

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 05. Januar 2021
Wirksamkeitsdatum: 18. Januar 2021
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Zusammenschluss / ISIN-Change
Gesellschaft	Peugeot S.A
ISIN	FR0000121501
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (7), 1.13.8 (7), 1.26.11 (6), 1.27.8 (7), 2.6.10.1 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	PEU
Futures-Kontrakt auf Aktien	PEUG/PEUP
Equity Total Return Future	TPEU
Stock Tracking Future	1PEU
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	P2EU

Die Unternehmen Peugeot S.A und FiatChrysler Group haben in ihren jeweiligen außerordentlichen Aktionärsversammlungen am 04. Januar 2021 den Zusammenschluss beider Unternehmen beschlossen. Nach Vollzug des Zusammenschlusses firmiert die neue Gesellschaft unter dem Namen Stellantis N.V.

Gemäß dem Angebotsprospekt erhalten die Aktionäre der Peugeot S.A 1,742 Aktien der Stellantis N.V für eine bestehende Peugeot S.A-Aktie. Für weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe die Website der Gesellschaft unter www.groupe-psa.com.com.

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

Prozedere

R-Faktor Methode / Aktienumtausch

Nach Umsetzung der Transaktion werden die Eurex-Optionen, die Eurex Aktien-Futures-Kontrakte, der Total Return Future-Kontrakt, der Stock-Tracking Future-Kontrakt sowie der Eurex Aktiendividenden-Future auf Peugeot S.A 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, 1.14.8 (7) für Eurex Aktiendividenden-Future-Kontrakte, 1.26.11 (6) für Total Return Future-Kontrakte, 1.27.8 (7) für Stock-Tracking Future-Kontrakte und Ziffer 2.6.10.1 (7) für Eurex Options-Kontrakte angepasst.

- Der bisherige Basiswert wird durch die im Umtauschangebot bestimmte Aktie ersetzt
- Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)
- Auf Basis des Umtauschverhältnisses von 1.742 neuen Aktien je 1 alte Aktie ergibt sich ein R-Faktor von:
- $R = 0.57405281$

Ab dem Wirksamkeitsdatum firmiert die Gesellschaft unter dem Namen Stellantis N.V. Es ergeben sich folgende Änderungen:

Produktkürzel alt/neu	ISIN des Basiswerts alt	ISIN des Basiswerts neu	Produkt ISIN alt/neu	Name alt	Name neu
PEU	FR0000121501	NL00150001Q9	FR0000121501	Peugeot S.A	Stellantis N.V
PEUG	FR0000121501	NL00150001Q9	DE000A1N51Z1	Peugeot S.A	Stellantis N.V
PEUP	FR0000121501	NL00150001Q9	DE000A2P44J3	Peugeot S.A	Stellantis N.V
1PEU	FR0000121501	NL00150001Q9	DE000A2P46X9	Peugeot S.A	Stellantis N.V
TPEU	FR0000121501	NL00150001Q9	DE000A2X13D5	Peugeot S.A	Stellantis N.V
P2EU	XC000A2X2F77	XC000A2X2F77	DE000A2X2JX4	Peugeot S.A	Stellantis N.V

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

Futures

Anpassung der Kontraktgröße und Variation Margin

- Die Anpassung erfolgt mit demselben R-Faktor wie für die Optionen.
- Zum Ausgleich der Berechnung der Variation Margin des darauffolgenden Börsentages werden die Settlement-Preise vom letzten Cum-Handelstag mit dem R-Faktor multipliziert.
- Die neue Kontraktgröße errechnet sich wie folgt: $\text{Kontraktgröße neu} = \text{Kontraktgröße alt} / \text{R-Faktor}$
- 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 Futures
- Es werden keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.
- Sobald keine Verfallmonate mit offenen Positionen mehr bestehen, wird der Handel in dem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

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

Rules & Regs > Eurex Regelwerke > Kontraktspezifikationen