

Kapitalmaßnahmeinformation 002

Ausstellungsdatum: 12. Juli 2021
Wirksamkeitsdatum: 13 Juli 2021
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Takeover
Gesellschaft	Natixis S.A.
ISIN	FR0000120685
Regelwerk	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)
Optionskontrakt auf Aktien	NBP
Futures-Kontrakt auf Aktien	NBPP, KNFK
Equity Total Return Future	TNBP
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

Im Zuge ihres öffentlichen Übernahmeangebotes an die Aktionäre der Natixis S.A. hat die Gesellschaft BPCE S.A. in einer Mitteilung vom 12. Juli 2021 bekannt gegeben, dass sie 91,80% der Aktien und Stimmrechte der Natixis S.A. hält und bei Freigabe durch die zuständige Behörde mit der Abfindung („Squeeze-out“) der verbliebenen Aktionäre der Natixis S.A. beginnen wird. Daher werden gemäß Ziffern 1.6.7 (7) und 2.6.10.1 (7) und wie bereits in der Kapitalmaßnahmeinformation 001 beschrieben, bestehende Positionen in den Futures-Kontrakten KNFK und den Optionskontrakten NBP zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Basis für die Berechnung des fairen Wertes ist der Angebotspreis in Höhe von 4,00 EUR.

Die Schlussabrechnungspreise für die Futures- und Optionskontrakte mit offenen Positionen finden sich in den unten aufgeführten Tabellen.

Alle Teilnehmer mit offenen Futures- und Optionspositionen erhalten am 13. Juli 2021 eine Mitteilung mit einer Übersicht aller ihrer jeweils offenen Positionen. Die Buchung der entsprechenden Salden erfolgt am 13. Juli 2021 mit Valuta 14. Juli 2021. Die Positionen werden in der Tagesendverarbeitung vom 14. Juli 2021 mit Wirkung zum 15. Juli 2021 ausgebucht.

Der Handel in den Kontrakten, die sich auf Natixis S.A. beziehen, wurde mit Ablauf der Handelssitzung am Freitag, den 09. Juli 2021, eingestellt,

Schlussabrechnungspreise für NBP Optionsserien mit offenen Positionen:

Zugrundeliegender Angebotspreis als Referenzpreis: 4,00 EUR

Kontrakt	Settlement Preis	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
--------------	-----	-------

Schlussabrechnungspreise für KNFK Futures-Serien mit offenen Positionen:

Zugrundeliegender Angebotspreis als Referenzpreis: 4,00 EUR

Kontrakt	Settlement Preis
KNFK Sep21	3,9960