

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

**Aktienindexderivate: I. Erweiterung der US-Handelszeiten für MSCI Total Return Index-Futures und ausgewählte MSCI Index-Futures;
II. Ermöglichung von Trade-at-Market (TAM)-Transaktionen für Index Total Return Futures am nächsten Börsenhandelstag (t+1)**

Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland hat die Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland beschlossen.

Sie tritt mit Wirkung zum 05.08.2024 in Kraft.

Die Änderungssatzung kann auf der Internetseite der Eurex Deutschland (<https://www.eurex.com/ex-de/>) abgerufen und im „Präsenzordner Regelwerke“ der Eurex Deutschland am Empfang des Handelssaals, Börsenplatz 4, 60313 Frankfurt am Main, Deutschland, während der allgemeinen Öffnungszeiten eingesehen werden.

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

EINFÜGUNGEN SIND UNTERTRICHEN;

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

3.2.6 Trade-at-Market Geschäfte („TAM“)

(1) Für TAM zugelassene Kontrakte

Folgende Kontrakte sind zugelassen:

Produkt	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte
Index-Total-Return-Futures	
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® 50 Index (TESX) und EURO STOXX® Banks Index (TESB)	100
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® Select Dividend 30 Index (TEDV)	10
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den FTSE® 100 (TTUK)	50
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf die iStoxx Europe Collateral Indizes (TCBX and TC1L)	100
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf MSCI Indizes (TMWO, TMFA, TMEM)	10
Als Basket-Geschäfte gehandelte Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte gemäß Ziffer 3.2.7	n.a.

Bei Eingabe eines Trade-at-Market Geschäfts ist die Angabe eines in diesem Produkt gültigen Basiswertes durch die in dem Geschäft beteiligten Börsenteilnehmer erforderlich.

(2) Besondere Bestimmungen für TAM-Geschäfte mit Index-Total-Return-Futures

Werden die Bedingungen eines TAM-Geschäfts unter Bezugnahme auf einen offiziellen täglichen Indexschlusskurs als „Custom Underlying Level“ vereinbart und

ist dieser offizielle tägliche Indexschlusskurs während der Off-Book-Trading-Periode gemäß Annex C der Kontraktsspezifikationen am Handelstag (t) dieses Kontrakts nicht verfügbar, wird das TAM-Geschäft entsprechend am nächsten Handelstag (t+1) eingegeben, sodass:

- der TRF-Spread für den Index-Total-Return-Futures-Kontrakt wie vereinbart unter Bezugnahme auf den Handelstag (t) eingegeben wird,
- der gehandelte Futures-Preis (t+1) dem gehandelten Futures-Preis (t) entspricht, so wie er gemäß Ziffer 1.22.8 unter Bezugnahme auf den offiziellen täglichen Indexschlusskurs (t), der als Custom Underlying Level eingegeben wird, berechnet worden wäre („theoretischer gehandelter Futures-Preis (t)“),
- die Börsenteilnehmer ein angepasstes Custom Underlying Level (t+1) bestimmen und vereinbaren, sodass der gemäß Ziffer 1.22.8 berechnete gehandelte Futures-Preis (t+1) dem theoretischen gehandelten Futures-Preis (t) entspricht.

Dabei gilt:

t = vereinbarter Referenzhandelstag (des offiziellen täglichen Indexschlusskurses), und

t+1 = dem vereinbarten Referenzhandelstag unmittelbar folgender Handelstag

[...]

Die vorstehende Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland wird hiermit ausgefertigt. Die Änderung tritt dem Beschluss der Geschäftsführung der Eurex Deutschland entsprechend am 05.08.2024 in Kraft.

Frankfurt am Main, 24.07.2024

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Jonas Ullmann