

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 06. Mai 2022

Wirksamkeitsdatum: 10. Mai 2022

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

Kapitalmaßnahme	Sonderdividende
Gesellschaft	ING Groep NV
ISIN	NL0011821202
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	INN, ING1, ING2, ING4, ING5, INNE
Futures-Kontrakt auf Aktien	INNG, INNP
Stock Tracking Future	1INN
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	I2NN

Die Gesellschaft ING Groep NV hat die Ausschüttung einer Zusatzdividende in Höhe von EUR 0,232 je Aktie bekannt gegeben.

Weitere Informationen zu dieser Sonderausschüttung finden sich auf der Website der Gesellschaft www.ing.com.

Die Ausschüttung der Zusatzdividende führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte.

Prozedere

R-Faktor Methode

Bestimmung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

S1	Schlussauktionspreis der Aktie
S2	S1 minus Zusatzdividende
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.

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 neuer Kontrakte

- Es werden neue Futures-Kontrakte mit den jeweiligen Standardkontraktgrößen 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 eingestellt.
- Ferner werden in den ursprünglichen Kontrakten I2NN, INNG und INNP keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

Sollten am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen in den ursprünglichen Kontrakten bestehen, werden diese Kontrakte nicht angepasst und keine Nachfolgekongtrakte eingeführt.