



Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 05. Juni 2020
Wirksamkeitsdatum: 28. September 2020 (noch zu bestätigen)
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Abspaltung
Gesellschaft	Siemens AG
ISIN	DE0007236101
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (8), 1.13.8 (9), 1.26.11 (7), 1.27.8 (8), 2.6.10.1 (8)
Optionskontrakt auf Aktien	SIE/SIE1/2/4/5/SIEE
Futures-Kontrakt auf Aktien	SIEG/SIEP
Equity Total Return Future	TSIE
Stock Tracking Future	1SIE
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	S3IE

Die Gesellschaft Siemens AG hat am 26. Mai 2020 weitere Details zur Abspaltung der Siemens Energy AG bekannt gegeben. Die Aktionäre von Siemens werden für je zwei Siemens AG-Aktien eine Siemens Energy AG-Aktie erhalten.

Weitere Informationen zu dieser Transaktion finden Sie auf der Website der Gesellschaft unter www.siemens.com.

Nachstehend finden Sie eine Beschreibung des Anpassungsverfahrens.



Procedere

Basket-Methode

- Datum zu dem die Abspaltung wirksam wird: 28. September 2020 (voraussichtlich)
- Ab dem Stichtag wird der bisherige Basiswert durch einen Basket bestehend aus einer Siemens AG-Aktie und 0.5 Siemens Energy AG-Aktien ersetzt.

Optionen

- Eventuelle Änderungen der Produktkürzel/ISIN's werden rechtzeitig bekannt gegeben.
- Ab dem Stichtag reflektieren die Siemens-Optionen einen Basket bestehend aus einer Siemens-Aktie sowie 0.5 Siemens Energy-Aktien. Der Wert bzw. Schlusspreis des Basiswerts der Siemens-Basket-Optionen wird täglich wie folgt ermittelt:

(1,00 x Preis bzw. Schlusspreis der Siemens-Aktie an der Frankfurter Wertpapierbörse) plus (0.5 x Preis bzw. Schlusspreis der Siemens Energy-Aktie an der Frankfurter Wertpapierbörse)

- Die Basispreise und Kontraktgrößen bleiben unverändert.
- Bei Ausübung einer Siemens-Basket-Option sind für einen Kontrakt (100) Siemens-Aktien und (50) Siemens Energy-Aktien zu liefern gegen Zahlung des Betrags Kontraktgröße x Basispreis.
- Alle offenen Orders und Quotes werden am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss gelöscht.
- Ab dem Anpassungstag werden keine neuen Serien mehr eingeführt. Serien ohne offene Positionen werden gelöscht.
- Sobald keine Serien mehr mit offenen Positionen vorhanden sind, wird der Handel ausgesetzt und eingestellt.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Options. Ab dem entsprechenden Stichtag können keine neuen Positionen über die TES-Flex-Funktionalität eröffnet werden.
- Nach der Abspaltung werden in T7 neue Siemens AG-Optionen mit der Standardkontraktgröße 100 aufgesetzt. Details werden per Eurex-Rundschreiben bekannt gegeben.

Futures

- Ab dem Stichtag reflektiert die Siemens-Futures einen Basket bestehend aus einer Siemens-Aktie sowie 0.5 Siemens Energy-Aktien. Der Wert bzw. Schlusspreis des Basiswerts des Siemens-Basket-Future wird täglich wie folgt ermittelt:
- Für den in bar abzurechnenden Kontrakt erfolgt die Anpassung über den täglichen Schlusspreis. Für diesen und den Schlussabrechnungspreis werden die jeweiligen Schlusspreise analog, wie vorstehend für die Option beschrieben, ermittelt.

(1,00 x Preis bzw. Schlusspreis der Siemens-Aktie an der Frankfurter Wertpapierbörse) plus (0.5 x Preis bzw. Schlusspreis der Siemens Energy-Aktie an der Frankfurter Wertpapierbörse)

- Ab dem Stichtag reflektiert der Siemens-Dividenden-Future einen Basket bestehend aus der Dividende der Siemens-Aktie sowie der Dividende von 0.5 Siemens Energy-Aktien.
- Alle offenen Orders und Quotes werden am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss gelöscht.
- Ab dem Anpassungstag werden keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt
- Eventuelle Änderungen der Produktkürzel/ISIN`s werden rechtzeitig bekannt gegeben
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Futures. Ab dem entsprechenden Stichtag können keine neuen Positionen über die TES-Flex-Funktionalität eröffnet werden.
- Nach der Abspaltung werden neue Futures-Kontrakte auf die Siemens AG-Aktie eingeführt. Der genaue Einführungszeitpunkt wird per Rundschreiben bekannt gegeben.
- Sobald keine Verfallmonate mit offenen Positionen in den ursprünglichen Kontrakten mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesen Kontrakten ausgesetzt und eingestellt.
- Ferner werden in den ursprünglichen Kontrakten keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

Falls für die ursprünglichen Kontrakte am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts.