

## Kapitalmaßnahmeinformation

**Ausstellungsdatum:** 08. März 2024

**Wirksamkeitsdatum:** 05. Juni 2024

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

Kapitalmaßnahme	Sonderdividende
Gesellschaft	OMV AG
ISIN	AT0000743059
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	OMV
Futures-Kontrakt auf Aktien	OMVG
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	O2MV, O3MV

Die Gesellschaft OMV AG hat die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von EUR 2,10 je Aktie zusätzlich zu einer regulären Dividende in Höhe von EUR 2,95 je Aktie bekannt gegeben.

Weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe auf der Website der Gesellschaft unter [www.omv.com](http://www.omv.com).

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte.

## Prozedere

### R-Faktor Methode

Bestimmung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

S1	Schlussauktionspreis der Aktie
S2	S1 minus reguläre Dividende
S3	S2 minus Sonderdividende
R-Faktor	$S3 / S2$

## 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](http://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.
- Report RPTTA711 (All Active/Inactive Series) weist die Kontraktgrößen der angepassten Serien aus.

## 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 eingeführt.
- Der genaue Einführungszeitpunkt wird per Rundschreiben bekannt gegeben.
- Sobald die neuen Kontrakte zum Handel zur Verfügung stehen und keine Verfallmonate mit offenen Positionen in den ursprünglichen Kontrakten mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesen Kontrakten ausgesetzt und eingestellt.
- Ferner werden in angepassten Futures-Kontrakten keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

**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 Nachfolgekontraktes.**