

Kapitalmaßnahmeninformation 002

Ausstellungsdatum: 17. April 2026

Wirksamkeitsdatum: 24. April 2026

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

Kapitalmaßnahme	Sonderdividende
Gesellschaft	Amrize Ltd.
ISIN	CH1430134226
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (2), 1.13.8 (2), 1.26.11 (2), 2.6.10.1 (2)
Optionskontrakt auf Aktien	HOBE, HOLB
Futures-Kontrakt auf Aktien	AMRF
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	H3OL

Die Gesellschaft Amrize Ltd. hat ihren Dividendenvorschlag bekannt gegeben. Demnach ist die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von USD 0,44 je Aktie vorgesehen. Ferner hat die Gesellschaft bekannt gegeben, dass die Amrize-Aktie am oder um den 24. April 2026 ex-Dividende notieren soll.

Weitere Informationen zu dieser Sonderausschüttung finden sich auf der Website der Gesellschaft.

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte.

Prozedere

Methoden

Bestimmung des R-Faktors:

S1	Schlussauktionspreis der Aktie
S2	S1 minus Sonderdividende*
R-Faktor	$S2 / S1$

* Die Umrechnung der Sonderdividende von USD in CHF erfolgt auf Basis des von der EZB festgelegten am 23. April 2026 veröffentlichten Referenzkurses.

Bestimmung des K-Faktors: $K\text{-Faktor} = 1 / R\text{-Faktor}$

Optionen (HOBE, HOLB)

1. Anpassung der Basispreise und Kontraktgrößen

- Bestehende Basispreise und Kontraktgrößen der Basket-Optionskontrakte werden nicht angepasst, Basispreise und Kontraktgröße bleiben unverändert.
- Zum Anpassungstichtag setzt sich der Basiswert des Basket-Optionskontrakts zusammen aus einer Aktie der Holcim AG und einer um den K-Faktor angepassten Aktie der Amrize Ltd.
- Der Wert bzw. der tägliche Schlusspreis des angepassten Basket als Basiswert der Basket-Optionskontrakte wird wie folgt berechnet:

$(1 \times \text{Preis bzw. Schlusspreis der Holcim-Aktie an der SIX Swiss Exchange}) \text{ plus } (K\text{-Faktor} \times \text{Preis bzw. Schlusspreis der Amrize-Aktie an der SIX Swiss Exchange})$

- Die entsprechenden Lieferinstruktionen werden angepasst: Bei Ausübung eines angepassten Basket-Optionskontrakts ist ein Basket zu liefern bestehend aus 100 Aktien der Holcim AG sowie der um den K-Faktor angepasste Gegenwert von 100 Aktien der Amrize Ltd. bewertet zum Schlusspreis der Amrize-Aktie am Tag der Ausübung gegen Zahlung des entsprechenden Basispreises multipliziert mit der Kontraktgröße des Basket-Optionskontrakts (100).
- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Cum-Handelstag 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.

Futures (AMRF, H3OL)

1. Anpassung der Kontraktgröße und Variation Margin

- Sollten offene Positionen bestehen, werden die Aktien-Futures-Kontrakte AMRF mit dem R-Faktor angepasst.
- Zum Ausgleich der Berechnung der Variation Margin des darauffolgenden Börsentages werden die Settlement-Preise des Kontraktes AMRF 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 Cum-Handelstag gelöscht.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Futures.
- Die täglichen und finalen Settlement-Preise des Basket-Dividenden-Futures-Kontraktes H3OL werden angepasst, indem der Amrize-Dividendenanteil mit dem K-Faktor multipliziert wird. Die Kontraktgröße bleibt unverändert (1000).
- Der Wert oder Preis des Basket-Dividenden-Futures-Kontraktes wird wie folgt berechnet:
 $((1 \times \text{Wert der Holcim Dividende}) \text{ plus } (K\text{-Faktor} \times \text{Wert der Dividende der Amrize Aktie}))$

2. Einführung eines neuen Kontrakts

- Es wird ein neuer Aktien-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 100 eingeführt.
- Der genaue Einführungszeitpunkt wird per Rundschreiben bekannt gegeben.
- Ab dem Anpassungstag werden keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.
- Sobald keine Verfallmonate mit offenen Positionen in den angepassten Kontrakten mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesen Kontrakten eingestellt.

Sollten in den betreffenden Kontrakten am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, werden die Kontrakte nicht angepasst und es werden keine Nachfolgekongtrakte eingeführt.