

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

Index Total Return Futures: Einführung von delta-neutralen TAM-Geschäften in T7-Entry-Services

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 22.04.2024 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 UNTERSTRICHEN;

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

3.2.8 Delta Neutral Trade-at-Market-Geschäfte („Delta TAM“)

Delta TAM-Geschäfte bestehen aus einem Total-Return-Futures-Kontrakt, der in Verbindung mit einem Index-Futures-Kontrakt auf denselben zugrunde liegenden Referenzindex oder dasselbe zugrunde liegende Instrument gehandelt wird, so dass es sich um gegenläufige Geschäfte handelt. Die Total-Return-Futures-Kontrakte und die Index-Futures-Kontrakte werden paarweise zugelassen, so dass der Total-Return-Futures-Kontrakt nur mit dem entsprechenden Index-Futures-Kontrakt und mit dem jeweils geltenden Mindestordervolumen gehandelt werden kann.

Folgende Kontraktpaare sind zugelassen:

Produkte		Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte
Index-Total-Return-Futures („TRF“)	Index-Futures-Kontrakte	
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® 50 Index (TESX)	Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50® Index (FESX)	100
EURO STOXX® Banks Index (TESB)	Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® Banks Index (FESB)	100
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® Select Dividend 30 Index (TEDV)	Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® Select Dividend 30 Index (FEDV)	10
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den FTSE® 100 (TTUK)	Futures-Kontrakte auf den FTSE® 100 (FTUK)	50

Bei Eingabe eines Delta TAM-Geschäfts ist die Eingabe einer gültigen Kombination dazugehöriger Instrumente durch den an dem Geschäft beteiligten Börsenteilnehmer erforderlich und es gelten folgende Handelsmodalitäten:

- Die Anzahl in jedem Instrument der gehandelten Kontrakte darf die festgelegte Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte nicht unterschreiten
- TRF-Spread für den Index-Total-Return-Futures-Kontrakt
- Preis in Indexpunkten für den Index-Futures-Kontrakt
- Custom Index Level für den Index-Total-Return-Futures-Kontrakt
- Basis in Indexpunkten, wie in folgender Formel definiert:

Basis in Indexpunkten = Preis des Index-Futures-Kontrakts – Custom Index Level des Index-Total-Return-Futures-Kontrakts

[...]

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 22.04.2024 in Kraft.

Frankfurt am Main, 16.04.2024

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters