

Kapitalmaßnahmeinformation 001

Ausstellungsdatum: 18. Juni 2026
Wirksamkeitsdatum: Wird noch bekannt gegeben
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Banca Monte dei Paschi SpA
ISIN	IT0005508921
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), 2.6.10.1 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	BMP, ME9
Futures-Kontrakt auf Aktien	BMPF, BMPP
Equity Total Return Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	B2MP, M2EG

Das Unternehmen Intesa Sanpaolo S.p.A hat bekannt gegeben, den Aktionären der Banca Monte dei Paschi SpA ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre der Banca Monte dei Paschi SpA 1,60 Aktien der Intesa Sanpaolo S.p.A plus EUR 1.00 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.

Prozedere

R-Faktor Methode / Aktienumtausch

Die Eurex-Optionen, der Eurex Aktien-Futures-Kontrakt, sowie der Eurex Aktiendividenden-Future auf Banca Monte dei Paschi SpA 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. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in Banca Monte dei Paschi SpA-Kontrakten unverändert fortgeführt. Sind die Voraussetzungen erfüllt und die Transaktion wird vollzogen, dann wird:

- Der bisherige Basiswert wird durch die im Umtauschangebot bestimmte Aktie ersetzt
- Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)
- Auf Basis des Umtauschverhältnisses von 1.60 Intesa Sanpaolo S.p.A Aktien je Banca Monte dei Paschi SpA Aktien + EUR 1.00 ergibt sich ein R-Faktor: $\text{Cum event price} / (1.6 \times \text{Cum event price}) + \text{EUR } 1.00$

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. Falls die Anpassung der Handelseinheit zu einer Losgröße führt, die nicht einer Erhöhung um eine Aktie entspricht, wird die angepasste Losgröße auf die nächste ganze Aktie gerundet. Zur Neutralisierung des Rundungseffekts wird eine Ausgleichszahlung geleistet.
- 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 unter **Rules & Regs > Kapitalmaßnahmen > Informationen über Kapitalmaßnahmen**
- 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.

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:
Kontraktgröße neu = Kontraktgröße alt / R-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.