verfallmonat	Basispreis	implizite Volatilität
2016	Juni	220	84,87
2016	Juni	240	84,87
2016	Juni	260	84,87
2016	Juni	280	84,87
2016	Juni	300	84,87
2016	Juni	320	84,87
2016	Juni	330	84,87
2016	Juni	340	84,87
2016	Juni	350	83,69
2016	Juni	360	82,98

2016	Juni	370	82,96
2016	Juni	380	82,54
2016	Juni	390	82,51
2016	Juni	400	82,62
2016	Juni	420	83,16
2016	Juni	440	83,67
2016	Juni	460	84,55
2016	Juni	480	85,26
2016	Juni	500	85,79
2016	Juni	520	85,99
2016	Juni	540	85,99
2016	Juni	560	85,99
2016	Juni	600	85,99
2016	Juni	640	85,99
2016	Juni	680	85,99
2016	Juni	720	85,99
2016	Juni	760	85,99
2016	Juni	800	85,99
2016	Juni	900	85,99
2016	Juni	1000	85,99
2016	Juni	1100	85,99
2016	Juni	1200	85,99
2016	Juni	1800	85,99
2016	Juli	360	77,90
2016	Juli	370	77,90
2016	Juli	380	77,90
2016	Juli	390	77,90
2016	Juli	400	77,90
2016	Juli	420	77,90
2016	Juli	440	77,90
2016	Juli	460	78,06
2016	Juli	480	78,36
2016	Juli	500	78,60
2016	Juli	520	78,75
2016	Juli	540	78,75
2016	Juli	560	78,75
2016	August	400	75,06
2016	August	420	75,00
2016	August	440	74,96
2016	August	460	75,05
2016	August	480	75,17
2016	August	500	75,25
2016	August	520	75,33
2016	August	540	75,33
2016	August	560	75,33

2016	September	260	75,01
2016	September	300	73,57
2016	September	320	73,48
2016	September	340	72,86
2016	September	360	72,75
2016	September	380	72,46
2016	September	400	72,21
2016	September	440	72,03
2016	September	480	71,99
2016	September	520	71,91
2016	September	560	71,56
2016	September	600	71,33
2016	September	640	70,67
2016	September	680	69,84
2016	September	720	68,07
2016	September	760	68,07
2016	September	900	68,07
2016	Dezember	240	69,32
2016	Dezember	260	69,16
2016	Dezember	280	68,72
2016	Dezember	300	68,54
2016	Dezember	320	67,96
2016	Dezember	340	67,60
2016	Dezember	360	67,56
2016	Dezember	380	66,92
2016	Dezember	400	66,86
2016	Dezember	440	66,19
2016	Dezember	480	66,18
2016	Dezember	520	65,62
2016	Dezember	560	65,65
2016	Dezember	600	65,19
2016	Dezember	640	65,10
2016	Dezember	720	65,10
2016	Dezember	800	65,10
2016	Dezember	1000	65,10
2016	Dezember	1200	65,10
2016	Dezember	1400	65,10
2016	Dezember	1600	65,10
2017	März	320	65,40
2017	März	340	65,33
2017	März	360	64,78
2017	März	380	64,09
2017	März	400	63,94
2017	März	440	63,18
2017	März	480	63,05

2017	März	520	62,32
2017	März	560	62,40
2017	März	600	61,97
2017	März	640	61,97
2017	Juni	240	66,39
2017	Juni	280	65,49
2017	Juni	320	64,37
2017	Juni	360	63,59
2017	Juni	400	63,08
2017	Juni	480	61,97
2017	Juni	560	61,01
2017	Juni	640	60,23
2017	Juni	680	59,85
2017	Juni	720	59,46
2017	Dezember	240	64,62
2017	Dezember	280	63,91
2017	Dezember	320	63,36
2017	Dezember	360	62,50
2017	Dezember	400	62,10
2017	Dezember	480	60,96
2017	Dezember	560	60,03
2017	Dezember	640	59,43
2017	Dezember	720	58,27
2017	Dezember	800	56,94
2018	Juni	280	62,72
2018	Juni	320	62,41
2018	Juni	360	61,49
2018	Juni	400	61,19
2018	Juni	480	60,02
2018	Juni	560	59,20
2018	Juni	640	58,34
2018	Dezember	280	61,68
2018	Dezember	320	61,37
2018	Dezember	360	60,52
2018	Dezember	400	60,23
2018	Dezember	480	59,00
2018	Dezember	560	58,29
2018	Dezember	640	57,12
2018	Dezember	800	54,60
2019	Dezember	280	59,83
2019	Dezember	320	59,37
2019	Dezember	360	58,63
2019	Dezember	400	58,39
2019	Dezember	480	57,10
2019	Dezember	560	56,34

2019	Dezember	640	54,92
------	----------	-----	-------