

Kapitalmaßnahmeinformation 002

Ausstellungsdatum: 02. September 2021
Wirksamkeitsdatum: Wird noch bekannt gegeben
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Abspaltung
Gesellschaft	Vivendi SE
ISIN	FR0000127771
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (8), 1.13.8 (9), 1.26.11 (7), 1.27.8 (8), 2.6.10.1 (8)
Optionskontrakt auf Aktien	VVU, VVU1/2/4/5
Futures-Kontrakt auf Aktien	VVUI, VVUP
Equity Total Return Future	TVVU
Stock Tracking Future	1VVU
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	V5VU

Die Gesellschaft Vivendi SE hat die Abspaltung der Universal Music Group als eigenständige Gesellschaft vorbehaltlich der Zustimmung der Hauptversammlung bekannt gegeben. Die Aktionäre der Vivendi SE sollen für je 1 Vivendi SE-Aktie je 1 UMG-Aktie erhalten. Bitte berücksichtigen Sie, dass sich das endgültige Umtauschverhältnis ändern kann gemäß des von Vivendi veröffentlichten Abspaltungsberichtes. Es ist vorgesehen, dass der Notierungsbeginn der UMG-Aktie nicht später als am 21. September ist.

Weitere Informationen zu dieser Transaktion finden Sie auf der Website der Gesellschaft unter www.vivendi.com.

Nachstehend finden Sie eine Beschreibung des Anpassungsverfahrens.

Procedere

Basket-Methode

- Datum, zu dem die Abspaltung wirksam wird: Wird noch bekannt gegeben
- Ab dem Stichtag wird der bisherige Basiswert durch einen Basket bestehend aus einer Vivendi SE-Aktie und einer UMG-Aktie ersetzt. Sollte Vivendi eine Änderung des Umtauschverhältnisses bekannt geben, wird sich auch die Anzahl der UMG-Aktien als Bestandteil des Baskets verändern.
- ISIN der Vivendi SE-Aktie: FR0000127771 (bleibt unverändert)
- ISIN der UMG-Aktie: (wird noch bekannt gegeben)

Optionen

- Mit Wirkung zum Stichtag werden sich in T7 die ISIN (in eine Dummy-ISIN), das Produktkürzel sowie die Firmierung und das Produktkürzel wie folgt ändern:

Produktkürzel alt	Produktkürzel neu	Produkt-ISIN alt	Produkt-ISIN neu	Basiswert-ISIN alt	Basiswert-ISIN neu
VVU	Wird noch bekannt gegeben	FR0000127771	Wird noch bekannt gegeben	FR0000127771	Wird noch bekannt gegeben
VVU1	Wird noch bekannt gegeben	DE000A1633C0	Wird noch bekannt gegeben	FR0000127771	Wird noch bekannt gegeben
VVU2	Wird noch bekannt gegeben	DE000A1633D8	Wird noch bekannt gegeben	FR0000127771	Wird noch bekannt gegeben
VVU4	Wird noch bekannt gegeben	DE000A1633E6	Wird noch bekannt gegeben	FR0000127771	Wird noch bekannt gegeben
VVU5	Wird noch bekannt gegeben	DE000A1633F3	Wird noch bekannt gegeben	FR0000127771	Wird noch bekannt gegeben

- Ab dem Stichtag reflektiert die Vivendi SE-Option einen Basket bestehend aus einer Vivendi SE-Aktie sowie einer UMG-Aktie. Sollte sich das Umtauschverhältnis ändern, wird sich auch die Anzahl der UMG-Aktien als Bestandteil des Baskets ändern. Der Wert bzw. Schlusspreis des Basiswerts der Vivendi SE-Basket-Option wird täglich wie folgt ermittelt:

Preis bzw. Schlusspreis der Vivendi SE-Aktie an der Euronext Paris plus Preis bzw. Schlusspreis der UMG-Aktie an der Euronext Amsterdam vorbehaltlich einer Anpassung des Umtauschverhältnisses

- Die Basispreise und Kontraktgrößen bleiben unverändert.
- Bei Ausübung einer Vivendi SE-Basket-Option sind für einen Kontrakt 100 Vivendi SE-Aktien und 100 UMG-Aktien zu liefern gegen Zahlung des Betrags Kontraktgröße 100 x Basispreis. Sollte sich die Anzahl der UMG-Aktien ändern, wird dies bei der Lieferung entsprechend berücksichtigt
- Alle offenen Orders und Quotes werden am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss gelöscht.
- Ab dem Anpassungstag werden keine neuen Serien mehr eingeführt. Serien ohne offene Positionen werden gelöscht.
- Sobald keine Serien mehr mit offenen Positionen vorhanden sind, wird der Handel ausgesetzt und eingestellt.

- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Options. Ab dem entsprechenden Stichtag können keine neuen Positionen über die TES-Flex-Funktionalität eröffnet werden.
- Nach der Abspaltung wird in T7 eine neue Vivendi SE-Option mit der Standardkontraktgröße 100 aufgesetzt. Details werden per Eurex-Rundschreiben bekannt gegeben.

Futures

- Ab dem Stichtag reflektieren die Vivendi SE-Futures einen Basket bestehend aus einer Vivendi SE-Aktie sowie einer UMG-Aktie. Sollte sich das Umtauschverhältnis ändern wird sich auch die Anzahl der UMG-Aktien als Bestandteil des Baskets ändern.
- Für die in bar abzurechnenden Kontrakte erfolgt die Anpassung über den täglichen Schlusspreis. Für diesen und den Schlussabrechnungspreis werden die jeweiligen Schlusspreise analog, wie vorstehend für die Option beschrieben, ermittelt:
Preis bzw. Schlusspreis der Vivendi SE-Aktie an der Euronext Paris plus Preis bzw. Schlusspreis der UMG-Aktie an der Euronext Amsterdam vorbehaltlich einer Anpassung des Umtauschverhältnisses
- Ab dem Stichtag reflektiert der Vivendi SE-Dividenden-Future einen Basket bestehend aus der Dividende der Vivendi SE-Aktie sowie der Dividenden von einer UMG-Aktie. Sollte sich das Umtauschverhältnis ändern wird sich auch die Anzahl der UMG-Aktien als Bestandteil des Baskets ändern
- Alle offenen Orders und Quotes werden am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss gelöscht.
- Ab dem Anpassungstag werden keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt
- Mit Wirkung zum Stichtag werden sich in T7 die ISIN (in eine Dummy-ISIN), das Produktkürzel sowie die Firmierung und das Produktkürzel wie folgt ändern:

Produktkürzel alt/neu	Produkt-ISIN alt/neu	Basiswert-ISIN alt	Basiswert-ISIN neu	Name alt	Name neu
VVUI	DE000A18T6W9	FR0000127771	wird noch bekannt gegeben	Vivendi SE	Vivendi SE Basket
VVUP	DE000A2RPPL1	FR0000127771	Wird noch bekannt gegeben	Vivendi SE	Vivendi SE Basket
V5VU	DE000A18T6V1	XC000A1DKC44	wird noch bekannt gegeben	Vivendi SE	Vivendi SE Basket
1VVU	DE000A2L0MN7	FR0000127771	wird noch bekannt gegeben	Vivendi SE	Vivendi SE Basket
TVVU	DE000A2X15G3	FR0000127771	wird noch bekannt gegeben	Vivendi SE	Vivendi SE Basket

- Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Futures. Ab dem entsprechenden Stichtag können keine neuen Positionen über die TES-Flex-Funktionalität
- Es werden neue Vivendi SE-Aktien-Futures-Kontrakte eingeführt mit Standardkontraktgröße 100 sowie ein neuer Vivendi SE-Aktiendividenden-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 1000.
- Der genaue Einführungszeitpunkt wird per Rundschreiben bekannt gegeben.
- Sobald keine Verfallmonate mit offenen Positionen in den ursprünglichen Kontrakten mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesen Kontrakten ausgesetzt und eingestellt.
- Ferner werden in den ursprünglichen Kontrakten keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

Falls für die ursprünglichen Kontrakte am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts.