

## Kapitalmaßnahmeinformation

**Ausstellungsdatum:** 20. Juni 2023  
**Wirksamkeitsdatum:** Wird noch bekannt gegeben  
**Kontakt:** Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
<b>Gesellschaft</b>	<b>SoftwareONE Holding AG</b>
<b>ISIN</b>	<b>CH0496451508</b>
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	SWO
Futures-Kontrakt auf Aktien	SWOF
Equity Total Return Future	
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

Die Unternehmen SoftwareONE Holding AG und Bain Capital haben in einer gemeinsamen Pressemitteilung am 15. Juni 2023 bekannt gegeben, dass Bain Capital beabsichtigt, den Aktionären der SoftwareONE Holding AG ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre der SoftwareONE Holding AG CHF 18,50 in bar für jede Stammaktie erhalten. Für weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe die Website der Gesellschaft unter [www.softwareone.com](http://www.softwareone.com).

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, sowie der Eurex Aktiendividenden-Future auf SoftwareONE Holding AG 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 und Ziffer 2.6.10.1 (7) für Eurex Options-Kontrakte, erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in SoftwareONE Holding AG -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 (1. Juni 2023 bis 14. Juni 2023), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet.

Verfallsjahr	Verfallsmonat	Basispreis	Implizite Volatilität
2023	Juli	13	38,19
2023	Juli	13,5	33,76
2023	Juli	14	30,45
2023	Juli	14,5	28,35
2023	Juli	15	27,60
2023	Juli	15,5	28,45
2023	Juli	16	30,37
2023	August	14	31,90
2023	August	14,5	30,43
2023	August	15	29,74
2023	August	15,5	29,54
2023	August	16	30,05
2023	August	16,5	30,61
2023	August	17	31,72
2023	August	17,5	32,95
2023	August	18	34,23
2023	August	18,5	37,32
2023	September	10	49,79
2023	September	11	44,58
2023	September	12	40,09
2023	September	13	36,47
2023	September	14	33,88
2023	September	15	32,17
2023	September	16	31,25
2023	September	17	31,16
2023	September	18	31,60
2023	September	19	31,02
2023	September	20	30,61

2023	September	22	30,65
2023	September	24	30,61
2023	Dezember	5,6	67,76
2023	Dezember	10	42,10
2023	Dezember	11	38,41
2023	Dezember	12	35,36
2023	Dezember	13	32,92
2023	Dezember	14	31,01
2023	Dezember	14,5	30,12
2023	Dezember	15	29,53
2023	Dezember	15,5	28,92
2023	Dezember	16	28,64
2023	Dezember	16,5	28,14
2023	Dezember	17	28,14
2023	Dezember	17,5	27,88
2023	Dezember	18	28,04
2023	Dezember	19	28,30
2023	Dezember	20	28,56
2023	Dezember	22	30,45
2023	Dezember	24	31,52
2024	März	12	36,57
2024	März	13	34,77
2024	März	14	33,21
2024	März	15	31,99
2024	März	16	31,15
2024	März	17	30,70
2024	März	18	30,53
2024	März	19	30,52
2024	März	20	30,58
2024	März	22	31,36
2024	März	24	31,65
2024	Juni	14	33,35
2024	Juni	14,5	32,73
2024	Juni	15	32,27
2024	Juni	15,5	32,00
2024	Juni	16	31,56
2024	Juni	20	30,75
2024	Dezember	24	30,39
2024	Dezember	28	30,91

## 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:

<b>Dividendenbetrag in Euro</b>	<b>Ex-Tag</b>
0,10	21.05.2024

Mit sofortiger Wirkung werden für die Eurex-Optionen, den Eurex Future auf SoftwareONE Holding AG 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.