

## Kapitalmaßnahmeinformation

**Ausstellungsdatum:** 17. August 2021  
**Wirksamkeitsdatum:** Wird noch bekannt gegeben  
**Kontakt:** Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
<b>Gesellschaft</b>	<b>Zooplus AG</b>
<b>ISIN</b>	<b>DE0005111702</b>
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffern 1.6.7 (7), 1.13.8 (7), 1.26.11 (6), 2.6.10.1 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	ZO1
Futures-Kontrakt auf Aktien	ZO1F
Equity Total Return Future	
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

In einer Mitteilung vom 13. August 2021 hat Zooplus AG bekannt gegeben, dass Hellman & Friedman beabsichtigt, den Aktionären der Zooplus AG ein freiwilliges Übernahmeangebot zu unterbreiten.

Den Ankündigungen zufolge sollen die Aktionäre der Zooplus AG EUR 390,00 in bar für jede Aktie erhalten. Weitere Informationen zu dieser Transaktion finden sich auf der Website der Zielgesellschaft unter [www.zooplus.com](http://www.zooplus.com).

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

## Prozedere

### Fair Value Methode

Die auf Eurex gelisteten Optionskontrakte, die Aktien-Futures-Kontrakte, die Aktiendividenden-Futures-Kontrakte und die Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die sich auf Aktien der Zooplus AG beziehen, werden zum theoretisch fairen Wert abgerechnet, sofern die Voraussetzungen in den Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer 2.6.10.1 (7) für Optionskontrakte, Ziffer 1.6.7 (7) für Aktien-Futures-Kontrakte, Ziffer 1.13.8 (7) für Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden sowie Ziffer 1.26.11 (6) für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in den Kontrakten, die sich auf Zooplus AG beziehen, unverändert fortgeführt. Für die Berechnung des theoretischen fairen Wertes werden folgende Parameter festgelegt:

### Optionen

#### 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. Juli 2021 bis 12. August 2021), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet. Die impliziten Volatilitäten für Serien beginnend mit Fälligkeit September 2021 sind in der nachfolgenden Tabelle ausgewiesen:

Verfalljahr	Verfallmonat	Basispreis	impl. Volatilität
2021	September	11000	88,64
2021	September	12000	88,64
2021	September	13000	87,14
2021	September	14000	85,23
2021	September	15000	81,55
2021	September	16000	77,72
2021	September	17000	73,41
2021	September	18000	69,12
2021	September	19000	64,91
2021	September	20000	60,69
2021	September	22000	53,15
2021	September	23000	49,97
2021	September	24000	46,88
2021	September	25000	44,14
2021	September	26000	41,82
2021	September	27000	39,82
2021	September	28000	38,10
2021	September	29000	36,79

2021	September	30000	36,07
2021	September	31000	35,98
2021	September	32000	36,50
2021	September	33000	37,53
2021	September	34000	38,90
2021	September	36000	42,38
2021	Oktober	22000	48,58
2021	Oktober	23000	46,34
2021	Oktober	24000	44,43
2021	Oktober	25000	42,44
2021	Oktober	26000	40,88
2021	Oktober	27000	39,43
2021	Oktober	28000	38,03
2021	Oktober	29000	37,06
2021	Oktober	30000	36,53
2021	Oktober	31000	36,17
2021	Oktober	32000	36,21
2021	Oktober	33000	36,83
2021	Dezember	8400	69,60
2021	Dezember	9200	68,70
2021	Dezember	10000	67,34
2021	Dezember	12000	62,71
2021	Dezember	13000	60,15
2021	Dezember	14000	58,45
2021	Dezember	15000	56,13
2021	Dezember	16000	54,45
2021	Dezember	17000	52,49
2021	Dezember	18000	50,83
2021	Dezember	19000	49,25
2021	Dezember	20000	47,68
2021	Dezember	22000	44,90
2021	Dezember	24000	42,43
2021	Dezember	26000	40,27
2021	Dezember	28000	38,37
2021	Dezember	30000	37,01
2021	Dezember	32000	36,60
2021	Dezember	34000	36,94
2021	Dezember	36000	37,78
2021	Dezember	38000	39,20
2022	März	15000	56,81
2022	März	16000	54,59
2022	März	17000	52,56
2022	März	18000	51,05
2022	März	19000	49,17
2022	März	20000	47,52
2022	März	22000	44,64
2022	März	24000	42,25
2022	März	26000	39,99
2022	März	28000	37,88
2022	März	30000	36,29

2022	März	32000	35,64
2022	März	34000	35,73
2022	März	36000	36,21
2022	März	38000	36,93
2022	Juni	8400	68,40
2022	Juni	9200	66,00
2022	Juni	10000	64,12
2022	Juni	12000	59,19
2022	Juni	14000	55,41
2022	Juni	16000	51,69
2022	Juni	18000	48,46
2022	Juni	19000	47,14
2022	Juni	20000	45,99
2022	Juni	22000	43,41
2022	Juni	24000	41,23
2022	Juni	26000	39,55
2022	Juni	28000	37,76
2022	Juni	30000	36,35
2022	Juni	32000	35,76
2022	Juni	34000	35,58
2022	Juni	36000	35,69
2022	Juni	38000	36,36
2022	Juni	40000	36,86
2022	Juni	48000	41,29
2022	Dezember	9200	60,14
2022	Dezember	10000	58,39
2022	Dezember	12000	54,67
2022	Dezember	14000	51,44
2022	Dezember	16000	48,45
2022	Dezember	18000	46,34
2022	Dezember	20000	43,90
2022	Dezember	24000	40,44
2022	Dezember	28000	37,70
2022	Dezember	32000	36,05
2022	Dezember	36000	35,70
2022	Dezember	40000	36,13
2022	Dezember	48000	38,66

## Optionen und Aktien-Futures-Kontrakte

### 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:

<b>Dividendenbetrag in Euro</b>	<b>Ex-Tag</b>
Keine Dividenden	

Für die Options- und Futures-Kontrakte bezogen auf die Zooplus AG werden in der Regel keine neuen Serien mehr eingeführt werden. 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.