



Kapitalmaßnahmeinformation 003

Ausstellungsdatum: 07. Juli 2020
Wirksamkeitsdatum: 08. Juli 2020
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Osram Licht AG
ISIN	DE000LED02V0
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, Ziffer 2.6.10 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	OSR
Futures-Kontrakt auf Aktien	
Equity Total Return Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

Die ams Offer GmbH hat am 06.Juli.2020 den Eintritt sämtlicher Vollzugsbedingungen der Übernahme der Osram Licht AG bekannt gegeben. Demzufolge werden gemäß Ziffer 2.6.10.1 (7) die bestehenden Positionen in Eurex-Optionskontrakten auf Aktien der Osram Licht AG wie bereits in den Kapitalmaßnahmeinformationen 001-002 beschrieben, zum theoretisch fairen Wert abgerechnet. Basis für die Berechnung des fairen Wertes ist der Angebotspreis in Höhe von 41,00 Euro.

Die Abrechnung der Kontrakte erfolgt auf Basis der Abrechnungspreise vom 07. Juli 2020 mit Wirkung zum 08. Juli 2020.

Alle Teilnehmer mit offenen Optionspositionen erhalten am 07. Juli 2020 eine Mitteilung mit einer Übersicht aller ihrer jeweils offenen Positionen. Die Buchung des Geldbetrages erfolgt am 07. Juli mit Valuta 08. Juli 2020. Die Positionen werden in der Tagesendverarbeitung vom 08. Juli 2020 mit Wirkung zum 09. Juli 2020 ausgebucht.

Der Handel in den Eurex-Kontrakten OSR wurde mit Wirkung zum 07. Juli 2020 eingestellt.



Schlussabrechnungspreise OSR für Serien mit offenen Positionen:

Finaler Angebotspreis: 41,00 EUR

Kontrakt	Settlement Preis	Impl. Volatilität
P OSR SEP20 3600	0,56	32,29
C OSR DEC20 3200	9,76	37,84
C OSR DEC20 4000	4,15	33,81
C OSR DEC20 4400	2,35	32,55
C OSR DEC20 4500	2,04	32,36
C OSR DEC20 6000	0,14	31,24
P OSR DEC20 2800	0,35	41,07
P OSR DEC20 3200	0,83	38,03
P OSR DEC20 4000	3,24	33,85
P OSR DEC20 4200	4,27	33,24
P OSR DEC20 4800	8,35	31,78
P OSR DEC20 5200	11,71	31,38
P OSR JUN21 2800	1,32	40,39
P OSR JUN21 4000	5,37	34,23
C OSR DEC21 2000	21,21	44,18
C OSR DEC21 4000	6,41	34,09
P OSR DEC21 2400	1,28	41,82
P OSR DEC21 2800	2,09	39,20
P OSR JUN22 4000	8,29	34,61
C OSR DEC22 6000	2,46	32,08
C OSR DEC22 7600	1,07	31,87
P OSR DEC22 2400	2,56	40,87
P OSR DEC22 3200	5,19	36,83
P OSR DEC23 3600	9,05	35,81