

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 14. Oktober 2021

Wirksamkeitsdatum: 29. Oktober 2021

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

Kapitalmaßnahme	Sonderdividende
Gesellschaft	Inditex S.A.
ISIN	ES0148396007
Regelwerk	Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (2), 1.13.8 (2), 2.6.10.1 (2)
Optionskontrakt auf Aktien	IXD, IXD1, IXD2, IXD4, IXD5
Futures-Kontrakt auf Aktien	IXDH, IXDI, IXDR,
Stock Tracking Future	1IXD
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	I2XD, I3XD, I4XD, I8XD, I9XD

Die Gesellschaft Inditex S.A. hat die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von EUR 0,35 je Aktie mit Ex-Dividende-Termin 29. Oktober 2021 bekannt gegeben.

Die Sonderausschüttung führt zu Anpassungen der oben aufgeführten Kontrakte.

Weitere Informationen zu den Ausschüttungen finden Sie auf der Website der Gesellschaft unter www.inditex.com.

Prozedere

R-Faktor Methode

Bestimmung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

S1	Schlussauktionspreis der Inditex-Aktie
S2	S1 minus Bonusdividende
R-Faktor	$S2 / S1$

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 Cum-Handelstages auf der Eurex-Website www.eurex.com eingestellt unter **Rules & Regs > Kapitalmaßnahmen > Informationen über Kapitalmaßnahmen**
- Neue Serien mit der Standardkontraktgröße 100 und der Versionsnummer 0 werden mit Wirkung zum Ex-Tag eingeführt.
- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Cum-Handelstag gelöscht. Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Options.

Ausübungen

- Bei Ausübung einer angepassten Serie findet grundsätzlich ein Barausgleich für den nicht ganzzahligen Teil der neuen Kontraktgröße statt.
- Bei angepassten Serien ab der Version 2 kann es zu Abweichungen im Lieferprozess kommen. Im Report RPTTA111 (All Active/Inactive Series) sind die Teile der Kontraktgröße dargestellt, für welche bei der Ausübung einer angepassten Serie ein Barausgleich stattfindet.

Futures

1. 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:
 $\text{Kontraktgröße neu} = \text{Kontraktgröße alt} / \text{R-Faktor}$
- Alle bestehenden Orders und Quotes werden nach Handelsschluss am letzten Cum-Handelstag gelöscht.
- Die Anpassung bezieht sich auch auf bestehende Positionen in TES Flexible Futures.

2. Einführung eines neuen Kontrakts

- Es werden ein neuer Aktien-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 100, ein neuer Stock-Tracking-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 100 sowie ein neuer Aktiendividenden-Futures-Kontrakt mit Standardkontraktgröße 1000 eingeführt.
- Der genaue Einführungszeitpunkt wird per Rundschreiben bekannt gegeben.
- Sobald die neuen Kontrakte zum Handel zur Verfügung stehen und keine Verfallmonate mit offenen Positionen in den ursprünglichen Kontrakten mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesen Kontrakten ausgesetzt und eingestellt.
- Ferner werden in den ursprünglichen Kontrakten 1IXD, IXDH, IXDI, IXDR, I2XD, I3XD, I4XD, I8XD und I9XD keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

Falls für einen der ursprünglichen Kontrakte 1IXD, IXDH, IXDI, IXDR, I2XD, I3XD, I4XD, I8XD und I9XD am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung dieses Kontraktes und keine Einführung eines neuen Kontrakts für diesen.