



Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 14. Juli 2020
Wirksamkeitsdatum: Wird noch bekannt gegeben
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme /Aktienumtausch / ISIN-Change
Gesellschaft	UBI Banca
ISIN	IT0003487029
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), 2.6.10.1 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	BPD
Futures-Kontrakt auf Aktien	BPDI
Equity Total Return Future	TBPD
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

Das Unternehmen Intesa SanPaolo S.p.A hat den Aktionären der UBI Banca S.p.A ein freiwilliges, öffentliches Übernahmeangebot zu unterbreitet. Die Angebotsfrist läuft vom 06 Juli 2020 bis 28. Juli 2020.

Demzufolge sollen die Aktionäre der UBI Banca S.p.A 17 Aktien der Intesa SanPaolo für je 10 UBI Banca-Aktien erhalten. Für weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe die Website der Gesellschaft unter www.group.intesasanpaolo.com.

Nachfolgend möchten wir Sie über die potenziellen Auswirkungen dieser Transaktion auf die oben aufgeführten Kontrakte informieren.



Prozedere

R-Faktor Methode / Aktienumtausch

Die Eurex-Optionen, der Eurex Aktien-Futures-Kontrakt, sowie der Eurex Total Return-Future-Kontrakt auf UBI Banca werden angepasst, sofern die Voraussetzungen in den Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, Ziffer 1.6.7 (7) für Eurex Aktien-Futures-Kontrakte, 1.26.11 (6) für Total Return-Future-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 UBI Banca-Kontrakten unverändert fortgeführt. Sind die Voraussetzungen erfüllt und die Transaktion wird vollzogen, dann wird:

- Der bisherige Basiswert wird durch die im Umtauschangebot bestimmte Aktie ersetzt
- Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)
- Auf Basis des Umtauschverhältnisses von 17 neue Aktien je 10 alte Aktien ergibt sich ein R-Faktor von:
von:
- $R = 0.58823529$

Optionen

Anpassung der Basispreise und Kontraktgrößen

- Die bestehenden Basispreise werden mit dem R-Faktor multipliziert.
- 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 Handelstages vor der Anpassung auf der Eurex-Website www.eurexchange.com eingestellt unter **Produkte > Aktienderivate > Kapitalmaßnahmen**
- Es werden keine neuen Serien mehr eingeführt.
- Sobald keine Serien mit offenen Positionen mehr bestehen, wird der Handel in dem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.
- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Handelstag vor der Anpassung gelöscht.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Options

Futures

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:
 $\text{Kontraktgröße neu} = \text{Kontraktgröße alt} / R\text{-Faktor}$
- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Handelstag vor der Anpassung gelöscht.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Futures
- Es werden keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.
- Sobald keine Verfallmonate mit offenen Positionen mehr bestehen, wird der Handel in dem Kontrakt ausgesetzt und eingestellt.

Demzufolge wird sich die Firmierung der oben aufgeführten Kontrakte wie in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt ändern.

Produktkürzel alt/neu	Produkt- ISIN alt/neu	Basis- wertkürzel alt	Basis- wertkürzel neu	Basiswert- ISIN alt	Basiswert- ISIN neu	Name alt	Name neu
BPD	IT0003487029	BPD	IES5	IT0003487029	IT0000072618	UBI Banca	Intesa SanPaolo
BPDI	DE000A2GF9G8	BPD	IES5	IT0003487029	IT0000072618	UBI Banca	Intesa SanPaolo
TBPD	DE000A2X1435	BPD	IES5	IT0003487029	IT0000072618	UBI Banca	Intesa SanPaolo

Über den weiteren Ablauf werden wir Sie informieren, sofern Änderungen bzw. neue Informationen im Verlauf der Transaktion dies erforderlich machen. Unmittelbar nach Bekanntgabe des Resultats des Übernahmeangebotes durch Intesa SanPaolo S.p.A werden wir bekannt geben zu welchem Tag die möglichen Änderungen wirksam werden.