

Kapitalmaßnahmeinformation 003

Ausstellungsdatum: 20. September 2021
Wirksamkeitsdatum: 21. September 2021
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Abspaltung, Namensänderung
Gesellschaft	Vivendi SE
ISIN	FR0000127771
Regelwerk	Kontraktsspezifikationen 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

Mit der Veröffentlichung des Verkaufsprospekts der Universal Music Group BV („UMG“), deren Rechtsformwechsel in eine NV nach niederländischem Recht vor der Erstnotiz an der Euronext Amsterdam vorgesehen ist, sind weitere Einzelheiten zur Abspaltung der UMG von der Vivendi SE bekannt gegeben worden. Dem Prospekt zufolge soll das endgültige Umtauschverhältnis am 21. September 2021 bekannt gegeben werden und auch die Zulassung zum Handel an der Euronext Amsterdam soll zu diesem Stichtag erfolgen. Weitere Informationen zu dieser Transaktion finden sich auf der Website der Gesellschaft unter www.vivendi.com sowie unter <https://investors.universalmusic.com>.

Nachstehend finden Sie Ergänzungen zu dem in den Kapitalmaßnahmeinformationen 001 und 002 beschriebenen Anpassungsverfahren.

1. 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 Basket verändern.
- ISIN der Vivendi-SE-Aktie: FR0000127771 (bleibt unverändert)
- ISIN der UMG-Aktie: NL00150001Y2
- ISIN des Vivendi-UMG-Basket: DE000A3C2D12

2. Optionen

- Mit Wirkung zum Stichtag werden sich in T7 die ISINs (in Dummy-ISINs) und die Produktkürzel wie folgt ändern:

Produktkürzel alt	Produktkürzel neu	Produkt-ISIN alt	Produkt-ISIN neu	Basiswert-ISIN alt	Basiswert-ISIN neu
VVU	VVAB	FR0000127771	DE000A3C2D12	FR0000127771	DE000A3C2D12
VVU1	VVA1	DE000A1633C0	DE000A3C2D20	FR0000127771	DE000A3C2D12
VVU2	VVA2	DE000A1633D8	DE000A3C2D38	FR0000127771	DE000A3C2D12
VVU4	VVA4	DE000A1633E6	DE000A3C2D46	FR0000127771	DE000A3C2D12
VVU5	VVA5	DE000A1633F3	DE000A3C2D53	FR0000127771	DE000A3C2D12

- Die Kontraktbezeichnungen ändern sich entsprechend in Vivendi-UMG-Basket.
- Ab dem Stichtag reflektieren die auf Vivendi bezogenen Optionskontrakte 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 Basket 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 das Umtauschverhältnis ändern, so wird sich auch die Basket-Zusammensetzung ändern und wird bei der stückemäßigen Belieferung 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.

Falls für die ursprünglichen Optionskontrakte am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung von Nachfolgekontrakten.

3. Futures

- Ab dem Stichtag reflektieren die aktienbezogenen Vivendi-SE-Futures-Kontrakte 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 Basket ändern.
- Für die in bar abzurechnenden Kontrakte erfolgt die Anpassung über den täglichen Schlusspreis. Für diesen und den Schlussabrechnungspreis werden die jeweiligen Schlusspreise ebenso wie zuvor 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-Futures-Kontrakt einen Basket bestehend aus den Dividenden einer Vivendi-SE-Aktie sowie den Dividenden einer UMG-Aktie. Sollte sich das Umtauschverhältnis ändern, wird sich auch die Anzahl der UMG-Aktien als Bestandteil des Basket 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 ISINs (in Dummy-ISINs), das Produktkürzel sowie die Kontraktbezeichnung wie folgt ändern:

Produktkürzel alt/neu	Produkt-ISIN alt/neu	Basiswert-ISIN alt	Basiswert-ISIN neu	Name alt	Name neu
VVUI	DE000A18T6W9	FR0000127771	DE000A3C2D12	Vivendi SE	Vivendi-UMG-Basket
VVUP	DE000A2RPPL1	FR0000127771	DE000A3C2D12	Vivendi SE	Vivendi-UMG-Basket
1VVU	DE000A2L0MN7	FR0000127771	DE000A3C2D12	Vivendi SE	Vivendi-UMG-Basket
TVVU	DE000A2X15G3	FR0000127771	DE000A3C2D12	Vivendi SE	Vivendi-UMG-Basket
V5VU	DE000A18T6V1	XC000A1DKC44	DE000A3C2D61	Vivendi SE	Vivendi-UMG-Dividend-Basket

- Die 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 ein neuer Vivendi SE-Aktien-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 100, ein neuer Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 100, ein neuer Stock-Tracking-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 100 sowie ein neuer Vivendi SE-Aktiendividenden-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 1000 eingeführt.
- 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 Futures-Kontrakte am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung von Nachfolgekontrakten.