



eurex rundschreiben 183/15

Datum: 14. Oktober 2015
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Edward Backes

Pirelli & C. SpA: Pflichtangebot von Marco Polo Industrial Holding SpA

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

Zielgruppe:

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

Anhang:

Theoretisch faire Werte (Schlussabrechnungspreise) für die entsprechenden Serien der Eurex-Option und des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Pirelli & C. SpA

Zusammenfassung:

Das Unternehmen Marco Polo Industrial Holding SpA hat am 13. Oktober 2015 das vorläufige Ergebnis des Pflichtangebotes an die Aktionäre der Pirelli & C. SpA bekannt gegeben. Gemäß dieser Information hält Marco Polo Industrial Holding SpA 86,982 Prozent der Pirelli-Stammaktien. Die Zahlung des im Umtauschangebot festgelegten Preises von EUR 15,00 je Aktie erfolgt mit Wirkung zum 20. Oktober 2015.

Demzufolge werden gemäß den Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, Ziffern 2.6.10 (7) und 1.6.7 (7), die bestehenden Positionen in den Serien der Eurex-Option und dem Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt auf Aktien der Pirelli & C. SpA (PIL, PILH), wie bereits im Eurex-Rundschreiben 164/15 beschrieben, zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Die Basis für die Bestimmung des fairen Wertes ist der finale Angebotspreis von EUR 15,00.

Der Handel in den Optionen und im Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt auf Aktien der Pirelli & C. SpA (PIL, PILH) wird mit Wirkung zum 15. Oktober eingestellt.

Die Abrechnung der Options- und Futures-Kontrakte erfolgt mit Wirkung zum 16. Oktober 2015.

Alle Teilnehmer mit offenen Optionspositionen werden am 15. Oktober 2015 ein Fax mit einer Übersicht aller ihrer jeweils offenen Positionen erhalten. Die Buchung des Geldbetrages erfolgt am 15. Oktober 2015 mit Valuta 16. Oktober 2015. Die Positionen werden in der Tagesendverarbeitung am 16. Oktober 2015 ausgebucht. Das Settlement der Positionen im Futures-Kontrakt erfolgt automatisch mit der Verrechnung der letzten Variation Margin.

Die theoretisch fairen Werte (Schlussabrechnungspreise) für die entsprechenden Serien der Eurex-Option auf Aktien der Pirelli & C. SpA entnehmen Sie bitte der Anlage.



Attachment to Eurex circular 183/15

Theoretical fair values (final settlement prices) for the respective series of the Eurex option and the Eurex Single Stock Futures contract on shares of Pirelli C.SpA

Contract	StlPrc	ImpVoia	Contract	StlPrc	ImpVoia
C PIL OCT15 1500	0.0745	24.37	P PIL OCT15 1500	0.0745	24.37
C PIL DEC15 760	7.4005	29.95	P PIL DEC15 760	0.0001	29.95
C PIL DEC15 1500	0.6080	24.37	P PIL DEC15 1500	0.6070	24.37
C PIL DEC15 1700	0.0835	24.08	P PIL DEC15 1700	2.0825	24.08
C PIL MAR16 1500	0.6535	16.77	P PIL MAR16 1500	0.6470	16.77
C PIL MAR16 1700	0.1025	16.46	P PIL MAR16 1700	2.0965	16.46
C PIL JUN16 1400	1.6985	25.15	P PIL JUN16 1400	0.8810	25.15