

## Kapitalmaßnahmeinformation 001

**Ausstellungsdatum:** 26. Juni 2026  
**Wirksamkeitsdatum:** Wird noch bekannt gegeben  
**Kontakt:** Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Kapitalmaßnahme	Übernahme
<b>Gesellschaft</b>	<b>OCI N.V.</b>
<b>ISIN</b>	<b>NL0010558797</b>
Regelwerk	Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland, Ziffer(n) 1.6.7(7), 1.13.8 (7), 1.26.11 (6), 1.27.8 (7), 2.6.10 (7)
Optionskontrakt auf Aktien	OIC
Futures-Kontrakt auf Aktien	
Equity Total Return Future	
Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden	

Am Abend des 24. Juni 2026 hat die Gesellschaft OCI N.V. bekannt gegeben, dass NNS Holding Limited Beabsichtigt ein Übernahmeangebot mit einem Angebotspreis von 4,10 Euro cum dividende je OCI N.V.-Aktie abzugeben.

Weitere Informationen zur Aufnahme der Verhandlungen finden sich auf der Website der OCI N.V.

Nachfolgend möchten wir Sie über die potenziellen Auswirkungen dieser Transaktion auf die oben aufgeführten Kontrakte informieren.

## Prozedere

### Fair Value Methode

Die Eurex-Optionen auf OCI N.V. 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 Eurex Options-Kontrakte, erfüllt sind. Sollten diese Voraussetzungen nicht erfüllt sein, so wird der Handel in den OCI N.V. -Kontrakten unverändert fortgeführt. Für die Berechnung des theoretischen fairen Wertes werden folgende Parameter festgelegt:

### Option

#### 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 (25. November 2025 bis 8. Dezember 2025), berechnet wurden.

Kontraktdatum	Verfallsjahr	Verfallsmonat	Basispreis	Implizite Volatilität
18/09/2026	2026	9	3,00	60,93
18/09/2026	2026	9	3,20	57,71
18/09/2026	2026	9	3,40	55,24
18/09/2026	2026	9	3,60	53,46
18/09/2026	2026	9	3,80	52,27
18/09/2026	2026	9	4,00	51,45
18/09/2026	2026	9	4,20	50,89
18/09/2026	2026	9	4,40	50,55
18/09/2026	2026	9	4,60	50,37
18/09/2026	2026	9	4,80	50,31
18/09/2026	2026	9	5,20	50,46
18/09/2026	2026	9	5,60	50,80
18/09/2026	2026	9	6,00	51,23
18/09/2026	2026	9	6,40	51,65
18/09/2026	2026	9	6,80	52,01
18/12/2026	2026	12	3,00	53,03
18/12/2026	2026	12	3,20	51,36
18/12/2026	2026	12	3,40	49,99
18/12/2026	2026	12	3,60	48,90
18/12/2026	2026	12	3,79	48,10
18/12/2026	2026	12	3,80	48,06
18/12/2026	2026	12	4,00	47,45
18/12/2026	2026	12	4,20	47,01
18/12/2026	2026	12	4,40	46,71
18/12/2026	2026	12	4,60	46,53
18/12/2026	2026	12	4,80	46,43
18/12/2026	2026	12	5,20	46,45

18/12/2026	2026	12	5,60	46,65
18/12/2026	2026	12	6,00	46,96
18/12/2026	2026	12	6,07	47,02
18/12/2026	2026	12	6,40	47,33
18/12/2026	2026	12	7,20	48,10
18/12/2026	2026	12	8,00	48,79

### 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
0,1677	21.10.2026

Mit sofortiger Wirkung werden für die Eurex-Optionen auf OCI N.V. in der Regel keine neuen Serien mehr eingeführt. Serien ohne offene Positionen werden gelöscht. Da in den Futures-Kontrakten auf OCI N.V. kein Open Interest besteht, wird der Handel in diesen Kontrakten mit sofortiger Wirkung eingestellt.

Über den weiteren Ablauf werden wir Sie informieren, sofern Änderungen bzw. neue Informationen im Verlauf der Transaktion dies erforderlich machen.