

## Kapitalmaßnahmeinformation

**Ausstellungsdatum:** 8. Juli 2026  
**Wirksamkeitsdatum:** Wird noch bekannt gegeben  
**Kontakt:** Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
<b>Gesellschaft</b>	<b>Exail Technologies SA</b>
<b>ISIN</b>	<b>FR0000062671</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	EXA
Futures-Kontrakt auf Aktien	-
Equity Total Return Future	-
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	-

Das Unternehmen Exail Technologies SA hat in einer Pressemitteilung am 26. Juni 2026 bekannt gegeben, dass Thales SA beabsichtigt, den Aktionären der Exail Technologies SA ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre der Exail Technologies SA EUR 134,00 in bar 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

### Fair Value Methode

Die Eurex-Optionen, der Eurex Aktien-Futures-Kontrakt, sowie der Eurex Aktiendividenden-Future auf Exail Technologies SA 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, 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 Exail Technologies SA -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 (22. Juni 2026 bis 3. Juli 2026), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet.

ContractDate	ExpirationYear	ExpirationMonth	StrikePrice	ImpliedVolatility
18/09/2026	2026	9	34,00	110,67
18/09/2026	2026	9	36,00	110,05
18/09/2026	2026	9	38,00	109,26
18/09/2026	2026	9	40,00	108,19
18/09/2026	2026	9	42,00	106,83
18/09/2026	2026	9	44,00	105,23
18/09/2026	2026	9	46,00	103,47
18/09/2026	2026	9	48,00	101,60
18/09/2026	2026	9	50,00	99,64
18/09/2026	2026	9	52,00	97,65
18/09/2026	2026	9	56,00	93,62
18/09/2026	2026	9	60,00	89,67
18/09/2026	2026	9	64,00	85,89
18/09/2026	2026	9	66,00	84,07
18/09/2026	2026	9	68,00	82,34
18/09/2026	2026	9	70,00	80,86
18/09/2026	2026	9	72,00	79,06
18/09/2026	2026	9	74,00	77,47
18/09/2026	2026	9	76,00	76,07
18/09/2026	2026	9	78,00	74,69
18/09/2026	2026	9	80,00	73,39
18/09/2026	2026	9	82,00	72,16
18/09/2026	2026	9	84,00	71,00

18/09/2026	2026	986,00	69,92
18/09/2026	2026	988,00	68,92
18/09/2026	2026	990,00	67,99
18/09/2026	2026	992,00	67,14
18/09/2026	2026	994,00	66,35
18/09/2026	2026	996,00	65,63
18/09/2026	2026	998,00	64,98
18/09/2026	2026	9100,00	64,39
18/09/2026	2026	9105,00	63,16
18/09/2026	2026	9110,00	62,23
18/09/2026	2026	9115,00	61,56
18/09/2026	2026	9120,00	61,13
18/09/2026	2026	9125,00	60,88
18/09/2026	2026	9130,00	60,72
18/09/2026	2026	9135,00	60,61
18/09/2026	2026	9140,00	60,55
18/09/2026	2026	9145,00	60,53
18/09/2026	2026	9150,00	60,54
18/09/2026	2026	9160,00	60,62
18/09/2026	2026	9170,00	60,75
18/09/2026	2026	9180,00	60,89
18/09/2026	2026	9190,00	61,04
18/09/2026	2026	9200,00	61,16
18/09/2026	2026	9220,00	61,34
18/09/2026	2026	9240,00	61,41
18/09/2026	2026	9260,00	61,42

## Option

### Zinssatz und Dividende

Bei der Ermittlung des fairen Wertes werden implizite Zinssätze zugrunde gelegt. Es wurden keine Dividendenzahlungen für die Bestimmung der fairen Werte zugrunde gelegt.

Mit sofortiger Wirkung werden für die Eurex-Optionen und den Eurex Future auf Exail Technologies SA in der Regel keine neuen Serien mehr eingeführt.

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