

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 18. Januar 2024

Wirksamkeitsdatum: 17. Januar 2024

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

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Telefonica Deutschland Holding AG
ISIN	DE000A1J5RX9
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	O2D
Futures-Kontrakt auf Aktien	
Equity Total Return Future	
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

In einer Mitteilung vom 17. Januar 2024 hat das Unternehmen Telefonica Local Services GmbH bekannt gegeben, dass die Übernahmekonditionen erfüllt sind. Daher werden gemäß den Kontraktspezifikationen der Eurex Deutschland und wie bereits in der Kapitalmaßnahmeinformation 001 beschrieben, bestehende Positionen in den Futures- und Optionskontrakten zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Basis für die Berechnung der fairen Werte ist der Angebotspreis in Höhe von EUR 2,35 pro Aktie.

Die Schlussabrechnungspreise für die Futures- und Optionskontrakte mit offenen Positionen finden sich in der unten aufgeführten Tabelle.

Das Clearing System wird für alle offenen Positionen in dem betroffenen Produkt automatisch Closing Transaktionen generieren. Die Closing Transaktion wird zum Fairen Wert (FW) gebucht, welcher am 17.01.2024 als Settlement Preis eingegeben wird. Die entsprechenden Cash Transaktionen (basierend auf dem Fairen Wert) werden generiert und werden als normale Prämie gezahlt bzw. gutgeschrieben (224/226) oder als Variation Margin gezahlt bzw. gutgeschrieben (235/236).

Die resultierenden Cash Balances werden am 17.01.2024 gebucht, mit Wertstellung 18.01.2024. Alle Positionen werden am 17.01.2024 geschlossen. Die Closing Transaktionen (CB012 Account Statement) und die entsprechenden Cash Beträge (CD710 Daily Cash Account CM) werden automatisch in die Reports integriert.

Der Handel in den oben genannten Kontrakten ist bereits eingestellt.

Schlussabrechnungspreise für die Optionskontrakte mit offenen Positionen:

Zugrundeliegender Angebotspreis als Referenzpreis: EUR 2,35

Kontrakt	Schlussabrechnungspreis
O2D January 2024 C 1.60	0,75
O2D January 2024 P 1.65	0,01
O2D January 2024 C 1.80	0,55
O2D January 2024 P 1.80	0,01
O2D March 2024 P 1.60	0,01
O2D March 2024 P 1.70	0,01
O2D March 2024 P 1.80	0,01
O2D March 2024 C 1.80	0,56
O2D March 2024 P 1.90	0,01
O2D March 2024 C 2.20	0,21
O2D March 2024 C 2.40	0,10
O2D March 2024 C 3.00	0,01
O2D June 2024 P 1.40	0,01
O2D June 2024 P 1.50	0,01
O2D June 2024 P 1.60	0,01
O2D June 2024 P 1.70	0,01
O2D June 2024 P 1.90	0,05
O2D June 2024 C 2.40	0,19
O2D June 2024 P 2.40	0,30
O2D December 2024 P 1.60	0,02 (corrected)
O2D December 2024 C 1.80	0,58
O2D December 2024 P 1.80	0,05
O2D December 2024 C 2.00	0,41
O2D December 2024 P 2.40	0,27