

## *Bekanntmachung der Eurex Deutschland*

**UPDATE: Aktienindexderivate: Einführung von Futures auf STOXX® US-Indizes**

**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 09.09.2024 in Kraft.

---

Die Änderungen können auf der Internetseite der Eurex Deutschland (<https://www.eurex.com/ex-de/>) abgerufen werden. Eine Ausfertigung liegt zusätzlich am Empfang des Handelssaals, Börsenplatz 4, 60313 Frankfurt am Main, Deutschland, während der allgemeinen Öffnungszeiten öffentlich zur Einsicht aus.

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

EINFÜGUNGEN SIND UNTERSTRICHEN;

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

## **Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte**

[...]

### **Teilabschnitt 1.3 Kontraktsspezifikationen für Index-Futures-Kontrakte**

[...]

#### **1.3.1 Kontraktgegenstand**

[...]

- (2) An der Eurex Deutschland stehen Futures-Kontrakte auf folgende Aktienindizes, wobei die Veröffentlichung der anbei genannten Institutionen für die Zusammensetzung, Gewichtung und Berechnung gelten, zur Verfügung:

[...]

- Die folgenden STOXX® US(A) Indizes (für die Zwecke der Index-Futures-Kontrakte „STOXX® US(A)-500 Indizes“):

- STOXX® USA 500 ESG-X (Price, USD) Index (STOXX Limited)
- STOXX® USA 500 (Price, USD) Index (STOXX Limited)
- STOXX® US 2000 (Price, USD) Index (STOXX Limited)
- STOXX® USA Titans 30 (Price, USD) Index (STOXX Limited)
- STOXX® US Nexus 100 (Price, USD) Index (STOXX Limited)

[...]

[...]

- (6) Der Wert eines Kontrakts beträgt:

[...]

- USD 100 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den MSCI AC Asia (NTR, USD), MSCI AC Asia Pacific Index, MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index, MSCI AC Asia ex Japan (NTR, USD), MSCI ACWI (NTR, USD), MSCI ACWI ex USA Index, MSCI Brazil Index, MSCI Emerging Markets Index (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Growth (USD, NTR), MSCI Emerging Markets Value (USD, NTR), MSCI Emerging Markets Asia Index, MSCI Emerging Markets EMEA Index, MSCI Emerging Markets Latin America Index, MSCI Hungary Index, MSCI

India Index, MSCI Israel, MSCI Malaysia Index, MSCI Taiwan (USD, NTR), MSCI New Zealand, MSCI Poland Index, MSCI South Africa Index, die MSCI World Sector Indizes (außer MSCI World Real Estate), den MSCI World Small Cap Index, den STOXX® USA 500 ESG-X Index und den STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Value Index, STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Size Index, STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Quality Index, STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Multi-Factor Index, STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Momentum Index, und den STOXX® USA 500 Industry Neutral Ax Low Risk Index, den STOXX® USA Titans 30 Index, den STOXX® US Nexus 100 Index und den STOXX® US 2000 Index

- USD 250 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den STOXX® USA 500 Index

[...]

#### 1.3.4 **Letzter Handelstag, Schlussabrechnungstag, Handelsschluss**

[...]

(3) Handelsschluss an dem letzten Handelstag

[...]

- der FTSE® EPRA Indizes ist 17:30 MEZ
- der Futures-Kontrakte auf den STOXX® USA Titans 30 Index, den STOXX® US Nexus 100 Index, den STOXX® US 2000 Index und den STOXX® USA 500 Index ist 15:30 Uhr MEZ.

#### 1.3.5 **Preisabstufungen**

##### 1.3.5.1 **Generelle Preisabstufungen für Index-Futures-Kontrakte**

Der Preis eines Index-Futures-Kontrakts wird in Punkten ermittelt. Die kleinste Preisveränderung (Tick) beträgt

- 0,01 Punkte bei
  - MSCI Italy, dies entspricht einem Wert von EUR 5
- 0,025 Punkte bei
  - STOXX® USA 500 Index, dies entspricht einem Wert von USD 6,25

- 0,05 Punkte bei

[...]

- STOXX® Europe 600 Banks (Produkt-ID: FSTB), dies entspricht einem Wert von EUR 2,50
- STOXX® USA Titans 30 Index, STOXX® US Nexus 100 Index und STOXX® US 2000 Index, dies entspricht einem Wert von USD 5.

[...]

### 1.3.5.2 Preisabstufungen bei Standardisierten Futures-Strategien

Abweichend zu Ziffer 1.3.5.1 beträgt die kleinste Preisveränderung (Tick) für Standardisierte Futures-Strategien im Sinne von Ziffer 2.2.1 der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland (z. B. Futures-Kalender-Spread):

- 0,005 Punkte bei

- STOXX® USA 500 Index, dies entspricht einem Wert von USD 1,25.

- 0,01 Punkte bei

- [...]

- MSCI Europe (Price, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR 1

- STOXX® USA Titans 30 Index, STOXX® US Nexus 100 Index und STOXX® US 2000 Index, dies entspricht einem Wert von USD 1.

- [...]

### 1.3.5.3 Preisabstufungen beim Off-Book-Handel

Abweichend zu Ziffer 1.3.5.1 und 1.3.5.2 beträgt die kleinste Preisveränderung (Tick) für den Off-Book-Handel im Sinne von Teilabschnitt 3.2:

- 0,001 Punkte bei allen MSCI Futures

- 0,005 Punkte bei Futures-Kontrakten auf den STOXX® USA 500 Index

- [...]

- 0,01 Punkte bei Standardisierten Futures-Strategien im Sinne von Ziffer 2.2.1 der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland (z. B. Futures-Kalender-Spread) für Euro STOXX 50® Futures (FESX)

- 0,01 Punkte bei Futures-Kontrakten auf den STOXX® USA Titans 30 Index, den STOXX® US Nexus 100 Index und den STOXX® US 2000 Index

- [...]

## Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

- [...]

### Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

- [...]

#### 3.2.1 Blockgeschäfte

- [...]

Produkt	Zusätzliche Kontraktvarianten J/N	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte	
		TES	Eurex EnLight und von QTPIP getätigte Eingaben *
[...]			
Aktienindex-Futures			
[...]			
Futures-Kontrakte auf die STOXX® USA 500 Industry Neutral Ax Value, Size, Quality, Multi-Factor, Momentum, Low Risk Indizes	J	50	
Futures-Kontrakte auf die <u>STOXX® USA 500, STOXX® USA Tradition 30, STOXX® US Nexus 100 und STOXX® US 2000 Indizes</u>	J	5	
[...]			

\* Als von QTPIP getätigte Eingaben gelten Eingaben gemäß Ziffer 4.6 (3) der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland. Für Eingaben von STPIP gemäß Ziffer 4.6 (2) der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland gelten die Bestimmungen für die Eingabe von TES Geschäften.

[...]

[...]

### 3.2.3 Exchange for Physicals for Index-Futures/FX-Futures („EFP-I“)

Folgende Kontrakte sind zugelassen:

[...]

- Futures-Kontrakte auf die STOXX® USA 500 Industry Neutral Ax Value, Size, Quality, Multi-Factor, Momentum, Low Risk Indizes
- Futures-Kontrakte auf die STOXX® USA 500, STOXX® USA Tradition 30, STOXX® US Nexus 100 und STOXX® US 2000 Indizes

[...]

[...]

\*\*\*\*\*

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 09.09.2024 in Kraft.

Frankfurt am Main, 05.09.2024

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Robbert Booij