

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 26. Juli 2023

Wirksamkeitsdatum: 31. Oktober 2023

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

Kapitalmaßnahme	Sonderdividende
Gesellschaft	Inditex S.A.
ISIN	ES0148396007
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (2), 1.13.8 (2), 1.27.8 (2), 2.6.10.1 (2)
Optionskontrakt auf Aktien	IXD
Futures-Kontrakt auf Aktien	IXDI, IXDR,
Stock Tracking Future	1IXD
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	I2XD, I3XD, I4XD, I5XD

Die Gesellschaft Inditex S.A. hat die Ausschüttung einer Bonusdividende in Höhe von EUR 0,404 je Aktie zusätzlich zur Zahlung einer regulären Dividende in Höhe von EUR 0,196 je Aktie bekannt gegeben. Die Ausschüttung der Bonusdividende führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte.

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

Prozedere

R-Faktor Methode

S1	Schlussauktionspreis der Inditex-Aktie
S2	S1 minus regulärer Dividende
S3	S2 minus Bonusdividende
R-Faktor	$S3 / S2$

Optionen

1. 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.
- Neue Serien mit Standardkontraktgröße 100 und Versionsnummer 0 werden 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.

2. Ausübungen

- Bei Ausübung einer angepassten Serie findet grundsätzlich ein Barausgleich für den nicht ganzzahligen Teil der neuen Kontraktgröße statt.

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 Nachfolgekontrakte zum Handel zur Verfügung stehen und keine Verfallmonate mit offenen Positionen in den ursprünglichen Kontrakten mehr vorhanden sind, wird der Handel in den betreffenden Futures-Kontrakten eingestellt.
- Ferner werden in den ursprünglichen Kontrakten keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.

Sollten in den betroffenen Futures-Kontrakten am letzten Cum-Handelstag nach Handelsschluss keine offenen Positionen bestehen, dann werden diese nicht angepasst und keine Folgekontrakte eingeführt.