EUREX

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungdatum: 21. April 2023

Wirksamkeitsdatum: Wird noch bekannt gegeben

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

Kapitalmaßnahme	**Übernahme**
Gesellschaft	**Rovio Entertainment OYJ**
ISIN	**FI4000266804**
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	ROV
Futures-Kontrakt auf Aktien	-
Equity Total Return Future	-
Stock Tracking Future	-
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	-

Die Unternehmen Rovio Entertainment OYJ und Sega Sammy Holdings Inc. haben in einer gemeinsamen Pressemitteilung am 17. April 2023 bekannt gegeben, dass Sega Sammy Holdings Inc. beabsichtigt, den Aktionären der Rovio Entertainment OYJ ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre der Rovio Entertainment OYJ EUR 9,25 in bar für jede Stammaktie erhalten. Für weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe die Website der Gesellschaft.

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

EUREX Deutschland
Börsenplatz 4
60313 Frankfurt/Main
Mailing adress:
60485 Frankfurt/Main
Germany

T +49-69-211-1 12 10
F +49-69-211-1 12 11
eurextrading@eurex.com
Internet: www.eurex.com

Management Board:
Melanie Dannheimer, Dr.
Wolfgang Eholzer, Erik Tim
Müller, Michael Peters, Dr.
Randolf Roth, Jonas Ullmann

Prozedere

Fair Value Methode

Die Eurex-Optionen auf Rovio Entertainment OYJ werden zum theoretisch fairen Wert abgerechnet, sofern die Voraussetzungen in den Kontrakt-spezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland Ziffer 2.6.10.1 (7) für Eurex Options-Kontrakte, erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in Rovio Entertainment OYJ -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 (30. März 2023 bis 14. April 2023), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet.

Verfallsjahr	Verfallsmonat	Basispreis	Implizite Volatilität
2023	Juni	3,8	76,10
2023	Juni	4,0	76,88
2023	Juni	4,4	75,30
2023	Juni	4,8	71,70
2023	Juni	5,2	67,31
2023	Juni	5,6	62,84
2023	Juni	6,0	58,03
2023	Juni	6,4	53,87
2023	Juni	6,8	50,58
2023	Juni	7,2	47,50
2023	Juni	7,6	45,17
2023	Juni	8,0	43,68
2023	Juni	9,0	43,72
2023	September	3,8	60,65
2023	September	4,0	59,38
2023	September	4,4	56,55
2023	September	4,8	53,64
2023	September	5,2	51,30
2023	September	5,6	48,73
2023	September	6,0	46,77
2023	September	6,4	45,24
2023	September	6,8	43,77
2023	September	7,2	42,88
2023	September	7,6	42,33
2023	September	8,0	41,93
2023	Dezember	4,0	54,65
2023	Dezember	4,4	51,84
2023	Dezember	4,8	50,13
2023	Dezember	5,2	47,79
2023	Dezember	5,6	46,33
2023	Dezember	6,0	45,00
2023	Dezember	6,4	43,92

2023	Dezember	6,8	43,39
2023	Dezember	7,2	42,69
2023	Dezember	7,6	42,68

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
-	-

Mit sofortiger Wirkung werden für die Eurex-Optionen, den Eurex Future auf Rovio Entertainment OYJ 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.