

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 23. Januar 2023
Wirksamkeitsdatum: Wird noch bekannt gegeben
Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
Gesellschaft	Rovio Entertainment Oyj
ISIN	FI4000266804
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffern 2.6.10.1 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	ROV
Futures-Kontrakt auf Aktien	
Equity Total Return Future	
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

In einer Mitteilung vom 19. Januar 2023 hat die Gesellschaft Playtika Holding Corp. ihr Interesse bekundet, die Gesellschaft Rovio Entertainment Oyj zu übernehmen. Dem veröffentlichten „Vorschlag“ zufolge sollen die Aktionäre der Rovio Entertainment Oyj EUR 9,05 in bar für jede Aktie erhalten.

Die betreffenden Veröffentlichungen finden sich auf der Website der Zielgesellschaft unter www.rovio.com bzw. auf der Website der Bietergesellschaft unter www.playtika.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 sich auf Aktien der Rovio Entertainment Oyj 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 erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in den betreffenden Kontrakten 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 (06. Januar 2023 bis 19. Januar 2023), berechnet wurden. Für Call und Put wird dieselbe Volatilität verwendet.

Verfallsjahr	Verfallsmonat	Basispreis	Implizite Vola
2023	3	4	48,68
2023	3	4,4	46,88
2023	3	4,8	42,74
2023	3	5	39,82
2023	3	5,2	38,94
2023	3	5,4	37,41
2023	3	5,6	36,02
2023	3	5,8	34,70
2023	3	6	33,85
2023	3	6,2	32,94
2023	3	6,4	32,42
2023	3	6,6	31,91
2023	3	6,8	31,44
2023	3	7	31,09
2023	3	7,2	31,16
2023	3	7,6	31,26
2023	6	3,8	45,62
2023	6	4	45,62
2023	6	4,4	42,85
2023	6	4,8	40,19
2023	6	5,2	38,11
2023	6	5,6	36,41
2023	6	6	34,90
2023	6	6,4	33,55
2023	6	6,8	32,43
2023	6	7,2	31,00
2023	6	7,6	28,75
2023	6	8	28,44
2023	6	9	28,54
2023	9	3,8	43,62

2023	9	4	42,57
2023	9	4,4	40,64
2023	9	4,8	38,82
2023	9	5,2	37,15
2023	9	5,6	35,61
2023	9	6	34,36
2023	9	6,4	33,24
2023	9	6,8	32,18
2023	9	7,2	31,05
2023	9	7,6	29,39
2023	9	8	29,35
2023	12	4	39,07
2023	12	4,4	39,07
2023	12	4,8	37,65
2023	12	5,2	36,33
2023	12	5,6	34,95
2023	12	6	33,90
2023	12	6,4	32,94
2023	12	6,8	32,01
2023	12	7,2	30,84
2023	12	7,6	29,37

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:

Dividendenbetrag in Euro	Ex-Tag
0,0663	29.03.2023
0,1000	27.03.2024

Mit sofortiger Wirkung werden für die betreffenden Futures- und Optionskontrakte in der Regel keine neuen Serien mehr eingeführt. 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.