

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 24. März 2023
Wirksamkeitsdatum: Wird noch bekannt gegeben
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Telenet Group Holding
ISIN	BE0003826436
Regelwerk	Kontraktsspezifikationen 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	TNET
Futures-Kontrakt auf Aktien	TELH
Equity Total Return Future	TTNE
Stock Tracking Future	-
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	-

Die Unternehmen Telenet Group Holding und Liberty Global plc haben in einer gemeinsamen Pressemitteilung am 21. März 2023 bekannt gegeben, dass Liberty Global plc beabsichtigt, den Aktionären der Telenet Group Holding ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre der Telenet Group Holding EUR 22,00 in bar für jede Stammaktie erhalten. Für weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe die Website der Gesellschaft unter www.telenet.be

Nachfolgend möchten wir Sie über die potenziellen Auswirkungen dieser Transaktion auf die oben aufgeführten Kontrakte informieren.

Prozedere

Fair Value Methode

Die Eurex-Optionen, der Eurex Aktien-Futures-Kontrakt auf Telenet Group Holding werden zum theoretisch fairen Wert abgerechnet, sofern die Voraussetzungen in den Kontrakt-spezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer 1.6.7 (7) für Eurex Aktien-Futures-Kontrakte, 1.14.8 (7) für Eurex Aktiendividenden-Future-Kontrakte und Ziffer 2.6.10.1 (7) für Eurex Options-Kontrakte, erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in Telenet Group Holding - Kontrakten unverändert fortgeführt. Für die Berechnung des theoretischen fairen Wertes werden folgende Parameter festgelegt:

Option

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 Ankündigung des Angebots vorausgingen (3. März 2023 bis 16. März 2023), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet.

Verfallsjahr	Verfallsmonat	Basispreis	Implizite Volatilität
2023	6	12	38,16
2023	6	13	36,22
2023	6	14	35,60
2023	6	15	35,89
2023	6	16	37,02
2023	6	17	38,58
2023	6	18	40,52
2023	6	19	42,31
2023	6	20	44,50
2023	6	21	46,39
2023	6	22	48,31
2023	6	23	50,78
2023	6	24	51,66
2023	6	28	51,36
2023	6	32	50,78
2023	9	11	36,77
2023	9	12	35,21
2023	9	13	34,19
2023	9	14	33,99
2023	9	15	34,34
2023	9	16	34,95
2023	9	17	35,78
2023	9	18	36,69
2023	9	19	37,58
2023	9	20	38,77
2023	9	21	39,74
2023	9	22	40,90
2023	9	23	42,07

2023	9	24	43,23
2023	9	25	44,24
2023	9	26	45,37
2023	12	14	33,57
2023	12	15	33,57
2023	12	16	33,83
2023	12	17	34,08
2023	12	18	34,57
2023	12	19	35,23
2023	12	20	35,90
2023	12	21	36,83
2023	12	22	37,60
2023	12	23	38,79
2023	12	24	39,91
2023	12	25	41,08
2023	12	28	44,76
2023	12	32	49,45
2024	6	10	38,53
2024	6	12	36,40
2024	6	14	35,81
2024	6	16	35,88
2024	6	18	36,35
2024	6	20	37,02
2024	6	22	37,71
2024	6	24	38,52
2024	6	28	40,22
2024	6	32	43,35

Option und Single Stock Future

Zinssatz und Dividende

Bei der Ermittlung des fairen Wertes werden implizite Zinssätze 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
1,10	08.05.2024

Mit sofortiger Wirkung werden für die Eurex-Optionen, den Eurex Future auf Telenet Group Holding 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.