X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 063/14*

Datum: 8. April 2014
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Edward Backes

Celesio AG: Einstellung des Handels, Schlussabrechnungspreise

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 025/14

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

Zielgruppe:

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

Anhang:

Theoretisch faire Werte (Schlussabrechnungspreise) für die Eurex-Optionen und den Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt auf Celesio AG

Zusammenfassung:

Die Gesellschaft Dragonfly GmbH & Co. KGaA hat am 7. April 2014 das Resultat des Übernahmeangebots an die Aktionäre der Celesio AG bekannt gegeben.

Demzufolge werden gemäß den Ziffern 1.6.7 (7) und 2.6.10 (7) der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich die bestehenden Positionen in den Serien für die Eurex-Optionen und in dem Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt auf Aktien der Celesio AG (CLS, CLSF), wie bereits in Eurex-Rundschreiben 025/14 beschrieben, zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Die Basis für die Bestimmung des fairen Wertes ist der finale Angebotspreis von EUR 23,50.

Der Handel in Optionen und im Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt auf Aktien der Celesio AG (CLS, CLSF) wurde nach Handelsschluss am **7. April 2014** eingestellt.

Die Abrechnung der Optionskontrakte erfolgt mit Wirkung zum **8. April 2014**.

eurex

Eurex Deutschland
Börsenplatz 4
60313 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
memberservices@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Dr. Thomas Book, Mehtap Dinc,
Michael Peters, Andreas Preuß

ARBN: 101 013 361

Celesio AG: Einstellung des Handels, Schlussabrechnungspreise

Die Gesellschaft Dragonfly GmbH & Co. KGaA hat am 7. April 2014 das Resultat des Übernahmeangebots an die Aktionäre der Celesio AG bekannt gegeben.

Demzufolge werden gemäß den Ziffern 1.6.7 (7) und 2.6.10 (7) der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich die bestehenden Positionen in den Serien für die Eurex-Optionen und in dem Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt auf Aktien der Celesio AG (CLS, CLSF), wie bereits in Eurex-Rundschreiben 025/14 beschrieben, zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Die Basis für die Bestimmung des fairen Wertes ist der finale Angebotspreis von EUR 23,50.

Der Handel in den Optionen und im Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt auf Aktien der Celesio AG (CLS, CLSF) wurde nach Handelsschluss am 7. April 2014 eingestellt.

Die Abrechnung der Optionskontrakte erfolgt mit Wirkung zum 8. April 2014.

Alle Teilnehmer mit offenen Options-Positionen werden am 8. April 2014 ein Fax mit einer Übersicht aller ihrer jeweils offenen Positionen erhalten. Die Buchung des Geldbetrags erfolgt am 8. April 2014 mit Valuta 9. April 2014. Die Abwicklung der Positionen im Eurex-Aktien-Futures-Kontrakt erfolgt automatisch mit der Verrechnung der letzten Variation Margin. Die Positionen werden in der Tagesendverarbeitung vom 9. April 2014 mit Wirkung zum 10. April 2014 ausgebucht.

Die theoretisch fairen Werte (Schlussabrechnungspreise) für die entsprechenden Serien der Eurex-Option und des Eurex-Aktien-Futures-Kontrakts auf Aktien der Celesio AG entnehmen Sie bitte der Anlage.

8. April 2014

Options

Contract	StlPrc	ImpVola	Contract	StlPrc	ImpVola
C CLS APR14 2300	0.7600	29.79	P CLS APR14 2300	0.3600	36.36
C CLS APR14 2600	0.0100	28.68	P CLS APR14 2600	2.5300	37.36
C CLS JUN14 1000	13.5000	24.57	P CLS JUN14 1000	0.0100	40.67
C CLS JUN14 1400	9.5000	24.57	P CLS JUN14 1400	0.0100	38.91
C CLS JUN14 1500	8.5000	24.57	P CLS JUN14 1500	0.0100	37.45
C CLS JUN14 1600	7.5000	24.57	P CLS JUN14 1600	0.0100	36.42
C CLS JUN14 1700	6.5000	24.57	P CLS JUN14 1700	0.0300	35.45
C CLS JUN14 1800	5.5000	26.61	P CLS JUN14 1800	0.0700	34.60
C CLS JUN14 1900	4.5200	27.45	P CLS JUN14 1900	0.1500	34.00
C CLS JUN14 2000	3.5700	27.89	P CLS JUN14 2000	0.2800	33.54
C CLS JUN14 2200	1.9300	28.13	P CLS JUN14 2200	0.8200	32.84
C CLS JUN14 2400	0.8600	28.18	P CLS JUN14 2400	1.8400	33.10
C CLS JUN14 2600	0.3200	28.21	P CLS JUN14 2600	3.3000	34.03
C CLS JUN14 2800	0.1000	28.54	P CLS JUN14 2800	5.0400	35.99
C CLS JUN14 3000	0.0300	29.15	P CLS JUN14 3000	6.9300	38.44
C CLS JUN14 3200	0.0100	29.15	P CLS JUN14 3200	8.8500	38.44
C CLS SEP14 1700	6.5100	28.16	P CLS SEP14 1700	0.1500	32.56
C CLS SEP14 1800	5.5400	28.67	P CLS SEP14 1800	0.2600	32.33
C CLS SEP14 2000	3.8000	29.04	P CLS SEP14 2000	0.6600	31.75
C CLS SEP14 2200	2.4200	28.90	P CLS SEP14 2200	1.3500	31.43
C CLS SEP14 2400	1.4700	28.85	P CLS SEP14 2400	2.4100	31.38
C CLS SEP14 2600	0.8100	28.73	P CLS SEP14 2600	3.7600	31.58
C CLS SEP14 3000	0.2100	28.55	P CLS SEP14 3000	7.1200	32.61
C CLS DEC14 1200	11.5000	31.79	P CLS DEC14 1200	0.0200	34.00
C CLS DEC14 1400	9.5000	31.79	P CLS DEC14 1400	0.0600	32.21
C CLS DEC14 1600	7.5200	30.84	P CLS DEC14 1600	0.1600	30.93
C CLS DEC14 1800	5.6800	29.96	P CLS DEC14 1800	0.4100	29.93
C CLS DEC14 2000	4.1000	29.17	P CLS DEC14 2000	0.8600	29.17
C CLS DEC14 2400	1.8700	28.27	P CLS DEC14 2400	2.6400	28.28
C CLS JUN15 2000	4.6200	29.72	P CLS JUN15 2000	1.5800	29.70

Futures

Contract	StlPrc
CLSF JUN14	23.2061