

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 02. Dezember 2021

Wirksamkeitsdatum: 11. März 2022

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

| Kapitalmaßnahme | Sonderdividende |
|---------------------------------------|---|
| Gesellschaft | CA Immobilien Anlagen AG |
| ISIN | AT0000641352 |
| Regelwerk | Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (2), 1.13.8 (2), 1.26.11 (2), 2.6.10.1 (2) |
| Optionskontrakt auf Aktien | CAI |
| Futures-Kontrakt auf Aktien | CAIF |
| Stock Tracking Future | |
| Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden | |

Die Gesellschaft CA Immobilien Anlagen AG hat am 30.11.2021 im Rahmen einer außerordentlichen Hauptversammlung die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von EUR 5.00 je Aktie zahlbar in 2 Tranchen je EUR 2.50 (Ex Tag 10.12.2021 1. Tranche / Ex Tag 11.03.2022 2. Tranche) beschlossen.

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

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte.

Prozedere

R-Faktor Methode

Bestimmung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

| | |
|----------|--------------------------------|
| S1 | Schlussauktionspreis der Aktie |
| S2 | S1 minus Sonderdividende |
| R-Faktor | $S2 / S1$ |

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 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.

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.

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:
 $\text{Kontraktgröße neu} = \text{Kontraktgröße alt} / \text{R-Faktor}$
- 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 eingeführt 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 (CAIF) keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

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