

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 16. Mai 2024

Wirksamkeitsdatum: 16. Mai 2024

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

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	MorphoSys AG
ISIN	DE0006632003
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	MOR, MORE
Futures-Kontrakt auf Aktien	MORF
Equity Total Return Future	TMOR

In einer Mitteilung vom 16. Mai 2024 hat das Unternehmen Novartis AG bekannt gegeben, dass die Übernahmekonditionen erfüllt sind. Daher werden gemäß den Kontraktspezifikationen der Eurex Deutschland und wie bereits in der Kapitalmaßnahmeinformation 001 beschrieben, bestehende Positionen in den Optionskontrakten zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Basis für die Berechnung der fairen Werte ist der Angebotspreis in Höhe von EUR 68,00.

Die Schlussabrechnungspreise für die Futures- und Optionskontrakte mit offenen Positionen finden sich in der unten aufgeführten Tabelle.

Das Clearing System wird für alle offenen Positionen in dem betroffenen Produkt automatisch Closing Transaktionen generieren. Die Closing Transaktion wird zum Fairen Wert (FW) gebucht, welcher am 16.05.2024 als Settlement Preis eingegeben wird. Die entsprechenden Cash Transaktionen (basierend auf dem Fairen Wert) werden generiert und werden als normale Prämie gezahlt bzw. gutgeschrieben (224/226) oder als Variation Margin gezahlt bzw. gutgeschrieben (235/236).

Die resultierenden Cash Balances werden am 16.05.2024 gebucht, mit Wertstellung 17.05.2024. Alle Positionen werden am 16.05.2024 geschlossen. Die Closing Transaktionen (CB012 Account Statement) und die entsprechenden Cash Beträge (CD710 Daily Cash Account CM) werden automatisch in die Reports integriert.

Der Handel in den oben genannten Kontrakten ist bereits eingestellt.

Schlussabrechnungspreise für die Optionskontrakte (MOR) mit offenen Positionen:

Zugrundeliegender Angebotspreis als Referenzpreis: EUR 68,00

Kontrakt	StlPrc
MOR JUN24 CALL 5,6 0	62,42
MOR JUN24 PUT 5,6 0	0,01
MOR JUN24 CALL 7,2 0	60,83
MOR JUN24 PUT 7,2 0	0,01
MOR JUN24 CALL 7,6 0	60,43
MOR JUN24 PUT 7,6 0	0,01
MOR JUN24 CALL 8 0	60,03
MOR JUN24 PUT 8 0	0,01
MOR JUN24 CALL 9 0	59,03
MOR JUN24 PUT 9 0	0,01
MOR JUN24 CALL 10 0	58,04
MOR JUN24 PUT 10 0	0,01
MOR JUN24 CALL 11 0	57,04
MOR JUN24 PUT 11 0	0,01
MOR JUN24 CALL 12 0	56,05
MOR JUN24 PUT 12 0	0,01
MOR JUN24 CALL 13 0	55,05
MOR JUN24 PUT 13 0	0,01
MOR JUN24 CALL 14 0	54,05
MOR JUN24 PUT 14 0	0,01
MOR JUN24 CALL 15 0	53,06
MOR JUN24 PUT 15 0	0,01
MOR JUN24 CALL 16 0	52,06
MOR JUN24 PUT 16 0	0,01
MOR JUN24 CALL 17 0	51,07
MOR JUN24 PUT 17 0	0,01
MOR JUN24 CALL 18 0	50,07
MOR JUN24 PUT 18 0	0,01
MOR JUN24 CALL 19 0	49,07
MOR JUN24 PUT 19 0	0,01
MOR JUN24 CALL 20 0	48,08
MOR JUN24 PUT 20 0	0,01
MOR JUN24 CALL 22 0	46,08
MOR JUN24 PUT 22 0	0,01
MOR JUN24 CALL 24 0	44,09
MOR JUN24 PUT 24 0	0,01
MOR JUN24 CALL 26 0	42,1

MOR JUN24 PUT 26 0	0,01
MOR JUN24 CALL 28 0	40,11
MOR JUN24 PUT 28 0	0,01
MOR JUN24 CALL 30 0	38,12
MOR JUN24 PUT 30 0	0,01
MOR JUN24 CALL 32 0	36,14
MOR JUN24 PUT 32 0	0,02
MOR JUN24 CALL 34 0	34,16
MOR JUN24 PUT 34 0	0,03
MOR JUN24 CALL 36 0	32,19
MOR JUN24 PUT 36 0	0,05
MOR JUN24 CALL 38 0	30,23
MOR JUN24 PUT 38 0	0,09
MOR JUN24 CALL 40 0	28,3
MOR JUN24 PUT 40 0	0,15
MOR JUN24 CALL 42 0	26,39
MOR JUN24 PUT 42 0	0,23
MOR JUN24 CALL 44 0	24,5
MOR JUN24 PUT 44 0	0,34
MOR JUN24 CALL 46 0	22,67
MOR JUN24 PUT 46 0	0,49
MOR JUN24 CALL 48 0	20,88
MOR JUN24 PUT 48 0	0,69
MOR JUN24 CALL 50 0	19,14
MOR JUN24 PUT 50 0	0,95
MOR JUN24 CALL 52 0	17,47
MOR JUN24 PUT 52 0	1,27
MOR JUN24 CALL 56 0	14,36
MOR JUN24 PUT 56 0	2,15
MOR JUN24 CALL 60 0	11,57
MOR JUN24 PUT 60 0	3,35
MOR JUN24 CALL 64 0	9,14
MOR JUN24 PUT 64 0	4,9
MOR JUN24 CALL 68 0	7,2
MOR JUN24 PUT 68 0	6,96
MOR JUN24 CALL 70 0	6,46
MOR JUN24 PUT 70 0	8,21
MOR SEP24 CALL 5,6 0	62,47
MOR SEP24 PUT 5,6 0	0,01
MOR SEP24 CALL 6 0	62,08
MOR SEP24 PUT 6 0	0,01
MOR SEP24 CALL 6,4 0	61,69
MOR SEP24 PUT 6,4 0	0,01

MOR SEP24 CALL 6,8 0	61,29
MOR SEP24 PUT 6,8 0	0,01
MOR SEP24 CALL 7,2 0	60,9
MOR SEP24 PUT 7,2 0	0,01
MOR SEP24 CALL 7,6 0	60,5
MOR SEP24 PUT 7,6 0	0,01
MOR SEP24 CALL 8 0	60,11
MOR SEP24 PUT 8 0	0,01
MOR SEP24 CALL 9 0	59,12
MOR SEP24 PUT 9 0	0,01
MOR SEP24 CALL 10 0	58,14
MOR SEP24 PUT 10 0	0,01
MOR SEP24 CALL 11 0	57,15
MOR SEP24 PUT 11 0	0,01
MOR SEP24 CALL 12 0	56,17
MOR SEP24 PUT 12 0	0,01
MOR SEP24 CALL 13 0	55,19
MOR SEP24 PUT 13 0	0,01
MOR SEP24 CALL 14 0	54,21
MOR SEP24 PUT 14 0	0,02
MOR SEP24 CALL 15 0	53,23
MOR SEP24 PUT 15 0	0,03
MOR SEP24 CALL 16 0	52,25
MOR SEP24 PUT 16 0	0,04
MOR SEP24 CALL 17 0	51,28
MOR SEP24 PUT 17 0	0,05
MOR SEP24 CALL 18 0	50,31
MOR SEP24 PUT 18 0	0,07
MOR SEP24 CALL 19 0	49,34
MOR SEP24 PUT 19 0	0,08
MOR SEP24 CALL 20 0	48,37
MOR SEP24 PUT 20 0	0,11
MOR SEP24 CALL 22 0	46,46
MOR SEP24 PUT 22 0	0,16
MOR SEP24 CALL 24 0	44,56
MOR SEP24 PUT 24 0	0,24
MOR SEP24 CALL 26 0	42,68
MOR SEP24 PUT 26 0	0,34
MOR SEP24 CALL 28 0	40,83
MOR SEP24 PUT 28 0	0,46
MOR SEP24 CALL 30 0	39
MOR SEP24 PUT 30 0	0,61
MOR SEP24 CALL 32 0	37,22

MOR SEP24 PUT 32 0	0,8
MOR SEP24 CALL 34 0	35,47
MOR SEP24 PUT 34 0	1,02
MOR SEP24 CALL 36 0	33,74
MOR SEP24 PUT 36 0	1,27
MOR SEP24 CALL 38 0	32,07
MOR SEP24 PUT 38 0	1,57
MOR SEP24 CALL 40 0	30,45
MOR SEP24 PUT 40 0	1,93
MOR SEP24 CALL 42 0	28,86
MOR SEP24 PUT 42 0	2,31
MOR SEP24 CALL 44 0	27,31
MOR SEP24 PUT 44 0	2,74
MOR SEP24 CALL 46 0	25,83
MOR SEP24 PUT 46 0	3,23
MOR SEP24 CALL 48 0	24,43
MOR SEP24 PUT 48 0	3,8
MOR SEP24 CALL 50 0	23,05
MOR SEP24 PUT 50 0	4,4
MOR SEP24 CALL 52 0	21,71
MOR SEP24 PUT 52 0	5,04
MOR SEP24 CALL 54 0	20,44
MOR SEP24 PUT 54 0	5,75
MOR SEP24 CALL 56 0	19,23
MOR SEP24 PUT 56 0	6,52
MOR SEP24 CALL 60 0	17,01
MOR SEP24 PUT 60 0	8,25
MOR SEP24 CALL 64 0	15,07
MOR SEP24 PUT 64 0	10,28
MOR DEC24 CALL 4 0	64,09
MOR DEC24 PUT 4 0	0,01
MOR DEC24 CALL 4,8 0	63,31
MOR DEC24 PUT 4,8 0	0,01
MOR DEC24 CALL 5,6 0	62,53
MOR DEC24 PUT 5,6 0	0,01
MOR DEC24 CALL 6 0	62,14
MOR DEC24 PUT 6 0	0,01
MOR DEC24 CALL 6,4 0	61,75
MOR DEC24 PUT 6,4 0	0,01
MOR DEC24 CALL 7,2 0	60,97
MOR DEC24 PUT 7,2 0	0,01
MOR DEC24 CALL 8 0	60,19
MOR DEC24 PUT 8 0	0,01

MOR DEC24 CALL 10 0	58,25
MOR DEC24 PUT 10 0	0,03
MOR DEC24 CALL 11 0	57,29
MOR DEC24 PUT 11 0	0,04
MOR DEC24 CALL 12 0	56,33
MOR DEC24 PUT 12 0	0,06
MOR DEC24 CALL 13 0	55,37
MOR DEC24 PUT 13 0	0,08
MOR DEC24 CALL 14 0	54,42
MOR DEC24 PUT 14 0	0,11
MOR DEC24 CALL 15 0	53,47
MOR DEC24 PUT 15 0	0,14
MOR DEC24 CALL 16 0	52,53
MOR DEC24 PUT 16 0	0,17
MOR DEC24 CALL 17 0	51,59
MOR DEC24 PUT 17 0	0,21
MOR DEC24 CALL 18 0	50,66
MOR DEC24 PUT 18 0	0,26
MOR DEC24 CALL 19 0	49,74
MOR DEC24 PUT 19 0	0,32
MOR DEC24 CALL 20 0	48,83
MOR DEC24 PUT 20 0	0,38
MOR DEC24 CALL 22 0	47,01
MOR DEC24 PUT 22 0	0,52
MOR DEC24 CALL 24 0	45,22
MOR DEC24 PUT 24 0	0,68
MOR DEC24 CALL 26 0	43,47
MOR DEC24 PUT 26 0	0,89
MOR DEC24 CALL 28 0	41,73
MOR DEC24 PUT 28 0	1,11
MOR DEC24 CALL 30 0	40,05
MOR DEC24 PUT 30 0	1,38
MOR DEC24 CALL 32 0	38,4
MOR DEC24 PUT 32 0	1,69
MOR DEC24 CALL 34 0	36,77
MOR DEC24 PUT 34 0	2,02
MOR DEC24 CALL 36 0	35,17
MOR DEC24 PUT 36 0	2,38
MOR DEC24 CALL 38 0	33,62
MOR DEC24 PUT 38 0	2,79
MOR DEC24 CALL 40 0	32,14
MOR DEC24 PUT 40 0	3,26
MOR DEC24 CALL 42 0	30,66

MOR DEC24 PUT 42 0	3,75
MOR DEC24 CALL 44 0	29,23
MOR DEC24 PUT 44 0	4,28
MOR DEC24 CALL 46 0	27,87
MOR DEC24 PUT 46 0	4,87
MOR DEC24 CALL 48 0	26,55
MOR DEC24 PUT 48 0	5,52
MOR DEC24 CALL 50 0	25,28
MOR DEC24 PUT 50 0	6,2
MOR DEC24 CALL 52 0	24,04
MOR DEC24 PUT 52 0	6,93
MOR DEC24 CALL 56 0	21,74
MOR DEC24 PUT 56 0	8,55
MOR DEC24 CALL 60 0	19,63
MOR DEC24 PUT 60 0	10,37
MOR DEC24 CALL 64 0	17,68
MOR DEC24 PUT 64 0	12,36
MOR DEC24 CALL 68 0	15,9
MOR DEC24 PUT 68 0	14,52
MOR JUN25 CALL 2,8 0	65,31
MOR JUN25 PUT 2,8 0	0,01
MOR JUN25 CALL 3,2 0	64,93
MOR JUN25 PUT 3,2 0	0,01
MOR JUN25 CALL 3,6 0	64,54
MOR JUN25 PUT 3,6 0	0,01
MOR JUN25 CALL 4 0	64,16
MOR JUN25 PUT 4 0	0,01
MOR JUN25 CALL 4,8 0	63,4
MOR JUN25 PUT 4,8 0	0,02
MOR JUN25 CALL 5,6 0	62,65
MOR JUN25 PUT 5,6 0	0,03
MOR JUN25 CALL 6,4 0	61,9
MOR JUN25 PUT 6,4 0	0,06
MOR JUN25 CALL 7,2 0	61,15
MOR JUN25 PUT 7,2 0	0,08
MOR JUN25 CALL 8 0	60,42
MOR JUN25 PUT 8 0	0,12
MOR JUN25 CALL 10 0	58,6
MOR JUN25 PUT 10 0	0,22
MOR JUN25 CALL 12 0	56,81
MOR JUN25 PUT 12 0	0,36
MOR JUN25 CALL 14 0	55,06
MOR JUN25 PUT 14 0	0,53

MOR JUN25 CALL 16 0	53,34
MOR JUN25 PUT 16 0	0,74
MOR JUN25 CALL 18 0	51,66
MOR JUN25 PUT 18 0	0,98
MOR JUN25 CALL 20 0	50,02
MOR JUN25 PUT 20 0	1,27
MOR JUN25 CALL 24 0	46,85
MOR JUN25 PUT 24 0	1,95
MOR JUN25 CALL 28 0	43,82
MOR JUN25 PUT 28 0	2,79
MOR JUN25 CALL 32 0	40,96
MOR JUN25 PUT 32 0	3,78
MOR JUN25 CALL 36 0	38,24
MOR JUN25 PUT 36 0	4,92
MOR JUN25 CALL 40 0	35,65
MOR JUN25 PUT 40 0	6,19
MOR JUN25 CALL 44 0	33,2
MOR JUN25 PUT 44 0	7,61
MOR JUN25 CALL 48 0	30,9
MOR JUN25 PUT 48 0	9,18
MOR JUN25 CALL 52 0	28,75
MOR JUN25 PUT 52 0	10,9
MOR JUN25 CALL 60 0	24,89
MOR JUN25 PUT 60 0	14,8
MOR JUN25 CALL 68 0	21,6
MOR JUN25 PUT 68 0	19,29
MOR JUN25 CALL 76 0	18,83
MOR JUN25 PUT 76 0	24,31
MOR JUN25 CALL 84 0	16,48
MOR JUN25 PUT 84 0	29,77
MOR DEC25 CALL 2,8 0	65,37
MOR DEC25 PUT 2,8 0	0,02
MOR DEC25 CALL 3,2 0	65
MOR DEC25 PUT 3,2 0	0,03
MOR DEC25 CALL 3,6 0	64,63
MOR DEC25 PUT 3,6 0	0,05
MOR DEC25 CALL 4 0	64,27
MOR DEC25 PUT 4 0	0,06
MOR DEC25 CALL 4,8 0	63,54
MOR DEC25 PUT 4,8 0	0,1
MOR DEC25 CALL 5,6 0	62,83
MOR DEC25 PUT 5,6 0	0,14
MOR DEC25 CALL 6,4 0	62,12

MOR DEC25 PUT 6,4 0	0,19
MOR DEC25 CALL 7,2 0	61,42
MOR DEC25 PUT 7,2 0	0,26
MOR DEC25 CALL 8 0	60,73
MOR DEC25 PUT 8 0	0,32
MOR DEC25 CALL 10 0	59,04
MOR DEC25 PUT 10 0	0,53
MOR DEC25 CALL 12 0	57,41
MOR DEC25 PUT 12 0	0,79
MOR DEC25 CALL 14 0	55,82
MOR DEC25 PUT 14 0	1,11
MOR DEC25 CALL 16 0	54,28
MOR DEC25 PUT 16 0	1,47
MOR DEC25 CALL 18 0	52,77
MOR DEC25 PUT 18 0	1,86
MOR DEC25 CALL 20 0	51,31
MOR DEC25 PUT 20 0	2,3
MOR DEC25 CALL 24 0	48,46
MOR DEC25 PUT 24 0	3,26
MOR DEC25 CALL 28 0	45,76
MOR DEC25 PUT 28 0	4,37
MOR DEC25 CALL 32 0	43,24
MOR DEC25 PUT 32 0	5,65
MOR DEC25 CALL 36 0	40,86
MOR DEC25 PUT 36 0	7,09
MOR DEC25 CALL 40 0	38,64
MOR DEC25 PUT 40 0	8,69
MOR DEC25 CALL 44 0	36,46
MOR DEC25 PUT 44 0	10,33
MOR DEC25 CALL 48 0	34,4
MOR DEC25 PUT 48 0	12,1
MOR DEC25 CALL 52 0	32,53
MOR DEC25 PUT 52 0	14,06
MOR DEC25 CALL 60 0	29,11
MOR DEC25 PUT 60 0	18,3
MOR DEC25 CALL 68 0	26,04
MOR DEC25 PUT 68 0	22,93
MOR DEC25 CALL 76 0	23,36
MOR DEC25 PUT 76 0	27,97
MOR DEC25 CALL 84 0	21,05
MOR DEC25 PUT 84 0	33,39
MOR DEC25 CALL 92 0	19,03
MOR DEC25 PUT 92 0	39,12

MOR DEC25 CALL 100 0	17,23
MOR DEC25 PUT 100 0	45,1
MOR DEC25 CALL 120 0	13,58
MOR DEC25 PUT 120 0	61
MOR DEC25 CALL 140 0	10,86
MOR DEC25 PUT 140 0	77,98
MOR DEC25 CALL 160 0	8,8
MOR DEC25 PUT 160 0	95,77
MOR DEC26 CALL 2,8 0	65,46
MOR DEC26 PUT 2,8 0	0,04
MOR DEC26 CALL 3,2 0	65,11
MOR DEC26 PUT 3,2 0	0,06
MOR DEC26 CALL 3,6 0	64,76
MOR DEC26 PUT 3,6 0	0,09
MOR DEC26 CALL 4 0	64,42
MOR DEC26 PUT 4 0	0,11
MOR DEC26 CALL 4,8 0	63,74
MOR DEC26 PUT 4,8 0	0,18
MOR DEC26 CALL 5,6 0	63,09
MOR DEC26 PUT 5,6 0	0,26
MOR DEC26 CALL 6,4 0	62,44
MOR DEC26 PUT 6,4 0	0,36
MOR DEC26 CALL 7,2 0	61,81
MOR DEC26 PUT 7,2 0	0,47
MOR DEC26 CALL 8 0	61,2
MOR DEC26 PUT 8 0	0,59
MOR DEC26 CALL 10 0	59,72
MOR DEC26 PUT 10 0	0,97
MOR DEC26 CALL 12 0	58,33
MOR DEC26 PUT 12 0	1,43
MOR DEC26 CALL 14 0	57,01
MOR DEC26 PUT 14 0	1,96
MOR DEC26 CALL 16 0	55,75
MOR DEC26 PUT 16 0	2,56
MOR DEC26 CALL 18 0	54,56
MOR DEC26 PUT 18 0	3,22
MOR DEC26 CALL 20 0	53,42
MOR DEC26 PUT 20 0	3,94
MOR DEC26 CALL 24 0	51,3
MOR DEC26 PUT 24 0	5,54
MOR DEC26 CALL 28 0	49,12
MOR DEC26 PUT 28 0	7,09
MOR DEC26 CALL 32 0	47,06

MOR DEC26 PUT 32 0	8,76
MOR DEC26 CALL 36 0	45,09
MOR DEC26 PUT 36 0	10,53
MOR DEC26 CALL 40 0	43,23
MOR DEC26 PUT 40 0	12,4
MOR DEC26 CALL 44 0	41,46
MOR DEC26 PUT 44 0	14,37
MOR DEC26 CALL 48 0	39,78
MOR DEC26 PUT 48 0	16,45
MOR DEC26 CALL 52 0	38,2
MOR DEC26 PUT 52 0	18,62
MOR DEC26 CALL 60 0	35,32
MOR DEC26 PUT 60 0	23,26
MOR DEC26 CALL 68 0	33,05
MOR DEC26 PUT 68 0	28,55

Kein Open Interest in Futures-Kontrakten auf Aktien (MORF, TMOR) sowie europäischen Aktienoptionen (MORE).