



Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 10. Juni 2020
Wirksamkeitsdatum: 16. Juni 2020
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Reorganisation/Zusammenschluß/ISIN_Änderung
Gesellschaft	Pargesa Holding SA
ISIN	CH0021783391
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, Ziffer(n) 1.6.7(8), 1.14.8 (8), 2.6.10 (8)
Optionskontrakt auf Aktien	PARG
Futures-Kontrakt auf Aktien	PARH

Die Unternehmen Pargesa Holding SA und Groupe Bruxelles Lambert haben die Vereinfachung ihrer Unternehmensstruktur bekannt gegeben. Die Umsetzung der Transaktion erfolgt über ein Übernahmeangebot der Parjointco Switzerland SA, demzufolge die Aktionäre der Pargesa Holding SA für je eine Pargesa Holding SA-Aktie 0,93 Groupe Bruxelles Lambert-Aktien erhalten. Am 09. Juni haben Pargesa Holding SA und Parjointco Switzerland SA das Übernahmeangebot per Pressemitteilung als erfolgreich zustande gekommen erklärt. Das Settlement der Transaktion erfolgt mit Wirkung zum 16. Juni 2020.

Für weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe die Website der Gesellschaft unter www.pargesa.ch.

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



Prozedere

R-Faktor Methode / Aktienumtausch

Die Eurex-Optionen sowie der Eurex Aktien-Futures-Kontrakt werden gemäß 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 angepasst.

- Der bisherige Basiswert (Pargesa-Holding SA-Aktie) wird durch die im Umtauschangebot bestimmte Groupe Bruxelles Lambert-Aktie (GBL) (ISIN: BE0003797140) ersetzt
- Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)
- Auf Basis des Umtauschverhältnisses von 0,93 neue Aktien je 1 alte Aktie ergibt sich ein R-Faktor von:
- $R = 1,07526882$
- Da die Notierung der Pargesa Holding Kontrakte unverändert in CHF erfolgt die tägliche Bewertung der Kontrakte ab dem Wirksamkeitstag auf Basis des Schlussauktionspreises der Groupe Bruxelles Lambert (GBL) Aktie an der Euronext Brüssel. Dieser wird dann mittels des täglich von der EZB festgelegten EUR-CHF Referenzkurses angepasst.

Die Firmierung und ISIN der oben aufgeführten Kontrakte ändern sich wie in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Bitte beachten Sie, dass die Basiswert-ISIN anstatt auf GBL-Aktie aus technischen Gründen in eine „Dummy-ISIN“ umgewandelt wird, da es bereits Derivate auf die GBL-Aktie gibt, diese aber auf Euro lauten.

Produktkürzel alt/neu	Basiswert-ISIN alt	Basiswert- ISIN neu	Produkt-ISIN alt	Produkt-ISIN neu	Name alt	Name neu
PARG	CH0021783391	DE000A2X1TW7	CH0021783391	CH0021783391	Pargesa.	Groupe Bruxelles Lambert

Die aktualisierten Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Options-Kontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich werden auf der Eurex-Website www.eurexchange.com eingestellt unter:

Ressourcen > Regelwerke > Kontraktsspezifikationen

Optionen

Anpassung der Basispreise und Kontraktgrößen

- Die bestehenden Basispreise werden mit dem R-Faktor multipliziert.
- Die Kontraktgröße wird durch den R-Faktor dividiert.
- Die Versionsnummer der bestehenden Serien erhöht sich um 1.
- Die angepassten Basispreise und Kontraktgrößen werden unmittelbar nach Handelsschluss des letzten Handelstages vor der Anpassung auf der Eurex-Website www.eurexchange.com eingestellt unter **Produkte > Aktienderivate > Kapitalmaßnahmen**
- Es werden keine neuen Serien mehr eingeführt.
- Sobald keine Serien mit offenen Positionen mehr bestehen, wird der Handel in dem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Handelstag vor der Anpassung gelöscht.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Options

Ausübungen

- Bei Ausübung eines Kontraktes sind ab dem Wirksamkeitstag 93 GBL- Aktien (ISIN: BE0003797140) zu liefern

Futures

Im Futures Kontrakt auf Pargesa Holding SA (PARH) bestehen keine offenen Positionen. Der Handel wird daher mit sofortiger Wirkung eingestellt und es erfolgt keine Anpassung.