

Kapitalmaßnahmeinformation 003

Ausstellungsdatum: 09. Februar 2023

Wirksamkeitsdatum: 09. Februar 2023

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

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Electricité de France S.A. (EDF SA)
ISIN	FR0010242511
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	E2F
Futures-Kontrakt auf Aktien	E2FH, E2FP
Equity Total Return Future	TE2F
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	E3DF, E6DF

In einer Mitteilung vom 08. Februar 2023 hat die französische Finanzaufsichtsbehörde AMF das Ergebnis des Übernahmeangebotes des französischen Staats an die Aktionäre der Electricité de France, welches am 03. Februar endete, bekannt gegeben. Das Settlement des Angebotes findet gemäß des von Euronext veröffentlichten Zeitplans statt.

Daher werden gemäß den Kontraktspezifikationen der Eurex Deutschland und wie bereits in der Kapitalmaßnahmeinformationen 001 und 002 beschrieben, bestehende Positionen in den Futures- und Optionskontrakten zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Basis für die Berechnung der fairen Werte ist der Angebotspreis in Höhe von EUR 12,00.

Die Schlussabrechnungspreise für die Futures- und Optionskontrakte mit offenen Positionen finden sich in den unten aufgeführten Tabellen.

Alle Teilnehmer mit offenen Optionspositionen erhalten an 09. Februar 2023 eine Mitteilung mit einer Übersicht ihrer jeweils offenen Positionen. Die Buchung der entsprechenden Salden erfolgt ebenfalls an 09. Februar 2023, mit Valuta 10. Februar 2023. Die Positionen werden in der Tagesendverarbeitung vom 10. Februar 2023 mit Wirkung zum 13. Februar 2023 ausgebucht.

Der Handel in den oben genannten Kontrakten wurde am 08. Februar 2023 nach Handelsschluss eingestellt.

Schlussabrechnungspreise für Optionskontrakte mit offenen Positionen:

Zugrundeliegender Angebotspreis als Referenzpreis: EUR 12,00

Kontrakt	Schlussabrechnungspreis
E2F MAR 2023 CALL 6,4 0	5,62
E2F MAR 2023 PUT 6,4 0	0,01
E2F MAR 2023 CALL 6,8 0	5,22
E2F MAR 2023 PUT 6,8 0	0,01
E2F MAR 2023 CALL 7,6 0	4,42
E2F MAR 2023 PUT 7,6 0	0,01
E2F MAR 2023 CALL 8 0	4,02
E2F MAR 2023 PUT 8 0	0,01
E2F MAR 2023 CALL 8,4 0	3,62
E2F MAR 2023 PUT 8,4 0	0,01
E2F MAR 2023 CALL 8,8 0	3,23
E2F MAR 2023 PUT 8,8 0	0,01
E2F MAR 2023 CALL 9,2 0	2,83
E2F MAR 2023 PUT 9,2 0	0,01
E2F MAR 2023 CALL 9,6 0	2,45
E2F MAR 2023 PUT 9,6 0	0,02
E2F MAR 2023 CALL 10 0	2,07
E2F MAR 2023 PUT 10 0	0,04
E2F MAR 2023 CALL 11 0	1,23
E2F MAR 2023 PUT 11 0	0,20
E2F MAR 2023 CALL 12 0	0,61
E2F MAR 2023 PUT 12 0	0,58
E2F JUN 2023 CALL 6,12 1	5,94
E2F JUN 2023 PUT 6,12 1	0,01
E2F JUN 2023 CALL 6,4 0	5,67
E2F JUN 2023 PUT 6,4 0	0,01
E2F JUN 2023 CALL 6,8 0	5,28
E2F JUN 2023 PUT 6,8 0	0,02
E2F JUN 2023 CALL 6,88 1	5,20
E2F JUN 2023 PUT 6,88 1	0,02
E2F JUN 2023 CALL 7,65 1	4,46
E2F JUN 2023 PUT 7,65 1	0,05
E2F JUN 2023 CALL 8 0	4,13
E2F JUN 2023 PUT 8 0	0,07

E2F JUN 2023 CALL 8,41 1	3,75
E2F JUN 2023 PUT 8,41 1	0,10
E2F JUN 2023 CALL 8,8 0	3,40
E2F JUN 2023 PUT 8,8 0	0,14
E2F JUN 2023 CALL 9,18 1	3,08
E2F JUN 2023 PUT 9,18 1	0,19
E2F JUN 2023 CALL 9,2 0	3,06
E2F JUN 2023 PUT 9,2 0	0,20
E2F JUN 2023 CALL 9,56 1	2,76
E2F JUN 2023 PUT 9,56 1	0,26
E2F JUN 2023 CALL 10 0	2,42
E2F JUN 2023 PUT 10 0	0,36
E2F JUN 2023 CALL 11,47 1	1,47
E2F JUN 2023 PUT 11,47 1	0,88
E2F JUN 2023 CALL 12 0	1,19
E2F JUN 2023 PUT 12 0	1,14
E2F JUN 2023 CALL 13,39 1	0,67
E2F JUN 2023 PUT 13,39 1	2,01
E2F JUN 2023 CALL 15,3 1	0,27
E2F JUN 2023 PUT 15,3 1	3,52
E2F JUN 2023 CALL 19,12 1	0,04
E2F JUN 2023 PUT 19,12 1	7,12
E2F DEC 2023 CALL 4,21 1	7,83
E2F DEC 2023 PUT 4,21 1	0,01
E2F DEC 2023 CALL 5,35 1	6,71
E2F DEC 2023 PUT 5,35 1	0,02
E2F DEC 2023 CALL 6,12 1	5,98
E2F DEC 2023 PUT 6,12 1	0,04
E2F DEC 2023 CALL 6,88 1	5,27
E2F DEC 2023 PUT 6,88 1	0,07
E2F DEC 2023 CALL 7,2 0	4,97
E2F DEC 2023 PUT 7,2 0	0,09
E2F DEC 2023 CALL 7,65 1	4,57
E2F DEC 2023 PUT 7,65 1	0,14
E2F DEC 2023 CALL 8 0	4,26
E2F DEC 2023 PUT 8 0	0,17
E2F DEC 2023 CALL 8,41 1	3,92
E2F DEC 2023 PUT 8,41 1	0,23
E2F DEC 2023 CALL 9,18 1	3,30
E2F DEC 2023 PUT 9,18 1	0,36
E2F DEC 2023 CALL 9,56 1	3,02
E2F DEC 2023 PUT 9,56 1	0,46
E2F DEC 2023 CALL 9,6 0	2,99

E2F DEC 2023 PUT 9,6 0	0,47
E2F DEC 2023 CALL 10,52 1	2,38
E2F DEC 2023 PUT 10,52 1	0,76
E2F DEC 2023 CALL 11,47 1	1,85
E2F DEC 2023 PUT 11,47 1	1,17
E2F DEC 2023 CALL 12 0	1,59
E2F DEC 2023 PUT 12 0	1,43
E2F DEC 2023 CALL 14 0	0,91
E2F DEC 2023 PUT 14 0	2,73
E2F DEC 2023 CALL 15,3 1	0,62
E2F DEC 2023 PUT 15,3 1	3,74
E2F DEC 2023 CALL 17,21 1	0,38
E2F DEC 2023 PUT 17,21 1	5,41
E2F DEC 2023 CALL 19,12 1	0,24
E2F DEC 2023 PUT 19,12 1	7,19
E2F JUN 2024 CALL 6,88 1	5,41
E2F JUN 2024 PUT 6,88 1	0,20
E2F JUN 2024 CALL 7,65 1	4,77
E2F JUN 2024 PUT 7,65 1	0,31
E2F JUN 2024 CALL 11,47 1	2,33
E2F JUN 2024 PUT 11,47 1	1,59
E2F JUN 2024 CALL 19,12 1	0,51
E2F JUN 2024 PUT 19,12 1	7,32
E2F DEC 2024 CALL 4,21 1	7,85
E2F DEC 2024 PUT 4,21 1	0,07
E2F DEC 2024 CALL 5,35 1	6,82
E2F DEC 2024 PUT 5,35 1	0,16
E2F DEC 2024 CALL 7,65 1	4,92
E2F DEC 2024 PUT 7,65 1	0,48
E2F DEC 2024 CALL 8 0	4,66
E2F DEC 2024 PUT 8 0	0,55
E2F DEC 2024 CALL 9,18 1	3,86
E2F DEC 2024 PUT 9,18 1	0,88
E2F DEC 2024 CALL 9,56 1	3,63
E2F DEC 2024 PUT 9,56 1	1,01
E2F DEC 2024 CALL 10 0	3,37
E2F DEC 2024 PUT 10 0	1,17
E2F DEC 2024 CALL 11,47 1	2,63
E2F DEC 2024 PUT 11,47 1	1,83
E2F DEC 2026 CALL 10 0	4,26
E2F DEC 2026 PUT 10 0	2,10

**Schlussabrechnungspreis für offene Positionen in Futures-Kontrakten auf
Aktividenden:**

Kontrakt	Schlussabrechnungspreis
E3DF DEC23	0,2070