

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 26. April 2024
Wirksamkeitsdatum: 14. Juni 2024
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Aktienzusammenlegung und ISIN-Änderung
Gesellschaft	Casino Guichard
ISIN	FR0000125585
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (5), 1.13.8 (5) , 1.26.11 (4), 1.27.8 (5), 2.6.10.1 (6)
Optionskontrakt auf Aktien	CAJ
Futures-Kontrakt auf Aktien	CAJG
Equity Total Return Future	
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	C2AJ

Die Gesellschaft Casino Guichard hat die Zusammenlegung ihrer Stammaktien im Verhältnis 1:100 sowie eine ISIN-Änderung bekannt gegeben.

Weitere Informationen zu diesen Maßnahmen finden sich auf der Website der Gesellschaft.

Die Zusammenlegung der Aktien der Casino Guichard führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte. Mit Zusammenlegung der Aktien ändern sich die Gattungsdaten und eine neue ISIN FR001400OKR3 wird den Aktien zugewiesen. Die Änderung der Referenzdaten der Kontrakte erfolgt gemäß den Angaben der folgenden Tabelle:

Produktkürzel alt/neu	ISIN des Basiswerts alt	ISIN des Basiswerts neu	Produkt ISIN alt	Produkt ISIN neu
CAJ	FR0000125585	FR001400OKR3	FR0000125585	FR001400OKR3
CAJG	FR0000125585	FR001400OKR3	DE000A0ZW4M5	DE000A0ZW4M5
C2AJ	XC000A2QR0W6	XC000A2QR0W6	DE000A2QR600	DE000A2QR600

Prozedere

R-Faktor Methode

Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

Anzahl Aktien alt	100
Anzahl Aktien neu	1
R-Faktor	100,00000000

Optionen

1. 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.
- Die Versionsnummer der bestehenden Serien erhöht sich um 1.
Die angepassten Basispreise und Kontraktgrößen werden unmittelbar nach Handelsschluss des letzten Cum-Handelstages auf der Eurex-Website www.eurex.com eingestellt unter **Rules & Regs > Kapitalmaßnahmen > Informationen über Kapitalmaßnahmen**
- Neue Serien mit der Standardkontraktgröße 100 und der Versionsnummer 0 werden mit Wirkung zum Ex-Tag eingeführt.
- 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.

2. Ausübungen

- Bei Ausübung einer angepassten Serie findet grundsätzlich ein Barausgleich für den nicht ganzzahligen Teil der neuen Kontraktgröße statt.
- Bei angepassten Serien ab der Version 2 kann es zu Abweichungen im Lieferprozess kommen. Im Report RPTTA711 (All Active/Inactive Series) sind die Teile der Kontraktgröße dargestellt, für welche bei der Ausübung einer angepassten Serie ein Barausgleich stattfindet.

Futures

1. 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 Cum-Handelstag gelöscht.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Futures.

2. Einführung eines neuen Kontrakts

- Es wird ein neuer Aktien-Futures-Kontrakt eingeführt mit Standardkontraktgröße 100 sowie ein neuer Aktiendividenden-Future mit Standardkontraktgröße 1000.
- 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.

Falls für einen der ursprünglichen Kontrakte am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung dieses Kontraktes und keine Einführung eines neuen Kontrakts für diesen.