

Kapitalmaßnahmeinformation

Ausstellungsdatum: 24. Juli 2024

Wirksamkeitsdatum: 27. August 2024

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

Kapitalmaßnahme	Sonderdividende
Gesellschaft	Sodexo
ISIN	FR0000121220
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7 (2), 1.13.8 (2), 1.26.11 (2), 2.6.10.1 (2)
Optionskontrakt auf Aktien	SJ7,SJ7B
Futures-Kontrakt auf Aktien	SJ7H,SJ7P
Stock Tracking Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	S3J7

Die Gesellschaft Sodexo hat die Ausschüttung einer Sonderdividende in Höhe von EUR 6,24 je Aktie bekannt gegeben.

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

Die Sonderdividende führt zu einer Anpassung der oben aufgeführten Kontrakte.

Prozedere

R-Faktor Methode

Bestimmung des Anpassungsfaktors (R-Faktor)

S1	Schlussauktionspreis der Aktie
S2	S1 minus Sonderdividende
R-Faktor	$S2 / S1$

Optionen (SJ7)

1. Anpassung der Basispreise und Kontraktgrößen

- Die bestehenden Basispreise werden mit dem R-Faktor multipliziert. Basispreise werden nach mathematischen Rundungsregeln auf die ihrem Notierungsstandard entsprechende Anzahl von Dezimalstellen auf- oder abgerundet.
- 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. Die existierenden Flexiblen Basispreise werden nach mathematischen Rundungsregeln auf vier Dezimalstellen auf- oder abgerundet.

2. Ausübungen

- Bei Ausübung einer angepassten Serie findet grundsätzlich ein Barausgleich für den nicht ganzzahligen Teil der neuen Kontraktgröße statt.
- Report RPTTA711 (All Active/Inactive Series) weist die Kontraktgrößen der angepassten Serien aus.

Basket Option (SJ7B)

Die Basispreise der Sodexo Pluxee Basket Option (SJ7B) werden nicht angepasst. Die Anpassung erfolgt nur bezogen auf die Sodexo-Aktie als Teil des Basket mittels K-Faktor. Zur Berücksichtigung der Sonderdividende wird ab dem Tag, an dem die Sodexo-Aktie ex Sonderdividende gehandelt wird, der Wert bzw. der tägliche Schlusspreis des Sodexo Pluxee Baskets wie folgt berechnet.

Angepasster Basketpreis = (Schlusskurs Sodexo-Aktie * K-Faktor) + Schlusspreis Pluxee-Aktie

Die Anzahl der Sodexo-Aktien als Bestandteil des Baskets werden mit dem K-Faktor multipliziert. Die exakte Anzahl wird publiziert, sobald der R-Faktor verfügbar ist. Die

resultierenden Dezimalstellen werden im Falle einer Ausübung bar abgerechnet. Der Barabrechnungspreis errechnet sich als Schlusspreis Sodexo-Aktie * Dezimalstellen.

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 werden neue Aktien-Futures-Kontrakt eingeführt mit Standardkontraktgröße 100, sowie ein neuer Aktiendividenden-Future mit Standardkontraktgröße 1000 eingeführt.
- Der genaue Einführungszeitpunkt wird per Rundschreiben bekannt gegeben.
- Ab dem Anpassungstag werden keine neuen Verfallmonate mehr eingeführt.
- Sobald keine Verfallmonate mit offenen Positionen in den angepassten Kontrakten mehr vorhanden sind, wird der Handel in diesen Kontrakten eingestellt.

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