

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 08. August 2022
Wirksamkeitsdatum: 01. September 2022
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Sonderdividende
Gesellschaft	Glencore Plc
ISIN	JE00B4T3BW64
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	GLEN
Futures-Kontrakt auf Aktien	GLEG
Stock Tracking Future	-
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	G2LE, G3LE

Die Gesellschaft Glencore Plc hat die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von US\$ 0,11 je Aktie zusätzlich zu einer regulären Dividende in Höhe von US\$ 0,13 bekannt gegeben.

Weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe auf der Website der Gesellschaft unter www.glencore.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 reguläre Dividende
S3	S2 minus Sonderdividende
R-Faktor	$S3 / S2$

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 1000 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 eines neuen Kontrakts

- Es wird ein neuer Aktien-Futures-Kontrakt eingeführt mit Standardkontraktgröße 1000 und ein neuer Aktiendividenden-Future mit Standardkontraktgröße 1000 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 **GLEG/G2LE/G3LE** keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

Falls für einen der ursprünglichen Kontrakte **GLEG/G2LE/G3LE am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung dieses Kontraktes und keine Einführung eines neuen Kontrakts für diesen.**