Eurex-Rundschreiben 018/19

MSCI Index-Derivate: Anpassung der Minimum Block Trade Sizes und Non-Disclosure Limits

Zusammenfassung

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland hat mit Wirkung zum **25. Februar 2019** folgende Beschlüsse in Bezug auf MSCI Index-Derivate gefasst:

- Anpassung der Minimum Block Trade Sizes („Mindestanzahl zu handelnder Kontrakte“) in MSCI-Futures und -Optionen;
- Anpassung der Non-Disclosure Limits („untertägige Nichtanzeige-Limite“) für MSCI-Futures

Die geänderten Minimum Block Trade Sizes entnehmen Sie bitte dem Anhang.

Die geänderten Non-Disclosure Limits finden Sie in diesem Rundschreiben. Weitere Informationen zu den Nichtanzeige-Limiten der T7 Entry Services sind der Eurex-Website www.eurexchange.com unter dem folgenden Link zu entnehmen (auf der englischsprachigen Version der Website):

Products > Product information > T7 Entry Service (TES) parameters

Anhang:

- Geänderte Abschnitte der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland

Datum: 14 Februar 2019

Empfänger:
Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland sowie Vendoren

Autorisiert von:
Michael Peters

Zielgruppe:
Alle Abteilungen

Kontakt:
Ralf Huesmann,
Equity & Index Product Design,
T +49-69-211-1 54 43,
ralf.huesmann@eurexchange.com

MSCI Index-Derivate: Anpassung der Minimum Block Trade Sizes und Non-Disclosure Limits

Änderungen in den Non-Disclosure Limits, gültig ab dem 25. Februar 2019:

Index name	Regional / Country / Factor	Markets*	Currency	Index Type**	Eurex Contract Codes	Non Disclosure (Fut) **old**	Non Disclosure (Fut) **new**
MSCI EAFE	Regional	DM	USD	Price	FMFP	1,000	2,000
MSCI EAFE	Regional	DM	USD	NTR	FMFA	2,000	3,000
MSCI EMU	Regional	DM	EUR	NTR	FMMU	5,000	7,500
MSCI EMU	Regional	DM	EUR	GTR	FMGM	2,500	5,000
MSCI EMU Value	Regional	DM	EUR	NTR	FMIV	1,000	5,000
MSCI Europe	Regional	DM	EUR	NTR	FMEU	5,000	7,500
MSCI Europe	Regional	DM	EUR	Price	FMEP	5,000	7,500
MSCI Europe	Regional	DM	USD	NTR	FMED	1,500	2,500
MSCI Europe	Regional	DM	EUR	GTR	FMGE	2,500	5,000
MSCI North America	Regional	DM	USD	NTR	FMNA	1,000	2,000
MSCI World	Regional	DM	USD	Price	FMWP	2,000	5,000
MSCI World	Regional	DM	EUR	NTR	FMWN	5,000	7,500
MSCI World	Regional	DM	EUR	GTR	FMWE	2,500	3,000
MSCI World Growth	Regional	DM	USD	NTR	FMOG	1,000	2,000
MSCI World Value	Regional	DM	USD	NTR	FMOV	500	1,000
MSCI Australia	Country	DM	USD	NTR	FMAU	1,000	2,000
MSCI Canada	Country	DM	USD	GTR	FMGC	1,000	2,000
MSCI UK	Country	DM	USD	NTR	FMDK	1,000	2,000
MSCI USA	Country	DM	USD	NTR	FMUS	1,000	2,000
MSCI USA	Country	DM	USD	GTR	FMGS	500	1,500
MSCI Emerging Markets	Regional	EM	USD	NTR	FMEM	2,000	2,500
MSCI Emerging Markets	Regional	EM	EUR	NTR	FMEN	5,000	3,000
MSCI Emerging Markets Growth	Regional	EM	USD	NTR	FMMG	1,000	2,000
MSCI Emerging Markets Value	Regional	EM	USD	NTR	FMMV	1,000	2,000
MSCI Emerging Markets Asia	Regional	EM	USD	NTR	FMEA	2,000	2,500
MSCI Emerging Markets Asia ex Kore	Regional	EM	USD	NTR	FMXK	2,000	3,000
MSCI Emerging Markets EMEA	Regional	EM	USD	NTR	FMEE	2,000	2,500
MSCI Emerging Markets Latin Am.	Regional	EM	USD	NTR	FMEL	1,000	1,500
MSCI China Free	Country	EM	USD	NTR	FMCN	1,000	2,000
MSCI Indonesia	Country	EM	USD	NTR	FMID	1,000	2,000
MSCI Mexico	Country	EM	USD	NTR	FMMX	1,000	2,000

* DM = Developed Markets / EM = Emerging Markets / FM = Frontier Markets

** NTR = Net Total Return / GTR = Gross Total Return / Price = Price Return

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Ralf Huesmann, Equity & Index Product Design, Tel. +49-69-211-1 54 43, E-Mail: ralf.huesmann@eurexchange.com.

14. Februar 2019

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[…]

Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

Folgende an der Eurex Deutschland zugelassene Futures- und Optionskontrakte können mittels des Eurex-T7-Entry-Service in den nachfolgend genannten Geschäftsarten eingegeben werden.

3.2.1 Blockgeschäfte

[…]

Produkt		**Mindest-anzahl der zu handelnden Kontrakte**
Standard	**Zusätzliche Kontrakt-varianten J/N**	
Aktienindexoptionen		
[…]		
Optionskontrakte auf den MSCI EAFE Index (Price, USD) (OMFP)	J	~~1~~100
Optionskontrakte auf den MSCI Emerging Markets Index (NTR, USD) (OMEM)	J	~~50~~100
Optionskontrakte auf den MSCI Emerging Markets Index (Price, USD) (OMEF)	J	~~1~~100
Optionskontrakte auf den MSCI World Index (Price, USD) (OMWP)	J	~~10~~150
[…]		
Aktienindex-Futures		
[…]		
Futures-Kontrakte auf den MSCI EAFE Index (NTR, USD) (FMFA)	J	~~1~~10

Produkt		**Mindest-anzahl der zu handelnden Kontrakte**
Standard	**Zusätzliche Kontrakt-varianten J/N**	
Futures-Kontrakte auf den MSCI EAFE Index (Price, USD) (FMFP)	J	~~1~~10
Futures-Kontrakte auf den MSCI ACWI Index (NTR, USD) (FMAC)	J	~~10~~50
Futures-Kontrakte auf den MSCI Australia Index (FMAU)	J	~~1~~10
Futures-Kontrakte auf den MSCI Canada (GTR, USD) (FMGC)	J	~~1~~5
Futures-Kontrakte auf den MSCI China Free Index (FMCN)	J	~~1~~20
Futures-Kontrakte auf den MSCI Emerging Markets Index (NTR, EUR) (FMEN)	J	~~50~~20
Futures-Kontrakte auf den MSCI Emerging Markets Index (Price, USD) (FMEF)	J	~~1~~20
Futures-Kontrakte auf den MSCI EMU Index (NTR, EUR) (FMMU)	J	~~10~~25
Futures-Kontrakte auf den MSCI Europe Index (Price, EUR) (FMEP)	J	~~10~~100
Futures-Kontrakte auf den MSCI Hong Kong Index (FMHK)	J	~~1~~5
Futures-Kontrakte auf den MSCI India Index (FMIN)	J	~~1~~5
Futures-Kontrakte auf den MSCI North America (NTR, USD) (FMNA)	J	~~1~~10
Futures-Kontrakte auf den MSCI South Africa Index (FMZA)	J	~~1~~5
Futures-Kontrakte auf den MSCI Taiwan Index (USD, NTR) (FMTW)	J	~~1~~5
Futures-Kontrakte auf den MSCI United Kingdom (NTR, USD) (FMDK)	J	~~1~~5
Futures-Kontrakte auf den MSCI USA Index (NTR, USD) (FMUS)	J	~~1~~10
Futures-Kontrakte auf den MSCI World Index (NTR, EUR) (FMWN)	J	~~50~~100
Futures-Kontrakte auf den MSCI World Index (Price, USD) (FMWP)	J	~~10~~25
[…]		

Die Kontraktanzahl der gehandelten Futures- bzw. Optionskontrakte einschließlich deren zusätzliche Kontraktvarianten darf die festgelegte Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte nicht unterschreiten. Soweit mittels des Service für Futures Kalenderspreads, Standard Options-Strategien, Nicht-standard Options-Strategien oder Options-Volatilitätsstrategien Kontrakte eingegeben werden, die für den Block-Trade-Service zugelassen sind, gilt vorstehende Regelung entsprechend.

[…]

****