

Kapitalmaßnahmeinformation - aktualisiert-

Ausstellungsdatum: 16. August 2023
Wirksamkeitsdatum: Wird noch bekannt gegeben
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	OHB SE
ISIN	DE0005936124
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	OHB
Futures-Kontrakt auf Aktien	-
Equity Total Return Future	-
Stock Tracking Future	-
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	-

Die Unternehmen OHB SE und KKR haben in einer gemeinsamen Pressemitteilung am 7. August 2023 bekannt gegeben, dass KKR beabsichtigt, den Aktionären der OHB SE ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre der OHB SE EUR 44,00 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 auf OHB SE 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 und Ziffer 2.6.10.1 (7) für Eurex Options-Kontrakte, erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in OHB SE -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 (24. Juli 2023 bis 4. August 2023), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet.

Verfallsjahr	Verfallsmonat	Basispreis	Implizite Volatilität
2023	Oktober	19	47,31
2023	Oktober	19,5	46,17
2023	Oktober	20	45,27
2023	Oktober	21	43,82
2023	Oktober	22	41,54
2023	Oktober	23	39,34
2023	Oktober	24	37,27
2023	Oktober	25	35,42
2023	Oktober	26	33,57
2023	Oktober	27	32,05
2023	Oktober	28	30,50
2023	Oktober	29	29,19
2023	Oktober	30	28,06
2023	Oktober	31	27,06
2023	Oktober	32	26,29
2023	Oktober	33	25,73
2023	Oktober	34	25,40
2023	Oktober	35	25,36
2023	Oktober	36	25,41
2023	Oktober	37	25,68
2023	Oktober	38	26,01
2023	Oktober	39	26,51
2023	Oktober	40	26,90
2023	Oktober	41	27,80
2023	Dezember	11	71,85
2023	Dezember	12	66,47

2023	Dezember	13	63,56
2023	Dezember	14	60,25
2023	Dezember	15	57,15
2023	Dezember	16	53,68
2023	Dezember	17	51,20
2023	Dezember	18	48,20
2023	Dezember	19	45,72
2023	Dezember	20	43,24
2023	Dezember	22	39,15
2023	Dezember	24	34,28
2023	Dezember	26	31,95
2023	Dezember	28	29,91
2023	Dezember	30	28,29
2023	Dezember	32	27,03
2023	Dezember	34	26,22
2023	Dezember	36	26,10
2023	Dezember	38	26,46
2023	Dezember	40	27,11
2023	Dezember	42	28,05
2023	Dezember	44	29,05
2023	Dezember	46	30,32
2023	Dezember	48	31,93
2023	Dezember	50	34,41
2023	Dezember	52	36,46
2023	Dezember	60	38,17
2023	Dezember	68	41,56
2024	März	11	68,76
2024	März	12	64,95
2024	März	13	61,11
2024	März	14	57,79
2024	März	15	55,14
2024	März	16	52,30
2024	März	17	49,34
2024	März	18	43,56
2024	März	19	40,23
2024	März	20	39,35
2024	März	22	36,81
2024	März	24	34,46
2024	März	26	32,35
2024	März	28	30,52
2024	März	30	28,96
2024	März	32	27,72
2024	März	34	26,83
2024	März	36	26,36
2024	März	38	26,29
2024	März	40	26,45

2024	März	42	26,83
2024	März	44	25,45 27.45 korrigiert
2024	März	46	24,10 28.10 korrigiert
2024	März	48	21,42 28.36 korrigiert
2024	Juni	7,2	63,70
2024	Juni	8	62,55
2024	Juni	10	59,32
2024	Juni	11	56,46
2024	Juni	12	53,88
2024	Juni	13	51,83
2024	Juni	14	49,25
2024	Juni	15	46,66
2024	Juni	16	44,59
2024	Juni	17	42,74
2024	Juni	18	40,65
2024	Juni	19	38,95
2024	Juni	20	37,66
2024	Juni	22	34,91
2024	Juni	24	32,93
2024	Juni	26	31,67
2024	Juni	28	28,90
2024	Juni	30	28,55
2024	Juni	32	27,56
2024	Juni	34	28,33
2024	Juni	36	28,99
2024	Juni	38	29,43
2024	Juni	40	29,66
2024	Juni	42	30,14
2024	Juni	44	30,44
2024	Juni	46	30,83
2024	Juni	48	31,22
2024	Juni	52	32,10
2024	Juni	60	32,08
2024	Juni	68	31,37

Option und Single Stock Future

Zinssatz und Dividende

Bei der Ermittlung des fairen Wertes werden implizite Zinssätze zugrunde gelegt. Folgende Dividendendaten werden bei der Bestimmung der impliziten Volatilität verwendet und bei der Festlegung der fairen Werte zugrunde gelegt, sofern der Abrechnungstag der Kontrakte vor dem Ex-Tag liegt:

Dividendenbetrag in Euro	Ex-Tag
0,600	17.05.2024

Mit sofortiger Wirkung werden für die Eurex-Optionen, den Eurex Future auf OHB SE in der Regel keine neuen Serien mehr eingeführt. Serien ohne offene Positionen werden gelöscht.

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