

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 20. September 2021

Wirksamkeitsdatum: 22. September 2021

Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Bezugsrechtsausgabe
Gesellschaft	Lufthansa AG
ISIN	DE0008232125
Regelwerk	Kontraktpezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (3), 1.13.8 (3), 1.26.11 (3), 1.27.8 (3), 2.6.10.1 (3)
Optionskontrakt auf Aktien	LHA/LHAE/LHA1/LHA2/LHA4/LHA5
Futures-Kontrakt auf Aktien	LHAF/LHAP
Equity Total Return Future	TLHA
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	L2HA

Die Gesellschaft Lufthansa AG hat die Ausgabe von Bezugsrechten an die Aktionäre bekannt gegeben. Für je eine bestehende Aktie erhalten die Aktionäre eine neue Aktie zum Ausgabepreis von EUR 3,58.

Weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe auf der Website der Gesellschaft unter www.lufthansa.com.

Die Ausgabe der Bezugsrechte führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte.

Prozedere

R-Faktor Methode

Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Der offizielle Schlussauktionspreis am letzten Cum-Handelstag dient zur Ermittlung des R-Faktors. Der R-Faktor wird mit acht Dezimalstellen ermittelt und berechnet sich wie folgt:

$$R = \left(\frac{\text{Anzahl Aktien alt}}{\text{Anzahl Aktien neu}} * \left(1 - \frac{\text{Ausgabepreis neue Aktien}}{\text{Schlussauktionspreis}} \right) \right) + \frac{\text{Ausgabepreis neue Aktien}}{\text{Schlussauktionspreis}}$$

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 Cum-Handelstages auf www.eurex.com eingestellt unter **Rules & Regs > Kapitalmaßnahmen > Informationen über Kapitalmaßnahmen**
- Neue Serien mit der Standardkontraktgröße 100 und der Versionsnummer 0 werden mit Wirkung zum Ex-Tag eingeführt.
- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Cum-Handelstag gelöscht.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Options.

Ausübungen

- Bei Ausübung einer angepassten Serie findet grundsätzlich ein Barausgleich für den nicht ganzzahligen Teil der neuen Kontraktgröße statt.
- Bei angepassten Serien ab der Version 2 kann es zu Abweichungen im Lieferprozess kommen. Im Report RPTTA111 (All Active/Inactive Series) sind die Teile der Kontraktgröße dargestellt, für welche bei der Ausübung einer angepassten Serie ein Barausgleich stattfindet.

Futures

1. 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:
Kontraktgröße neu = Kontraktgröße alt / R-Faktor
- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Cum-Handelstag gelöscht.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Futures.

2. Einführung eines neuen Kontrakts

- Es wird ein neuer Aktien-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 100, ein neuer Aktiendividenden-Future mit Standardkontraktgröße 1000 sowie ein neuer Equity Total Return Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 100 eingeführt.
- Der genaue Einführungszeitpunkt wird per Rundschreiben bekannt gegeben.
- Sobald die neuen Kontrakte zum Handel zur Verfügung stehen und 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 (LHAF/LHAP/L2HA/TLHA) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

Falls für einen der ursprünglichen Kontrakte (LHAF/LHAP/L2HA/TLHA) am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung dieses Kontraktes und keine Einführung eines neuen Kontrakts für diesen.

