

Kapitalmaßnahmeinformation-Korrektur

Ausstellungsdatum: 08. Februar 2021

Wirksamkeitsdatum: 15. Februar 2021

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

Kapitalmaßnahme	Kapitalrückzahlung, Aktienzusammenlegung, ISIN-Änderung
Gesellschaft	Tesco PLC
ISIN	GB0008847096
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (4), 1.13.8 (4), 2.6.10.1 (5)
Optionskontrakt auf Aktien	TCO
Futures-Kontrakt auf Aktien	TSCF
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	T2SC

Die Gesellschaft Tesco PLC hat eine Kapitalrückzahlung in Höhe von GBP 0,5093 pro Aktie an ihre Aktionäre sowie eine Aktienzusammenlegung im Verhältnis 15:19 bekannt gegeben. Die konsolidierten Aktien werden unter der neuen ISIN GB00BLGZ9862 geführt.

Weitere Informationen zu dieser Transaktion siehe auf der Website der Gesellschaft unter www.tescopl.com.

Ferner wird sich die ISIN der oben aufgeführten Kontrakte wie in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt ändern:

Produktkürzel alt/neu	ISIN des Basiswerts alt	ISIN des Basiswerts neu	Produkt ISIN alt	Produkt ISIN neu
TCO	GB0008847096	GB00BLGZ9862	GB0008847096	GB00BLGZ9862
TSCF	GB0008847096	GB00BLGZ9862	DE000A0MEMB8	DE000A0MEMB8
T2SC	XC000A1KD045	XC000A1KD045	DE000A1KD0R1	DE000A1KD0R1

Dies führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte.

Prozedere

R-Faktor Methode

Ermittlung des Anpassungsfaktors (R-Faktor) (bei Special Dividend auf ursprüngliche Aktienanzahl)

S1	Schlussauktionspreis der Aktie
S2	(S1 minus GBP 0,5093) * 19/15
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 1000 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:
Kontraktgröße neu = Kontraktgröße alt / 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 wird ein neuer Aktien-Futures-Kontrakt eingeführt mit Standardkontraktgröße 1000 sowie ein neuer Aktiendividenden-Future mit Standardkontraktgröße 1000.
- 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 T2SC/TSCF keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

Falls für einen der ursprünglichen Kontrakte (T2SC/TSCF) am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, erfolgt keine Anpassung dieses Kontraktes und keine Einführung eines neuen Kontrakts für diesen.