## 3. Details

### I. Index Total Return Futures

#### A. Überblick der Kontraktspezifikationen für MSCI TRF

| Kontraktspezifikation | MSCI World Index TRF | MSCI EAFE Index TRF | MSCI EM Index TRF |
|---|---|---|---|
| **Produkt-ID** | TMWO | TMFA | TMEM |
| **Basiswert-MSCI-Indizes** | MSCI World - NTR in USD (M1WO-Index) | MSCI EAFE - NTR in USD (M1EA-Index) | MSCI EM - NTR in USD (M1EF-Index) |
| **Accrued Funding & Daily Funding**<br>*(Indexpunkte)* | **Allgemeine Prinzipien:**<br>**Accrued Funding** in Indexpunkten wird täglich bis einschließlich zum Dritten Freitag (Verfalltag) berechnet.<br>Accrued Funding wird ab dem Produktstart (d.h. 11. März 2024) kumuliert und stellt den kumulierten Wert des Daily Funding aller Handelstage dar.<br>**Daily Funding** wird an jedem Handelstag basierend auf den Overnight-Finanzierungs-kosten des Index auf Basis des vorhergehenden Indexschlusskurses, der Referenz-Overnight-Finanzierungskosten und dem Zeitraum der Funding Days berechnet.<br>**Besondere Regelung und untertägige Berechnung des Daily Funding und Aktualisierung des Accrued Funding:**<br>**Session 1:** Das Accrued Funding bleibt gegenüber dem Wert des Vortags unverändert.<br>*Accrued Funding (t) = Accrued Funding (t-1)*<br>**Session 2:** Sobald die Funding Rate SOFR (t-1) verfügbar ist, wird das Daily Funding entsprechend berechnet und das Accrued Funding wird schrittweise vor dem (nächsten) Handelsstart für Session 2 aktualisiert.<br>*Accrued Funding (t) = Accrued Funding (t-1) + Daily Funding (t)*<br>*Zur Beachtung: Wenn Current Trading Day (t) ein US-Feiertag ist, sind Funding Days und daher Daily Funding = Null* | | |

| Kontraktspezifikation | MSCI World Index TRF | MSCI EAFE Index TRF | MSCI EM Index TRF |
|---|---|---|---|
| **Handelszeiten** | **Session 1:**<br>**Order-Book (nur TAC):**<br>• Pre-trading: 01:00 – 01:30 Uhr MEZ (02:00 – 02:30 Uhr MESZ)<br>• Continuous Trading: 01:30 – 13:00 Uhr MEZ (02:30 – 13:00 Uhr MESZ)<br>**Off-Book (TAC und TAM):**<br>• Off-Book-Handelszeit: 01:30 – 13:00 Uhr MEZ (02:30 – 13:00 Uhr MESZ)<br>**Session 2:**<br>**Order-Book (nur TAC):**<br>• Pre-trading: 13:00 – 14:30 Uhr MEZ/MESZ<br>• Continuous Trading: 14:30 – 22:00 Uhr MEZ/MESZ<br>• Letzter Handelstag: Continuous Trading bis 22:00 Uhr MEZ/MESZ<br>**Off-Book (TAC und TAM):**<br>• Off-Book-Handelszeit: 14:30 – 22:00 Uhr MEZ<br>• Letzter Handelstag: TES-Handel bis 22:00 Uhr MEZ | | |

**B. Delta-neutrale Trade-at-Market Trades**

Produkte, für die die Funktion Delta-neutral Trade-at-Market zur Verfügung stehen wird:

| Produkte | | Mindestanzahl der gehandelten Kontrakte |
|---|---|---|
| **Index Total Return Futures („TRF")** | **Index Futures-Kontrakt** | |
| Index Total Return Futures-Kontrakte auf den MSCI World (NTR, USD) (TMWO) | Futures-Kontrakte auf den MSCI World Index (NTR, USD) (FMWO) | 10 |
| Index Total Return Futures-Kontrakte auf den MSCI EAFE (NTR, USD) (TMFA) | Futures-Kontrakte auf den MSCI EAFE Index (NTR, USD) (FMFA) | 10 |
| Index Total Return Futures-Kontrakte auf den MSCI Emerging Markets (NTR, USD) (TMEM) | Futures-Kontrakte auf den MSCI Emerging Markets Index (NTR, USD) (FMEM) | 10 |

## II. Dividendenderivate

Für die folgenden Aktiendividenden-Futures werden die Verfälle auf bis zu sieben Jahre erweitert:

| Eurex Produkt-ID | Dividenden-Future auf | Basiswert-ISIN | Eurex-Gruppen-kennung | Produkt-währung | Produkt-ISIN |
|---|---|---|---|---|---|
| S3SD | Banco Santander S.A. | XC000A1CRK97 | ES21 | EUR | DE000A2GGF78 |
| G3ZF | ENGIE S.A. | XC000A1CRLL2 | FR21 | EUR | DE000A2YY3Z6 |
| I3ES | Intesa Sanpaolo S.p.A. | XC000A1DKDF4 | IT21 | EUR | DE000A1KQNR8 |
| F2IA | Stellantis N.V. | XC000A2X2GS8 | IT21 | EUR | DE000A2YYX49 |
| F3IA | Stellantis N.V. | XC000A2X2GS8 | IT21 | EUR | DE000A2QJM09 |
| T32NE | Telefonica | XC000A1DKC10 | ES21 | EUR | DE000A160YZ9 |
| V2VD | Veolia Environnement S.A. | XC000A13RNC9 | FR21 | EUR | DE000A13RN33 |
| V3VD | Veolia Environnement S.A. | XC000A13RNC9 | FR21 | EUR | DE000A3C4375 |

| Eurex Produkt-ID | Kontraktgröße | Minimale Preisveränderung | Mindestgröße für Block Trades | Maximale Laufzeit (Jahre) |
|---|---|---|---|---|
| S3SD | 1000 | 0,001 | 250 | 7 |
| G3ZF | 1000 | 0,001 | 100 | 7 |
| I3ES | 1000 | 0,001 | 500 | 7 |
| F2IA | 1000 | 0,001 | 50 | 7 |
| F3IA | 1000 | 0,001 | 50 | 7 |
| T32NE | 1000 | 0,001 | 250 | 7 |
| V2VD | 1000 | 0,001 | 50 | 7 |
| V3VD | 1000 | 0,001 | 50 | 7 |