

## Kapitalmaßnahmeinformation

**Ausstellungsdatum:** 27. April 2022  
**Wirksamkeitsdatum:** Wird noch bekannt gegeben  
**Kontakt:** Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
<b>Gesellschaft</b>	<b>Atlantia S.P.A</b>
<b>ISIN</b>	IT0003506190
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7(7), 1.13.8 (7), 1.26.11 (6), 1.27.8 (7), 2.6.10 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	AOP5
Futures-Kontrakt auf Aktien	AOPH
Equity Total Return Future	TAOP
Stock Tracking Future	-
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	A2OP

Das Unternehmen Schemaquarantatrè hat am in einer gemeinsamen Pressemitteilung am 14. April 2022 bekannt gegeben, dass beabsichtigen, den Aktionären der Atlantia S.P.A ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre von Atlantia S.P.A EUR 23,00 in bar für jede Stammaktie erhalten. Für weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe die Website der Gesellschaft unter [www.atlantia.com](http://www.atlantia.com)

Nachfolgend möchten wir Sie über die potenziellen Auswirkungen dieser Transaktion auf die oben aufgeführten Kontrakte informieren.

## Prozedere

### Fair Value Methode

Die Eurex-Optionen, der Eurex Aktien-Futures-Kontrakt, sowie der Eurex Aktiendividenden-Future auf Atlantia werden zum theoretisch fairen Wert abgerechnet, sofern die Voraussetzungen in den Kontrakt-spezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer 1.6.7 (7) für Eurex Aktien-Futures-Kontrakte, 1.14.8 (7) für Eurex Aktiendividenden-Future-Kontrakte und Ziffer 2.6.10.1 (7) für Eurex Options-Kontrakte, erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in Atlantia-Kontrakten unverändert fortgeführt. Für die Berechnung des theoretischen fairen Wertes werden folgende Parameter festgelegt:

### Option

#### Implizite Volatilität

Für jede Serie wird eine implizite Volatilität festgelegt. Diese bestimmt sich nach dem Durchschnitt der impliziten Volatilität der täglichen Settlement-Preise, die an den zehn Börsentagen, die der Ankündigung des Angebots vorausgingen (31. März 2022 bis 13. April 2022), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet.

Verfall Jahr	Verfall Monat	Basispreis	Implied volatility
2022	Juni	1000	50,98
2022	Juni	1100	46,08
2022	Juni	1200	45,39
2022	Juni	1300	42,06
2022	Juni	1400	40,68
2022	Juni	1500	36,96
2022	Juni	1550	35,32
2022	Juni	1600	33,68
2022	Juni	1650	32,39
2022	Juni	1700	31,01
2022	Juni	1750	30,04
2022	Juni	1800	29,21
2022	Juni	1850	28,53
2022	Juni	1900	28,02
2022	Juni	1950	27,58
2022	Juni	2000	27,38
2022	Juni	2100	27,06
2022	Juni	2200	27,10
2022	Juni	2300	26,16
2022	Juni	2400	28,02
2022	Juni	2500	27,06
2022	Juni	2600	27,56
2022	September	1100	41,91
2022	September	1200	39,73
2022	September	1300	36,92
2022	September	1400	34,98
2022	September	1500	32,43
2022	September	1600	30,41
2022	September	1700	28,52
2022	September	1800	27,13

2022	September	1900	26,06
2022	September	2000	25,30
2022	September	2200	24,63
2022	September	2400	24,69
2022	September	2600	24,00
2022	September	2800	23,51
2022	September	3000	23,74
2022	Dezember	720	56,97
2022	Dezember	800	49,96
2022	Dezember	1000	45,00
2022	Dezember	1100	39,06
2022	Dezember	1200	37,14
2022	Dezember	1300	34,78
2022	Dezember	1400	33,20
2022	Dezember	1500	31,08
2022	Dezember	1600	29,32
2022	Dezember	1700	27,87
2022	Dezember	1800	26,69
2022	Dezember	1900	25,77
2022	Dezember	2000	25,07
2022	Dezember	2200	24,18
2022	Dezember	2400	23,91
2022	Dezember	2600	23,95
2022	Dezember	2800	24,11
2022	Dezember	3000	24,50
2022	Dezember	3200	24,71
2023	Juni	720	37,09
2023	Juni	800	36,50
2023	Juni	1000	35,00
2023	Juni	1200	33,57
2023	Juni	1400	30,54
2023	Juni	1600	27,93
2023	Juni	1800	25,97
2023	Juni	2000	24,88
2023	Juni	2400	24,06
2023	Juni	2800	24,23
2023	Juni	3200	24,84
2023	Juni	3600	25,00
2023	Juni	4000	25,00

## Option und Single Stock Future

### Zinssatz und Dividende

Bei der Ermittlung des fairen Wertes werden implizite Zinssätze zugrunde gelegt. Folgende Dividendendaten werden bei der Bestimmung der impliziten Volatilität verwendet und bei der Festlegung der fairen Werte zugrunde gelegt, sofern der Abrechnungstag der Kontrakte vor dem Ex-Tag liegt:

<b>Dividendenbetrag in Euro</b>	<b>Ex-Tag</b>
0,27	22.11.2022
0,45	17.05.2023
0,25	22.11.2023
0,45	17.05.2024

### **Aktiendividenden Future**

Der faire Wert für jeden Kontrakt wird als Durchschnitt der täglichen Settlement-Preise, die für den jeweiligen Kontrakt an den zehn Börsentagen vor der Bekanntmachung des Angebots (31. März 2022 bis 13. April 2022) festgelegt wurden, berechnet. Die fairen Werte sind als Durchschnittspreise in der nachfolgenden Tabelle ausgewiesen:

<b>Verfalljahr</b>	<b>Verfallmonat</b>	<b>Durchschnittspreis</b>
2022	06	0.7400
2022	09	0.7400
2022	12	1.05500
2023	03	0
2023	06	0.5250
2023	12	0.8160
2024	12	0.8160
2025	12	0.8160
2026	12	0.8160

Mit sofortiger Wirkung werden für die Eurex-Optionen, den Eurex Future auf Atlantia in der Regel keine neuen Serien mehr eingeführt. Serien ohne offene Positionen werden gelöscht.

Über den weiteren Ablauf werden wir Sie informieren, sofern Änderungen bzw. neue Informationen im Verlauf der Transaktion dies erforderlich machen.