

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 24. September 2021
Wirksamkeitsdatum: 29. September 2021
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Stock Split, ISIN-Änderung
Gesellschaft	Dassault Aviation SA
ISIN	FR0000121725
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (5), 1.13.8 (5), 1.26.11 (4), 1.27.8 (5), 2.6.10.1 (6)
Optionskontrakt auf Aktien	AVM
Futures-Kontrakt auf Aktien	AVMF
Equity Total Return Future	TAVM
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

Die Gesellschaft Dassault Aviation SA hat einen Aktiensplit im Verhältnis 10:1 bekannt gegeben. Jeder Aktionär erhält zehn neue Aktien für jede gehaltene Aktie.

Weitere Informationen zu dieser Transaktion finden sich auf der Website der Gesellschaft unter www.dassault-aviation.com.

Der Aktiensplit führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte mit der R-Faktor-Methode und zu einer Änderung der Stammdaten der Kontrakte. Die ISIN der neuen Aktien der Dassault Aviation SA lautet FR0014004L86 und führt zu Änderungen wie in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt:

Produktkürzel alt/neu	ISIN des Basiswerts alt	ISIN des Basiswerts neu	Produkt-ISIN alt	Produkt-ISIN neu
AVM	FR0000121725	FR0014004L86	FR0000121725	FR0014004L86
AVMF	FR0000121725	FR0014004L86	DE000A2X1W34	DE000A2X1W34
TAVM	FR0000121725	FR0014004L86	DE000A2X1Z23	DE000A2X1Z23

1. Prozedere

R-Faktor Methode

Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Anzahl Aktien alt	1
Anzahl Aktien neu	10
R-Faktor	0,10000000

2. Optionen

1. 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 der Eurex-Website www.eurex.com eingestellt unter: **Rules & Regs > Kapitalmaßnahmen > Informationen über Kapitalmaßnahmen**
- Neue Serien mit der Standardkontraktgröße 10 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.

2. 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.

3. Anpassung von Liquidity Provisioning Parameter

- Die Spread- und Size-Klassen können gemäß den in Product-Specific-Supplement-Dokument "Equity 01- Equity Options and Selected Equity Index Options" beschriebenen Regeln für Kapitalmaßnahmen angepasst werden. Die Anpassung findet zum ersten Handelstag des Folgemonats statt. Bitte entnehmen Sie die gültigen Quotierungsparameter über Veröffentlichungen auf Eurex > Trade > Market Making and Liquidity Provisioning.

3. 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 werden ein neuer Aktien-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 10 und ein neuer Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt mit einer Standardkontraktgröße von 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 AVMF und TAMV keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

Falls für die ursprünglichen Kontrakte AMVF und TAMV am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine R-Faktor-Anpassung dieser Kontrakte und keine Einführung von Folgekontrakten. Die Basiswert-ISIN ändert sich wie oben beschrieben.