

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 29. April 2022

Wirksamkeitsdatum: 02. Mai 2022

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

Kapitalmaßnahme	Notierungseinstellung
Gesellschaft	Steinhoff International Holdings NV
ISIN	NL0011375019
Regelwerk	Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffern 1.6.9, 2.6.15
Optionskontrakt auf Aktien	SNH
Futures-Kontrakt auf Aktien	SNHF

Die Frankfurter Wertpapierbörse hat am 20. April 2022 bekannt gegeben, dass der Handel in den Aktien der Steinhoff International Holdings NV auf dem Handelsplatz Xetra (XETR) per 29. April 2022 nach Handelsschluss eingestellt wird.

Mit dem Wirksamwerden der Notierungseinstellung der Aktien der Steinhoff International Holdings NV am Handelsplatz Xetra wird der Handel gemäß der Ziffern 1.6.9 und 2.6.15 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland der Handel in den genannten Kontrakten auf Steinhoff International Holdings NV eingestellt. Demnach endet der Handel in den genannten Kontrakten mit Ablauf des 29. April 2022. Offene Positionen, die nach Handelsschluss am 29 April 2022 in den betroffenen Kontrakten bestehen, werden zum theoretisch fairen Wert letztmalig abgerechnet.

Alle Teilnehmer mit offenen Positionen erhalten am 02. Mai 2022 eine Mitteilung mit einer Übersicht aller ihrer jeweils offenen Positionen. Die Buchung der entsprechenden Salden erfolgt am 02. Mai 2022 mit Valuta 03. Mai 2022. Die Positionen werden in der Tagesendverarbeitung vom 03. Mai 2022 mit Wirkung zum 04. Mai 2022 ausgebucht.

Nachfolgend finden sich weitere Einzelheiten.

Prozedere

Fair Value Methode

Offene Positionen in den betroffenen Kontrakten werden zum theoretisch fairen Wert letztmalig abgerechnet. Als Referenzpreis für die Berechnung der Schlussabrechnungspreise der betroffenen Kontrakte dient der Schlussauktionspreis der Aktie der Steinhoff International Holdings NV auf Xetra vom 29. April 2022 oder der letzte Handelspreis des fortlaufenden Handels auf Xetra, sofern kein Schlussauktionspreis zustande kommt.

Optionen

Implizite Volatilität

Für jede Serie wird eine implizite Volatilität festgelegt. Diese bestimmt sich als Durchschnitt der impliziten Volatilitäten der täglichen Settlement-Preise, die an den zehn Börsentagen, die der Ankündigung der Notierungseinstellung vorangingen (04. April 2022 - 19. April 2022), festgelegt worden sind. Der jeweils höchste und niedrigste Wert wird gelöscht. Die impliziten Volatilitäten der Optionsserien mit offenen Positionen sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt:

Verfalljahr	Verfallmonat	Basispreis	Implizite Volatilität
2023	Dezember	0,40	71,51
2024	Juni	0,40	69,97

In die Berechnung der theoretischen Werte fließen tagesaktuelle implizite Zinssätze ein, Dividenden finden keine Berücksichtigung.

Futures

In den Futures-Kontrakten SNHF bestehen keine offenen Positionen.