

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 18. November 2021
Wirksamkeitsdatum: 10. Dezember 2021
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Abspaltung / Namensänderung
Gesellschaft	Daimler AG
ISIN	DE0007100000
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	DAI, DAI1/2/4/5, DAIE
Futures-Kontrakt auf Aktien	DAIF, DAIP
Equity Total Return Future	TDAI
Stock Tracking Future	1DAI
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	D2AI
<p>Die Gesellschaft Daimler AG hat die Abspaltung der Daimler Truck Holding AG als eigenständige Gesellschaft bekannt gegeben. Die Aktionäre der Gesellschaft Daimler AG sollen für je zwei Daimler-Aktien eine Daimler Truck Holding AG-Aktie erhalten.</p> <p>Weitere Informationen zu dieser Transaktion finden Sie auf der Website der Gesellschaft unter www.daimler.com.</p> <p>Nachstehend finden Sie eine Beschreibung des Anpassungsverfahrens.</p>	

Procedere

Basket-Methode

- Datum, zu dem die Abspaltung wirksam wird: 10.Dezember 2021
- Ab dem Stichtag wird der bisherige Basiswert durch einen Basket, bestehend aus einer Daimler-Aktie und 0,5 Daimler Truck Holding - Aktien ersetzt.
- ISIN der Daimler AG-Aktie: DE0007100000 (bleibt unverändert)
- ISIN der Daimler Truck Holding -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/ Basiswert-ISIN alt	Produkt-ISIN/ Basiswert- ISIN neu	Name alt	Name neu
DAI	DAB	DE0007100000	DE000A3C7SE8	DE0007100000	DE000A3C7SE8
DAI1	DAB1	DE000A1HUFU6	DE000A3C7SF5	DE0007100000	DE000A3C7SE8
DAI2	DAB2	DE000A1HUFV4	DE000A3C7SG3	DE0007100000	DE000A3C7SE8
DAI4	DAB4	DE000A1HUFW2	DE000A3C7SH1	DE0007100000	DE000A3C7SE8
DAI5	DAB5	DE000A1HUFX0	DE000A3C7SJ7	DE0007100000	DE000A3C7SE8
DAIE	DABE	DE000A1HUFM3	DE000A3C7SK5	DE0007100000	DE000A3C7SE8

- Ab dem Stichtag reflektiert die Daimler-Option einen Basket, bestehend aus einer Daimler-Aktie sowie 0,5 Daimler Truck Holding-Aktien. Der Wert bzw. Schlusspreis des Basiswerts der Daimler – Daimler Truck Basket-Option wird täglich wie folgt ermittelt:
**(1,00 x Preis bzw. Schlusspreis der Daimler AG-Aktie an der Xetra Börse)
plus (0.50 x Preis bzw. Schlusspreis der Daimler Truck Holding Aktie an der Xetra Börse)**
- Die Basispreise und Kontraktgrößen bleiben unverändert.
- Bei Ausübung einer Daimler – Daimler Truck -Basket-Option sind für einen Kontrakt 100 Daimler Aktien und 50 Daimler Truck Holding Aktien gegen Zahlung des Betrags Kontraktgröße x Basispreis zu liefern.
- 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 Daimler AG Option mit der Standardkontraktgröße 100 aufgesetzt. Details werden per Eurex-Rundschreiben bekannt gegeben.

Futures

- Ab dem Stichtag reflektiert der Daimler Future einen Basket bestehend aus einer Daimler AG Aktie sowie 0,5 Daimler Truck Holding Aktien. Der Wert bzw. Schlusspreis des Basiswerts des Daimler - Daimler Truck-Basket-Future wird täglich wie folgt ermittelt:
- Für den in bar abzurechnenden Kontrakt erfolgt die Anpassung über den täglichen Schlusspreis. Für diesen und den Schlussabrechnungspreis werden die jeweiligen Schlusspreise analog, wie vorstehend für die Option beschrieben, ermittelt.
(1,00 x Preis bzw. Schlusspreis der Daimler AG-Aktie an der Xetra Börse) plus (0.50 x Preis bzw. Schlusspreis der Daimler Truck Holding Aktie an der Xetra Börse)
- Ab dem Stichtag reflektiert der Daimler AG Dividenden-Future einen Basket bestehend aus der Dividende der Daimler AG Aktie sowie der Dividenden von 0,50 Daimler Truck Holding Aktien.
- 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.
- 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 eröffnet werden.

Produktkürzel alt/neu	Produkt-ISIN alt/neu	Produkt-ISIN/ Basiswert- ISIN alt	Produkt-ISIN/ Basiswert- ISIN neu	Name alt	Name neu
DAIF	DE000A0C38U4	DE0007100000	DE000A3C7SE8	Daimler AG	Daimler – Daimler Truck Basket
DAIP	DE000A2RPNS1	DE0007100000	DE000A3C7SE8	Daimler AG	Daimler – Daimler Truck Basket
D2AI	DE000A1EZJD0	XC000A1DKDA5	DE000A3C7SL3	Daimler AG Dividende	Daimler – Daimler Truck Dividende Basket
1DAI	DE000A2L0LP4	DE0007100000	DE000A3C7SE8	Daimler AG	Daimler – Daimler Truck Basket
TDAI	DE000A2X1Z07	DE0007100000	DE000A3C7SE8	Daimler AG	Daimler – Daimler Truck Basket

- Es wird ein neuer DAI Aktien-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 100 sowie ein neuer Daimler Aktiendividenden-Future 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 Kontrakte am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung und keine Einführung eines neuen Kontrakts