

## Kapitalmaßnahmeinformation

**Ausstellungsdatum:** 21. Juli 2022  
**Wirksamkeitsdatum:** Wird noch bekannt gegeben  
**Kontakt:** Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
<b>Gesellschaft</b>	<b>Electricité de France S.A. (EDF SA)</b>
<b>ISIN</b>	<b>FR0010242511</b>
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffern 1.6.7 (7), 1.13.8 (7), 1.26.11 (6), 2.6.10.1 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	E2F
Futures-Kontrakt auf Aktien	E2FG, E2FH, E2FP
Equity Total Return Future	TE2F
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	E3DF, E6DF

In einer Mitteilung vom 19. Juli 2022 hat das zuständige französische Ministerium bekannt gegeben, den Aktionären der Gesellschaft EDF SA ein freiwilliges Übernahmeangebot zu unterbreiten, um die Gesellschaft vollständig in staatliche Hand zu überführen. Der Ankündigung zufolge sollen die Aktionäre der EDF SA EUR 12,00 in bar für jede Aktie erhalten. Nach Ablauf des Angebots soll ein Squeeze-out-Prozedere eingeleitet werden.

Weitere Informationen zu dieser Transaktion finden sich auf der Website der Zielgesellschaft unter [www.edf.fr](http://www.edf.fr) bzw. auf der Website des zuständigen Ministeriums unter [presse.economie.gouv.fr/](http://presse.economie.gouv.fr/).

Nachfolgend werden die Auswirkungen dieser Transaktion auf die oben aufgeführten Kontrakte erläutert.

## Prozedere

### Fair Value Methode

Die an der Eurex gelisteten Futures- und Optionskontrakte, die sich auf Aktien der EDF SA beziehen, werden zum theoretisch fairen Wert abgerechnet, sofern die Voraussetzungen in den Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer 1.6.7 (7) für Aktien-Futures-Kontrakte, Ziffer 1.13.8 (7) für Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden, Ziffer 1.26.11 (6) für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte und Ziffer 2.6.10.1 (7) für Optionskontrakte erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in den Kontrakten, die sich auf die Aktien der EDF SA beziehen, unverändert fortgeführt. Für die Berechnung des theoretischen fairen Wertes werden folgende Parameter festgelegt:

### Optionskontrakte

#### 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 Mitteilung des zuständigen französischen Ministeriums vom 13. Juli 2022 vorausgingen (29. Juni 2022 bis 12. Juli 2022), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet. Die impliziten Volatilitäten für Serien mit offenen Positionen beginnend mit Fälligkeit September 2022 sind in der nachfolgenden Tabelle ausgewiesen:

Verfallsjahr	Verfallsmonat	Basispreis (Versionsnr.)	Implizite Volatilität
2022	9	6	62,86
2022	9	6.1	62,34
2022	9	6.12 (1)	62,00
2022	9	6.2	61,87
2022	9	6.5 (1)	61,21
2022	9	6.8	60,70
2022	9	6.88 (1)	60,00
2022	9	7.2	59,00
2022	9	7.27 (1)	58,00
2022	9	7.5	56,81
2022	9	7.6	56,53
2022	9	7.65 (1)	56,40
2022	9	7.8	55,90
2022	9	8	55,33
2022	9	8.03 (1)	55,33
2022	9	8.2	54,71
2022	9	8.4	54,30
2022	9	8.41 (1)	54,30
2022	9	8.5	54,14
2022	9	8.6	54,00
2022	9	8.8	53,36
2022	9	8.8 (1)	53,36
2022	9	9	53,20
2022	9	9.1	53,00

2022	9	9.18 (1)	53,00
2022	9	9.2	52,87
2022	9	9.56 (1)	52,87
2022	9	9.6	52,53
2022	9	10	52,33
2022	9	10.5	52,50
2022	9	10.52 (1)	52,50
2022	9	11	52,66
2022	9	11.47 (1)	53,00
2022	9	11.5	53,00
2022	9	12	53,31
2022	9	12.43 (1)	53,30
2022	9	13.39 (1)	53,60
2022	9	14.34 (1)	53,92
2022	9	15.30 (1)	53,71
2022	12	5.35 (1)	54,62
2022	12	5.74 (1)	53,00
2022	12	6.12 (1)	52,00
2022	12	6.5 (1)	50,93
2022	12	6.8	50,44
2022	12	6.88 (1)	50,00
2022	12	7.2	49,00
2022	12	7.27 (1)	48,33
2022	12	7.6	47,66
2022	12	7.65 (1)	47,66
2022	12	8	46,44
2022	12	8.03 (1)	46,44
2022	12	8.4	46,00
2022	12	8.41 (1)	46,00
2022	12	8.8	44,71
2022	12	8.8 (1)	44,71
2022	12	9.18 (1)	44,71
2022	12	9.2	44,71
2022	12	9.56 (1)	43,40
2022	12	9.6	43,40
2022	12	10	42,75
2022	12	10.52 (1)	42,60
2022	12	11	42,46
2022	12	11.47 (1)	42,10
2022	12	12	41,88
2022	12	12.43 (1)	41,88
2022	12	13.39 (1)	41,96
2022	12	14.34 (1)	42,20
2022	12	15.30 (1)	42,60
2022	12	17.21 (1)	43,00
2022	12	19.12 (1)	43,05
2023	3	6.4	45,87
2023	3	6.8	45,14
2023	3	7.6	43,33
2023	3	8	42,46

2023	3	8.4	41,68
2023	3	8.8	41,07
2023	3	9.2	40,40
2023	3	9.6	40,06
2023	3	10	39,51
2023	3	11	38,91
2023	3	12	38,58
2023	6	6.12 (1)	47,40
2023	6	6.4	47,01
2023	6	6.8	45,92
2023	6	6.88 (1)	45,40
2023	6	7.65 (1)	44,30
2023	6	8	43,76
2023	6	8.41 (1)	43,14
2023	6	8.8	42,66
2023	6	9.18 (1)	42,28
2023	6	9.2	42,28
2023	6	9.56 (1)	41,87
2023	6	10	41,57
2023	6	11.47 (1)	41,00
2023	6	12	40,58
2023	6	13.39 (1)	40,40
2023	6	15.30 (1)	40,10
2023	6	19.12 (1)	41,00
2023	12	4.21 (1)	44,16
2023	12	5.35 (1)	42,00
2023	12	6.12 (1)	40,17
2023	12	6.88 (1)	38,00
2023	12	7.2	37,22
2023	12	7.65 (1)	37,00
2023	12	8	36,25
2023	12	8.41 (1)	36,00
2023	12	9.18 (1)	35,00
2023	12	9.56 (1)	34,88
2023	12	9.6	34,88
2023	12	10.52 (1)	34,55
2023	12	11.47 (1)	34,40
2023	12	12	34,28
2023	12	14	34,75
2023	12	15.30 (1)	35,00
2023	12	17.21 (1)	36,25
2023	12	19.12 (1)	37,40
2024	6	6.88 (1)	38,00
2024	6	7.65 (1)	37,00
2024	6	11.47 (1)	35,70
2024	6	19.12 (1)	36,76
2024	12	4.21 (1)	43,50
2024	12	5.35 (1)	42,00
2024	12	7.65 (1)	37,40
2024	12	8	37,00

2024	12	9.18 (1)	36,00
2024	12	9.56 (1)	35,90
2024	12	10	35,64
2024	12	11.47 (1)	35,20
2025	12	7.65 (1)	38,00
2026	12	10	37,60

## Aktioptionskontrakte und Aktien-Futures-Kontrakte

### Zinssatz und Dividende

Bei der Ermittlung des fairen Wertes werden implizite Zinssätze vom Settlement-Tag 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:

Dividendenbetrag in Euro	Ex-Tag
0,0300	01.12.2022
0,1000	12.06.2023
0,0700	04.12.2023
0,1700	22.05.2024
0,1100	04.12.2024
0,1900	28.05.2025
0,1100	04.12.2025
0,1900	28.05.2026
0,1100	04.12.2026

### Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden

Der faire Wert für jeden Kontrakt wird als Durchschnitt der täglichen Settlement-Preise, die für den jeweiligen Kontrakt an den zehn Börsentagen, die der Mitteilung des zuständigen französischen Ministeriums vom 13. Juli 2022 vorausgingen, (29. Juni 2022 bis 12. Juli 2022), festgelegt wurden, berechnet. Die fairen Werte sind als Durchschnittspreise in der nachfolgenden Tabelle ausgewiesen:

Verfallsjahr	Verfallsmonat	Durchschnittspreis
2022	12	0.3170
2023	12	0.2070

Mit sofortiger Wirkung werden für die betreffenden Futures- und Optionskontrakte 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.