

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 12. Juni 2023

Wirksamkeitsdatum: 13. Juni 2023

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

Kapitalmaßnahme	Zusammenschluß /Aktienumtausch
Gesellschaft	Credit Suisse Group AG
ISIN	CH0012138530
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), 2.6.10.1 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	CSGN, CSGE, CSG1/2/4/5
Futures-Kontrakt auf Aktien	CSGK, CSGP
Equity Total Return Future	
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	C5SG

In einer Mitteilung vom 12. Juni 2023 hat das Unternehmen UBS Group AG bekannt gegeben, dass alle Bedingungen der Übernahme eingetreten sind.

Daher werden die betroffenen Optionskontrakte wie bereits in der Kapitalmaßnahmeinformation 001 beschrieben angepasst. Die Einzelheiten zur Anpassung werden an dieser Stelle nochmals erläutert.

In diesem Zusammenhang ändern sich auch die Underlying ISIN sowie der Produktname wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt

Produkt code alt/neu	Produkt ISIN alt/neu	Underlying ISIN alt	Underlying ISIN neu	Produkt Name alt	Produkt Name neu
CSGN	CH0012138530	CH0012138530	CH0244767585	Credit Suisse Group	UBS Group AG
CSGE	DE000A1MAJX4	CH0012138530	CH0244767585	Credit Suisse Group	UBS Group AG
C5SG	DE000A2GF6A7	XC000A1HTZS2	XC000A1HTZR4	Credit Suisse Dividends	UBS Group AG Dividends

Prozedere

R-Faktor Methode / Aktienumtausch

Die Eurex-Optionen, der Eurex Aktien-Futures-Kontrakt, sowie der Eurex Aktiendividenden-Future auf Credit Suisse Group AG werden angepasst, sofern die Voraussetzungen in den Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, 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. Sind die Voraussetzungen erfüllt und die Transaktion wird vollzogen, dann wird:

- Der bisherige Basiswert wird durch die im Umtauschangebot bestimmte Aktie ersetzt
- Auf Basis des Umtauschverhältnisses von 1 UBS Group AG Aktie je 22,48 Credit Suisse Group AG Aktien ergibt sich ein R-Faktor von $R = 22.48$

Optionen

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 Handelstages vor der Anpassung auf www.eurex.com eingestellt
- Es werden keine neuen Serien mehr eingeführt.
- Sobald keine Serien mit offenen Positionen mehr bestehen, wird der Handel in dem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.
- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Handelstag vor der Anpassung 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.
- Mit sofortiger Wirkung werden keine neue Verfalltermine mehr eingeführt.

Futures

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: $\text{Kontraktgröße neu} = \text{Kontraktgröße alt} / R\text{-Faktor}$
- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Handelstag vor der Anpassung gelöscht.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Futures
- Es werden keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.
- Sobald keine Verfallmonate mit offenen Positionen mehr bestehen, wird der Handel in dem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Über den weiteren Ablauf werden wir Sie informieren, sofern Änderungen bzw. neue Informationen im Verlauf der Transaktion dies erforderlich machen.