

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 9. Oktober 2023
Wirksamkeitsdatum: To be announced
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Hamburger Hafen und Logistik AG
ISIN	DE000A0S8488
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	HHFA
Futures-Kontrakt auf Aktien	
Equity Total Return Future	
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

Die Unternehmen Hamburger Hafen und Logistik AG und Blitz 23-844 SE haben in einer gemeinsamen Pressemitteilung am 13. September 2023 bekannt gegeben, dass Blitz 23-844 SE beabsichtigt, den Aktionären der Hamburger Hafen und Logistik AG ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Demzufolge sollen die Aktionäre der Hamburger Hafen und Logistik AG EUR 16,75 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 Hamburger Hafen und Logistik AG werden zum theoretisch fairen Wert abgerechnet, sofern die Voraussetzungen in den Kontrakt-spezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in Hamburger Hafen und Logistik AG -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 (30. August 2023 bis 12. September 2023), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet.

Verfallsjahr	Verfallsmonat	Basispreis	Implizite Volatilität
2023	11	6	51,30
2023	11	6,2	51,30
2023	11	6,4	51,30
2023	11	6,6	51,30
2023	11	6,8	51,30
2023	11	7	49,60
2023	11	7,2	48,09
2023	11	7,4	46,63
2023	11	7,6	45,05
2023	11	7,8	43,76
2023	11	8	42,02
2023	11	8,5	38,74
2023	11	9	35,61
2023	11	9,5	32,85
2023	11	10	30,21
2023	11	10,5	28,08
2023	11	11	26,30
2023	11	11,5	25,45
2023	11	12	25,29
2023	11	12,5	25,33
2023	11	13	25,36
2023	11	13,5	25,63
2023	11	14	25,99
2023	11	14,5	25,99
2023	11	15	25,99
2023	12	3,6	41,46
2023	12	3,8	41,46
2023	12	4	41,46
2023	12	4,4	41,46
2023	12	4,8	41,46

2023	12	5,2	41,46
2023	12	5,6	41,46
2023	12	6	41,46
2023	12	6,4	41,46
2023	12	6,8	41,46
2023	12	7,2	41,46
2023	12	7,6	38,84
2023	12	8	36,93
2023	12	9	32,30
2023	12	10	28,32
2023	12	11	25,44
2023	12	12	22,47
2023	12	13	22,47
2023	12	14	22,47
2023	12	15	22,47
2023	12	16	22,47
2023	12	17	22,47
2023	12	18	22,47
2023	12	19	22,47
2023	12	20	22,47
2024	3	3,6	51,00
2024	3	3,8	51,00
2024	3	4	51,00
2024	3	4,4	51,00
2024	3	4,8	54,27
2024	3	5,2	51,00
2024	3	5,6	48,71
2024	3	6	46,29
2024	3	6,4	43,39
2024	3	6,8	40,94
2024	3	7,2	38,75
2024	3	7,6	36,46
2024	3	8	34,59
2024	3	9	30,14
2024	3	10	26,75
2024	3	11	24,38
2024	3	12	23,14
2024	3	13	21,04
2024	3	14	21,04
2024	3	15	21,04
2024	3	16	21,04
2024	3	17	21,04
2024	3	18	21,04
2024	3	19	21,04
2024	6	3,6	44,40
2024	6	3,8	44,40
2024	6	4	44,40
2024	6	4,4	45,53
2024	6	4,8	44,40
2024	6	5,2	42,64

2024	6	5,6	40,86
2024	6	6	39,39
2024	6	6,4	38,06
2024	6	6,8	36,88
2024	6	7,2	35,50
2024	6	7,6	34,44
2024	6	8	33,27
2024	6	9	31,02
2024	6	10	28,95
2024	6	11	27,51
2024	6	12	26,19
2024	6	13	25,34
2024	6	14	24,53
2024	6	15	23,86
2024	6	16	23,62
2024	6	17	23,62
2024	6	18	23,62
2024	6	19	23,62
2024	12	1,8	43,35
2024	12	2	43,35
2024	12	2,4	43,35
2024	12	2,8	43,35
2024	12	3,2	43,35
2024	12	3,6	43,35
2024	12	4	43,35
2024	12	4,8	42,06
2024	12	5,6	39,14
2024	12	6,4	36,45
2024	12	7,2	34,41
2024	12	8	32,76
2024	12	10	29,38
2024	12	12	27,02
2024	12	14	25,54
2024	12	16	24,50
2024	12	18	24,23
2024	12	20	24,23
2024	12	24	24,23

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
0.50	15 06 2024

Mit sofortiger Wirkung werden für die Eurex-Optionen, den Eurex Future auf Hamburger Hafen und Logistik AG 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.