

## Corporate Action Information 002

**Issue Date:** 12 July 2021  
**Effective Date:** 13 July 2021  
**Contact:** Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Corporate Action	Takeover
<b>Company</b>	<b>Natixis S.A.</b>
<b>ISIN</b>	<b>FR0000120685</b>
Rules&Regulations	Contract Specifications for Futures Contracts and Options Contracts at Eurex Deutschland, sections 1.6.7 (7), 1.26.11 (6), 2.6.10.1 (7)
Options contracts on stocks	NBP
Futures contracts on stocks	NBPP, KNFK
Equity Total Return Future	TNBP
Stock Tracking Future	
Futures contracts on dividends of stocks	

In a media release, dated 12 July 2021, the company BPCE S.A. announced that it would own 91,80% of the shares and voting rights in Natixis S.A. In addition, it announced that it would commence 'squeeze-out' procedures once it had obtained regulatory approval.

Accordingly, as described in Corporate Action Info 001 and pursuant to the Contract Specifications for Futures Contracts and Options Contracts at Eurex Deutschland, numbers 1.6.7 (7) and 2.6.10.1 (7), existing positions in futures contracts KNFK and options contracts NBP will be settled at the theoretical fair value. Basis for the calculation of the fair values is the offer price of EUR 4.00 per share.

The final settlement prices for the futures contracts KNFK and the options contracts NBP with open interest are given in the tables below.

On 13 July 2021, all participants with open positions will receive an information containing an overview of their respective open positions. Booking of the cash balances will take place on 13 July 2021 with value date 14 July 2021. In the end-of-day processing of 14 July 2021 the positions will be booked out effective 15 July 2021.

Last Friday, 09 July 2021, was the last trading day of the futures and options contracts with respect to Natixis S.A.

**Final Settlement Prices of options contracts NBP with open interest:**

Tender offer price as reference price: 4.00 EUR

Contract	Settlement Price	Impl. Volatilität
Sep 21 Call 1,2	2,8	72,43
Sep 21 Call 1,4	2,6	67,24
Sep 21 Call 1,6	2,4	63,67
Sep 21 Call 1,8	2,2	59,29
Sep 21 Call 2	2	55,9
Sep 21 Call 2,2	1,8	53,3
Sep 21 Call 2,4	1,6	51,16
Sep 21 Call 2,6	1,4	49,06
Sep 21 Call 2,8	1,21	47,18
Sep 21 Call 3	1,02	45,75
Sep 21 Call 3,2	0,84	44,32
Sep 21 Call 3,4	0,67	43,67
Sep 21 Call 3,6	0,52	42,89
Sep 21 Call 3,8	0,39	42,33
Sep 21 Call 4	0,29	42,04
Sep 21 Call 4,2	0,2	41,7
Sep 21 Call 4,4	0,14	41,46
Sep 21 Call 4,6	0,09	41,29
Sep 21 Call 4,8	0,06	41,29
Sep 21 Call 5	0,04	41,29
Sep 21 Call 5,2	0,02	41,29
Sep 21 Call 5,4	0,02	41,29
Sep 21 Call 5,6	0,01	41,29
Sep 21 Call 5,8	0,01	41,29
Sep 21 Call 6	0,01	41,29
Sep 21 Call 6,2	0,01	41,29
Sep 21 Call 6,4	0,01	41,29
Sep 21 Call 6,6	0,01	41,29
Sep 21 Call 6,8	0,01	41,29
Sep 21 Call 7	0,01	41,29
Sep 21 Put 1,2	0,01	72,43
Sep 21 Put 1,4	0,01	67,24
Sep 21 Put 1,6	0,01	63,67
Sep 21 Put 1,8	0,01	59,29
Sep 21 Put 2	0,01	55,9
Sep 21 Put 2,2	0,01	53,3

Sep 21 Put 2,4	0,01	51,16
Sep 21 Put 2,6	0,01	49,06
Sep 21 Put 2,8	0,01	47,18
Sep 21 Put 3	0,02	45,75
Sep 21 Put 3,2	0,04	44,32
Sep 21 Put 3,4	0,08	43,67
Sep 21 Put 3,6	0,13	42,89
Sep 21 Put 3,8	0,2	42,33
Sep 21 Put 4	0,29	42,04
Sep 21 Put 4,2	0,41	41,7
Sep 21 Put 4,4	0,54	41,46
Sep 21 Put 4,6	0,7	41,29
Sep 21 Put 4,8	0,87	41,29
Sep 21 Put 5	1,04	41,29
Sep 21 Put 5,2	1,23	41,29
Sep 21 Put 5,4	1,42	41,29
Sep 21 Put 5,6	1,62	41,29
Sep 21 Put 5,8	1,81	41,29
Sep 21 Put 6	2,01	41,29
Sep 21 Put 6,2	2,21	41,29
Sep 21 Put 6,4	2,41	41,29
Sep 21 Put 6,6	2,61	41,29
Sep 21 Put 6,8	2,81	41,29
Sep 21 Put 7	3,01	41,29
Dec 21 Call 0,4	3,6	39,21
Dec 21 Call 1,2	2,8	39,21
Dec 21 Call 1,4	2,6	39,21
Dec 21 Call 1,6	2,4	39,21
Dec 21 Call 1,8	2,2	39,21
Dec 21 Call 2	2,01	39,21
Dec 21 Call 2,2	1,81	39,21
Dec 21 Call 2,4	1,62	39,21
Dec 21 Call 2,6	1,43	39,21
Dec 21 Call 2,8	1,25	71,65
Dec 21 Call 3	1,08	62,14
Dec 21 Call 3,2	0,92	54,46
Dec 21 Call 3,4	0,77	49,58
Dec 21 Call 3,6	0,64	45,99
Dec 21 Call 3,8	0,52	43,4
Dec 21 Call 4	0,42	41,63
Dec 21 Call 4,2	0,33	40,3
Dec 21 Call 4,4	0,26	39,47
Dec 21 Call 4,6	0,2	38,73

Dec 21 Call 4,8	0,16	38,73
Dec 21 Call 5	0,12	38,73
Dec 21 Call 5,2	0,09	38,73
Dec 21 Call 5,4	0,07	38,73
Dec 21 Call 5,6	0,05	38,73
Dec 21 Call 5,8	0,04	38,73
Dec 21 Call 6	0,03	38,73
Dec 21 Call 6,2	0,02	38,73
Dec 21 Call 6,4	0,02	38,73
Dec 21 Call 6,6	0,01	38,73
Dec 21 Call 6,8	0,01	38,73
Dec 21 Call 7	0,01	38,73
Dec 21 Put 0,4	0,01	39,21
Dec 21 Put 1,2	0,01	39,21
Dec 21 Put 1,4	0,01	39,21
Dec 21 Put 1,6	0,01	39,21
Dec 21 Put 1,8	0,01	39,21
Dec 21 Put 2	0,01	39,21
Dec 21 Put 2,2	0,02	39,21
Dec 21 Put 2,4	0,03	39,21
Dec 21 Put 2,6	0,04	39,21
Dec 21 Put 2,8	0,06	71,65
Dec 21 Put 3	0,09	62,14
Dec 21 Put 3,2	0,13	54,46
Dec 21 Put 3,4	0,18	49,58
Dec 21 Put 3,6	0,25	45,99
Dec 21 Put 3,8	0,33	43,4
Dec 21 Put 4	0,43	41,63
Dec 21 Put 4,2	0,54	40,3
Dec 21 Put 4,4	0,67	39,47
Dec 21 Put 4,6	0,81	38,73
Dec 21 Put 4,8	0,97	38,73
Dec 21 Put 5	1,13	38,73
Dec 21 Put 5,2	1,31	38,73
Dec 21 Put 5,4	1,48	38,73
Dec 21 Put 5,6	1,67	38,73
Dec 21 Put 5,8	1,86	38,73
Dec 21 Put 6	2,05	38,73
Dec 21 Put 6,2	2,24	38,73
Dec 21 Put 6,4	2,43	38,73
Dec 21 Put 6,6	2,63	38,73
Dec 21 Put 6,8	2,83	38,73
Dec 21 Put 7	3,02	38,73

Jun 22 Call 0,8	3,2	67,34
Jun 22 Call 1,2	2,81	67,34
Jun 22 Call 1,6	2,42	63,31
Jun 22 Call 2	2,03	59,19
Jun 22 Call 2,4	1,67	56,07
Jun 22 Call 2,8	1,34	53,29
Jun 22 Call 3,2	1,04	51,03
Jun 22 Call 3,6	0,79	49,15
Jun 22 Call 4	0,59	46,78
Jun 22 Call 4,4	0,43	45,46
Jun 22 Call 4,8	0,31	43,98
Jun 22 Call 5	0,27	42,87
Jun 22 Call 5,2	0,23	41,97
Jun 22 Call 5,4	0,2	41,26
Jun 22 Call 5,6	0,17	40,65
Jun 22 Call 5,8	0,14	40,1
Jun 22 Call 6	0,12	39,66
Jun 22 Call 6,2	0,1	39,39
Jun 22 Call 6,4	0,09	39,21
Jun 22 Call 6,6	0,07	39,21
Jun 22 Call 6,8	0,06	39,21
Jun 22 Call 7	0,05	39,21
Jun 22 Put 0,8	0,01	67,34
Jun 22 Put 1,2	0,02	67,34
Jun 22 Put 1,6	0,03	63,31
Jun 22 Put 2	0,06	59,19
Jun 22 Put 2,4	0,11	56,07
Jun 22 Put 2,8	0,19	53,29
Jun 22 Put 3,2	0,32	51,03
Jun 22 Put 3,6	0,48	49,15
Jun 22 Put 4	0,69	46,78
Jun 22 Put 4,4	0,95	45,46
Jun 22 Put 4,8	1,25	43,98
Jun 22 Put 5	1,41	42,87
Jun 22 Put 5,2	1,57	41,97
Jun 22 Put 5,4	1,74	41,26
Jun 22 Put 5,6	1,92	40,65
Jun 22 Put 5,8	2,09	40,1
Jun 22 Put 6	2,27	39,66
Jun 22 Put 6,2	2,46	39,39
Jun 22 Put 6,4	2,65	39,21
Jun 22 Put 6,6	2,83	39,21
Jun 22 Put 6,8	3,02	39,21

Jun 22 Put 7	3,22	39,21
Dec 22 Call 1,2	2,81	58,13
Dec 22 Call 1,6	2,43	52,99
Dec 22 Call 2	2,06	48,8
Dec 22 Call 2,4	1,71	45,42
Dec 22 Call 2,8	1,4	42,79
Dec 22 Call 3,2	1,12	40,87
Dec 22 Call 3,6	0,88	39,7
Dec 22 Call 4	0,69	38,96
Dec 22 Call 4,4	0,54	38,28
Dec 22 Call 4,8	0,42	38,28
Dec 22 Call 5	0,37	38,28
Dec 22 Call 5,2	0,33	38,28
Dec 22 Call 5,4	0,29	38,28
Dec 22 Call 5,6	0,26	38,28
Dec 22 Call 5,8	0,23	38,28
Dec 22 Call 6	0,21	38,28
Dec 22 Call 6,2	0,18	38,28
Dec 22 Call 6,4	0,16	38,28
Dec 22 Call 6,6	0,15	38,28
Dec 22 Call 6,8	0,13	38,28
Dec 22 Call 7	0,12	38,28
Dec 22 Put 1,2	0,03	58,13
Dec 22 Put 1,6	0,07	52,99
Dec 22 Put 2	0,12	48,8
Dec 22 Put 2,4	0,19	45,42
Dec 22 Put 2,8	0,29	42,79
Dec 22 Put 3,2	0,43	40,87
Dec 22 Put 3,6	0,61	39,7
Dec 22 Put 4	0,83	38,96
Dec 22 Put 4,4	1,09	38,28
Dec 22 Put 4,8	1,38	38,28
Dec 22 Put 5	1,53	38,28
Dec 22 Put 5,2	1,7	38,28
Dec 22 Put 5,4	1,86	38,28
Dec 22 Put 5,6	2,03	38,28
Dec 22 Put 5,8	2,2	38,28
Dec 22 Put 6	2,38	38,28
Dec 22 Put 6,2	2,56	38,28
Dec 22 Put 6,4	2,74	38,28
Dec 22 Put 6,6	2,92	38,28
Dec 22 Put 6,8	3,11	38,28
Dec 22 Put 7	3,3	38,28

**Final Settlement Prices of futures contracts KNFK with open interest:**

Tender offer price as reference price: 4.00 EUR

Contract	Settlement Price
KNFK Sep21	3,9960