

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 20. Februar 2023
Wirksamkeitsdatum: 24. Februar 2023
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

| | |
|-----------------------------|--|
| Kapitalmaßnahme | Aktienzusammenlegung und ISIN-Änderung |
| Gesellschaft | TUI AG |
| ISIN | DE000TUAG000 |
| Regelwerk | Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (5), 1.13.8 (5), 1.26.11 (4), 1.27.8 (5), 2.6.10.1 (6) |
| Optionskontrakt auf Aktien | TUI |
| Futures-Kontrakt auf Aktien | TUIG |
| | |
| | |
| | |

Die Gesellschaft TUI AG hat die Zusammenlegung ihrer Stammaktien im Verhältnis 10:1 an die Aktionäre bekannt gegeben.

Weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe auf der Website der Gesellschaft.

Die Zusammenlegung der Aktien führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte. Die Änderung der ISIN erfolgt entsprechend der Angaben der folgenden Tabelle:

| Produktkürzel alt/neu | ISIN des Basiswerts alt | ISIN des Basiswerts neu | Produkt ISIN alt | Produkt ISIN neu |
|-----------------------|-------------------------|-------------------------|------------------|------------------|
| TUI | DE000TUAG000 | DE000TUAG505 | DE000TUAG000 | DE000TUAG505 |
| TUIG | DE000TUAG000 | DE000TUAG505 | DE000A3DCNA5 | DE000A3DCNA5 |

Die aktualisierten Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Options-Kontrakte an der Eurex Deutschland werden auf der Eurex-Website www.eurex.com eingestellt unter:

Rules & Regs > Kapitalmaßnahmen > Informationen über Kapitalmaßnahmen

Prozedere

R-Faktor Methode

Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

| | |
|-------------------|-------------|
| Anzahl Aktien alt | 10 |
| Anzahl Aktien neu | 1 |
| R-Faktor | 10.00000000 |

Optionen

1. Anpassung der Basispreise und Kontraktgrößen

- Die bestehenden Basispreise werden mit dem R-Faktor multipliziert. Basispreise werden nach mathematischen Rundungsregeln auf die ihrem Notierungsstandard entsprechende Anzahl von Dezimalstellen auf- oder abgerundet.
- 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 erst nach Durchführung der geplanten Kapitalerhöhung 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. Die existierenden Flexiblen Basispreise werden nach mathematischen Rundungsregeln auf vier Dezimalstellen auf- oder abgerundet.

2. Ausübungen

- Bei Ausübung einer angepassten Serie findet grundsätzlich ein Barausgleich für den nicht ganzzahligen Teil der neuen Kontraktgröße statt.
- Report RPTTA711 (All Active/Inactive Series) weist die Kontraktgrößen der angepassten Serien aus.

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 100 eingeführt.
- Der genaue Einführungszeitpunkt wird per Rundschreiben bekannt gegeben.
- Der genaue Einführungszeitpunkt wird per Rundschreiben bekannt gegeben.
- Ab dem Anpassungstag werden keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.
- Sobald keine Verfallmonate mit offenen Positionen in den angepassten Kontrakten mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesen Kontrakten eingestellt.

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