

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

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

[...]

### **Teilabschnitt 1.26 Kontraktsspezifikationen für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte**

Der folgende Teilabschnitt enthält die Kontraktgestaltung für Total-Return-Futures-Kontrakte auf bestimmte Aktien („Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte“).

#### **1.26.1 Kontraktgegenstand**

- (1) Ein Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt ist ein Total-Return-Futures-Kontrakt auf eine bestimmte Aktie.
- (2) An der Eurex Deutschland stehen die in Annex G aufgeführten Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte in den jeweils angegebenen Währungen zur Verfügung.

#### **1.26.2 Verpflichtung zur Erfüllung**

Nach Handelsschluss in dem Kontrakt ist der Verkäufer eines Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakts dazu verpflichtet, die Differenz zwischen dem vereinbarten Preis und dem höheren Schlussabrechnungspreis (Kapitel II Abschnitt 2 Ziffer 2.25.3 der Clearing Conditions der Eurex Clearing AG) in bar auszugleichen. Der Käufer ist verpflichtet, die Differenz zwischen dem vereinbarten Preis und dem niedrigeren Schlussabrechnungspreis in bar auszugleichen.

#### **1.26.3 Laufzeit**

Für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte stehen an der Eurex Deutschland Laufzeiten von bis zu 24 Monaten bis zu den Schlussabrechnungstagen (Ziffer 1.26.4 Absatz 4) des nächsten, übernächsten und drittnächsten Monats, den drei darauffolgenden Quartalsmonaten (März, Juni, September, Dezember) und zwei darauffolgenden Halbjahresverfalltagen (Juni und Dezember) für den Handel zur Verfügung.

#### **1.26.4 Letzter Handelstag, Schlussabrechnungstag, Handelsschluss**

- (1) Der letzte Handelstag der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte ist grundsätzlich der Schlussabrechnungstag, sofern dieser Tag ein Handelstag an der Eurex Deutschland ist, andernfalls der diesem Tag unmittelbar vorausgehende Handelstag.
- (2) Der Schlussabrechnungstag der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte ist grundsätzlich der dritte Freitag eines jeweiligen Verfallmonats, sofern dieser Tag ein Handelstag an der Eurex Deutschland ist, andernfalls der diesem Tag unmittelbar vorausgehende Handelstag.
- (3) Bei Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten ist Handelsschluss am letzten Handelstag um 17:30 Uhr MEZ.

#### **1.26.5 Erfüllung, Barausgleich**

- (1) Erfüllungstag für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte ist der Geschäftstag nach dem Schlussabrechnungstag des Kontrakts.
- (2) Die Erfüllung der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte erfolgt durch Barausgleich zwischen den Clearing-Mitgliedern und der Eurex Clearing AG. Der Barausgleich an Kunden (einschließlich Börsenteilnehmer, die nicht selbst zum Clearing berechtigt sind) ist Aufgabe des zuständigen Clearing-Mitglieds; derjenige von Börsenteilnehmern, die nicht selbst zum Clearing berechtigt sind, an deren Kunden ist sodann Aufgabe dieser Börsenteilnehmer.

#### **1.26.6 Handelskonventionen**

##### **1.26.6.1 Börsenhandel**

Der Handel in Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten findet in Total Return Futures-Spreads („TRF-Spread“) statt. Der TRF-Spread ist ein in Basispunkten ausgedrückter annualisierter Zinssatz, der den Spread (positiv oder negativ) gegenüber der Funding Rate (wie in Ziffer 1.26.6.3 definiert) darstellt. Die Geschäftsausführung erfolgt in TRF-Spreads und sämtliche nachfolgende Berechnungen werden durch die Eurex Deutschland durchgeführt.

Nach einer Geschäftsausführung wird der gehandelte TRF-Spread in Verbindung mit dem anwendbaren Stand des Basiswerts und der bis zur Fälligkeit verbleibenden Zeit verwendet, um eine gehandelte Basis zu berechnen.

Die gehandelte Basis wird in Verbindung mit den Accrued Distributions und dem Accrued Funding verwendet, um den Gehandelten Futures-Preis zu berechnen.

Die Berechnung der gehandelten Basis erfolgt gemäß Ziffer 1.26.8.1, die der Accrued Distribution und des Accrued Funding gemäß Ziffer 1.26.8.2 und die des Gehandelten Futures-Preises gemäß Ziffer 1.26.8.3.

### **1.26.6.2 TRF-Spread-Abstufungen**

Der TRF-Spread der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte wird in Basispunkten quotiert. Die kleinstmögliche Veränderung des TRF-Spreads ist 0,5 Basispunkte.

### **1.26.6.3 Funding Rate**

Die auf Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte anwendbare Funding Rate ist der Benchmark-Zinssatz für Overnight-Geschäfte, über die der TRF-Spread ermittelt und gehandelt wird („Funding Rate“).

- Die Funding Rate für auf EUR lautende Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte ist die von der Europäischen Zentralbank (EZB) bereitgestellte Euro Short-Term Rate (€STR) (als prozentualer Wert).

### **1.26.6.4 Zinsberechnungsmethode**

In die Berechnung der gehandelten Basis der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte fließt die Zeit bis zur Fälligkeit ein. Zur Berechnung der Zeit bis zur Fälligkeit wird die folgende Zinsberechnungsmethode angewendet:

- Die Zinsberechnungsmethode für auf EUR lautende Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte ist Actual/360 (Act/360), d. h. die tatsächliche Anzahl der Tage in dem für die Berechnung herangezogenen Zeitraum wird durch den Annualisierungsfaktor 360 („Annualisierungsfaktor“) geteilt.

### **1.26.6.5 Tage bis zur Fälligkeit, Funding Days**

In die Berechnung der Zeit bis zur Fälligkeit der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte fließen die Tage bis zur Fälligkeit ein (unter Berücksichtigung von Ziffer 1.26.6.4). Diese werden wie folgt berechnet:

- $Tage\ bis\ zur\ Fälligkeit(t) = [Verfallsdatum + x\ Abrechnungstage] - [t + x\ Abrechnungstage]$

Dabei gilt:

$t = \text{aktueller Handelstag}$

Für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte fließt außerdem die Anzahl der Funding Days in die Berechnung ein. Bezüglich der Berechnung der Funding Days findet Folgendes Anwendung:

- $Funding\ Days(t) = [t + x\ Abrechnungstage] - [(t-1) + x\ Abrechnungstage]$

Dabei gilt:

$t = \text{aktueller Handelstag}$

$t-1 = \text{der dem aktuellen Handelstag unmittelbar vorausgehende Handelstag}$

Abrechnungstag für auf EUR lautende Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte ist jeder Tag, an dem das TARGET2-System (Trans-European Automated Real-Time Gross Settlement Express Transfer System) für die Zahlungsabwicklung in Euro in offen ist.

x Abrechnungstage = 2 Abrechnungstage

### **1.26.7 Handelsmodalitäten**

Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte werden in zwei Modalitäten gehandelt:

- Trade at Close (TAC), wobei die berechnete gehandelte Basis auf dem Basiswertschlusskurs basiert,
- Trade at Market (TAM), wobei die berechnete gehandelte Basis auf einem vom Börsenteilnehmer im Vorfeld festgelegten und von ihm eingegebenen Stand des Basiswerts („Custom Underlying Level“) basiert.

Die als TAC- und TAM-Trades ausgeführten Geschäfte sind vollkommen fungibel und dieselbe Produktkennung wird unabhängig von der verwendeten Handelsmodalität (TAC und TAM) verwendet.

- Für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte ist der Trade at Close (TAC) im fortlaufenden Handel verfügbar.
- Für über den Eurex-Trade-Entry-Service eingestellte Trades sind Trade at Close (TAC) und Trade at Market (TAM) nur für Basket Transaktionen gemäß nachstehender Ziffer 1.26.12 verfügbar.

### **1.26.8 Umrechnungsparameter und -preise**

#### **1.26.8.1 Gehandelte Basis**

Der in Basispunkten ausgedrückte gehandelte TRF-Spread wird nach den folgenden Formeln in die gehandelte Basis („gehandelte Basis“) umgerechnet:

- Trade at Close (TAC):

$$\text{Gehandelte Basis}(t) = \text{Basiswertschlusskurs}(t) * [\text{gehandelter TRF-Spread}(t) * 0.0001] * (\text{Tage bis zur Fälligkeit}(t) / \text{Annualisierungsfaktor})$$

Dabei gilt:

$$t = \text{aktueller Handelstag}$$

$$\text{Basiswertschlusskurs}(t) = \text{offizieller Schlusskurs der zugrundeliegenden Aktie am in Annex G aufgeführten primären Kassamarkt.}$$

- Trade at Market (TAM):

$$\text{Gehandelte Basis}(t) = \text{Custom Underlying}(t) * [\text{gehandelter TRF-Spread}(t) / *0.0001] * (\text{Tage bis zur Fälligkeit}(t) / \text{Annualisierungsfaktor})$$

Dabei gilt:

$t = \text{aktueller Handelstag}$

$Custom\ Underlying(t) = \text{der vom Börsenteilnehmer vorab festgelegte und von ihm eingeebene Kurs der zugrundeliegenden Aktie.}$

### **1.26.8.2 Distributions und Funding**

Der gehandelte Futures-Preis wird unter Verwendung der gehandelten Basis sowie der Accrued Distributions und des Accrued Funding berechnet. Die Accrued Distributions werden täglich berechnet und stellen die seit Auflegung des betreffenden Equity Distribution Index durch STOXX Ltd. (wie in Annex G aufgeführt) aufgelaufenen Gesamtbeträge dar und das Accrued Funding wird täglich berechnet und spiegelt die Gesamtbeträge seit Produkteinführung (d. h. seit Einführung der jeweiligen in Annex G aufgeführten Aktien-Total-Return-Futures) wider.

#### **1.26.8.2.1 Accrued Distributions**

Die Accrued Distributions für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte werden gemäß der folgenden Formel berechnet:

$Accrued\ Distributions(t) = Accrued\ Distributions(t-1) + Daily\ Distributions(t)$

Dabei gilt:

$t = \text{aktueller Handelstag}$

$t-1 = \text{der dem aktuellen Handelstag unmittelbar vorausgehende Handelstag}$

Daily Distributions werden je Produkt aus der Differenz zwischen dem Wert des Distribution Indexes des aktuellen Handelstags und dem Wert des Distribution Indexes des vorhergehenden Handelstags gemäß der folgenden Formel berechnet:

$Daily\ Distributions(t) = Distribution\ Index(t) - Distribution\ Index(t-1)$

Dabei gilt:

$t = \text{aktueller Handelstag}$

$t-1 = \text{der dem aktuellen Handelstag unmittelbar vorausgehende Handelstag}$

Distribution Index(t) = von der Stoxx Ltd berechneter täglicher Wert des maßgeblichen Dividendenindex für die entsprechende zugrundeliegende Aktie in Bezug auf den aktuellen Handelstag (t).

#### **1.26.8.2.2 Accrued Funding**

Der Wert des Accrued Fundings für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte wird gemäß der folgenden Formel berechnet:

$Accrued\ Funding(t) = Accrued\ Funding(t-1) + Daily\ Funding(t)$

Dabei gilt:

$t = \text{aktueller Handelstag}$

$t-1 = \text{der dem aktuellen Handelstag unmittelbar vorausgehende Handelstag}$

Das Daily Funding wird je Produkt für den aktuellen Handelstag (t) gemäß der folgenden Formel berechnet:

$$\text{Daily Funding}(t) = \text{Basiswertschlusskurs}(t-1) * \text{Funding Rate}(t-1) * \frac{\text{Funding Rate}(t)}{\text{Annualisierungsfaktor}}$$

Dabei gilt:

$t = \text{aktueller Handelstag}$

$t-1 = \text{der dem aktuellen Handelstag unmittelbar vorausgehende Handelstag}$

Es ist zu beachten, dass sich Funding Rate(t-1) auf die Funding Rate bezieht, die an dem dem aktuellen Handelstag unmittelbar vorausgehenden Handelstag gilt, ungeachtet dessen, dass diese gegebenenfalls am Folgetag vor Handelsbeginn veröffentlicht wird.

### **1.26.8.3 Gehandelter Futures-Preis**

Für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte wird die gehandelte Basis in Verbindung mit den Accrued Distributions und der Accrued Funding gemäß den folgenden Formeln in den gehandelten Futures-Preis umgerechnet:

#### ■ Trade at Close (TAC)

$$\text{Gehandelter Futures-Preis}(t) = \text{Basiswertschlusskurs}(t) + \text{Accrued Distributions}(t) - \text{Accrued Funding}(t) + \text{gehandelte Basis}(t)$$

#### ■ Trade at Market (TAM)

$$\text{Gehandelter Futures-Preis}(t) = \text{Custom Underlying}(t) + \text{Accrued Distributions}(t) - \text{Accrued Funding}(t) + \text{gehandelte Basis}(t)$$

Dabei gilt:

$t = \text{aktueller Handelstag}$

### **1.26.8.4 Täglicher Abrechnungspreis**

Der tägliche Abrechnungspreis für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte wird unter Verwendung der in vorstehender Ziffer 1.26.8.1 und Ziffer 1.26.8.3 für Trade at Close (TAC) beschriebenen Methodologie berechnet. Anstelle des gehandelten TRF-Spreads wird ein Täglicher-Abrechnungs-TRF-Spread ermittelt und zusammen mit dem anwendbaren Stand des Basiswerts und der Zeit bis zur Fälligkeit zur Berechnung einer Abrechnungsbasis (wie in Kapitel II Abschnitt 2 Ziffer 2.25.2 der Clearing Conditions der Eurex Clearing AG definiert) verwendet. Die Abrechnungsbasis wird in Verbindung mit den Accrued Distributions und dem Accrued Funding zur Berechnung des täglichen Abrechnungspreises verwendet.

### **1.26.8.5 Schlussabrechnungspreis**

Der Schlussabrechnungspreis für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte wird unter Verwendung der in vorstehender Ziffer 1.26.8.3 für Trade at Close (TAC) beschriebenen Methodologie und nach folgender Maßgabe berechnet: (i) Zum Zeitpunkt der Schlussabrechnung hat die gehandelte Basis den Wert null, da die Anzahl der Tage bis zur Fälligkeit am Verfallsdatum null beträgt, und (ii) der Basiswertschlusskurs wird durch den Schlussabrechnungsbasiswert ersetzt.

Der Schlussabrechnungsbasiswert von Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten ist der offizielle Schlusskurs der Aktie am Schlussabrechnungstag am in Annex G aufgeführten maßgeblichen primären Kassamarkt, sofern der betreffende Tag ein Handelstag am maßgeblichen primären Kassamarkt ist; anderenfalls ist der Schlussabrechnungsbasiswert der offizielle Schlusskurs am dem betreffenden Tag unmittelbar vorausgehenden Handelstag am maßgeblichen primären Kassamarkt.

### **1.26.9 Marktstörung**

#### **1.26.9.1 Eintritt einer Marktstörung**

- (1) Bei Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten liegt eine Marktstörung u. a. vor, wenn mindestens eines der folgenden Ereignisse an einem Börsentag eintritt oder dessen Auswirkungen anhalten: (i) Störung der Lieferung eines bestimmten Basiswerts bzw. einer bestimmten Funding Rate seitens des jeweiligen Anbieters („Lieferstörung“) oder (ii) Störung des Börsenhandels in gelisteten Derivaten auf einen bestimmten Index („Störung des Börsenhandels in gelisteten Derivaten“).
- (2) Bei Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten wird der Eintritt einer Marktstörung in Form einer Lieferstörung insbesondere in folgenden Fällen angenommen:
  - (a) die EZB berechnet und veröffentlicht vor Handelsbeginn keinen Stand der Euro Short-Term Rate (€STR) für den vorausgehenden Abrechnungstag bzw. ändert einen entsprechenden Stand der Euro Short-Term Rate (€STR) nachträglich und veröffentlicht ihn nach Handelsbeginn erneut;
  - (b) STOXX Ltd. veröffentlicht vor Handelsbeginn keinen effektiven Stand des Dividendenindex;
  - (c) STOXX Ltd. veröffentlicht den effektiven Stand des Dividendenindex vor Handelsbeginn, ändert ihn jedoch nachträglich und veröffentlicht ihn nach Handelsbeginn erneut;
  - (d) der offizielle Schlusskurs der Aktie am in Annex G aufgeführten maßgeblichen primären Kassamarkt wird nicht veröffentlicht, obwohl der betreffende Tag ein Handelstag an diesem maßgeblichen primären Kassamarkt ist;
  - (e) der offizielle Schlusskurs der Aktie am in Annex G aufgeführten maßgeblichen primären Kassamarkt wird veröffentlicht, wird jedoch nachträglich geändert und erneut veröffentlicht.

- (3) Bei Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten wird der Eintritt einer Marktstörung in Form einer Störung des Börsenhandels in gelisteten Derivaten insbesondere in folgenden Fällen angenommen:
- (a) Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte sind während der gesamten oder eines Teils der vorgesehenen Handelszeit an einem Handelstag nicht für den Handel geöffnet;
- (b) Die Eurex Deutschland ist an einem vorgesehenen Börsentag im Zeitraum zwischen 16:30 und 17:30 MEZ nicht für den Handel geöffnet;
- (4) Unbeschadet der Absätze 1 – 3 dieser Ziffer kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland entscheiden, ob eine ordnungsgemäße Preis- oder Spreadermittlung nicht gewährleistet ist und eine Marktstörung vorliegt.

#### **1.26.9.2 Berechnung von Input-Parametern einer Marktstörung**

- (1) Störungen der für die Preisberechnung notwendigen Parameter können – wie in Ziffer 1.22.9.1 dargelegt – zu einer Marktstörung führen. Die folgende Methodologie für die Berechnung der Input-Parameter findet dabei Anwendung:

Für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte werden zur Berechnung des gehandelten Futures-Preises für Trade at Close (TAC) und des täglichen Abrechnungspreises am Handelstag(t) die folgenden Input-Parameter benötigt:

■ Vor Handelsbeginn

Distribution Index(t) und Funding Rate (t-1)

■ Ende des Tages

Basiswertschlusskurs(t) und Täglicher-Abrechnungs-TRF-Spread (t)

- (2) Unter den in Absatz 1 dieses Abschnitts aufgeführten Kriterien für die Berechnung einer Marktstörung für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte ist insbesondere Folgendes zu verstehen:

a) Distribution Index(t)

Falls der Indexanbieter den effektiven Distribution Index nicht vor Handelsbeginn veröffentlicht, kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland den Handelsbeginn für diesen Kontrakt nach eigenem Ermessen verzögern, bis entweder der Indexanbieter den Distribution Index zur Verfügung stellt oder die Eurex Deutschland den Wert des Distribution Indexes selbst ermittelt.

Falls der Indexanbieter vor Handelsbeginn den effektiven Distribution Index veröffentlicht, ihn jedoch nach Handelsbeginn und vor Ende der Post-Trade-Periode nachträglich ändert und erneut veröffentlicht, wird der berichtigte Distribution Index verwendet. Darüber hinaus wird der berichtigte Distribution Index dazu verwendet, die auf betroffene Trades anwendbare Differenz



gegenüber deren ursprünglich berechnetem gehandeltem Futures-Preis zu berechnen sowie die auf dem berichtigten Distribution Index basierende entsprechende Anpassung zu ermitteln. Diese Anpassungen werden am nächsten Handelstag angewandt.

b) Funding Rate (t-1)

Falls der Anbieter des Benchmark-Zinssatzes für Overnight-Geschäfte vor Handelsbeginn keine Overnight-Funding Rate berechnet und veröffentlicht oder falls er diese nachträglich ändert und erneut veröffentlicht, wird die letzte vor Handelsbeginn zur Verfügung stehende Overnight-Funding Rate verwendet.

c) Basiswertschlusskurs (t)

- Für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, bei denen der Basiswertschlusskurs der offizielle Schlusskurs der zugrundeliegenden Aktie ist, gilt:

Falls der in Annex G aufgeführte primäre Kassamarkt zum erwarteten Zeitpunkt keinen offiziellen Schlusskurs veröffentlicht, kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland die Eingabe eines Basiswertschlusskurses für diesen Kontrakt nach ihrem eigenen Ermessen bis zum Ende der Post-Trade-Periode verzögern, bis entweder der primäre Kassamarkt den offiziellen Schlusskurs veröffentlicht oder die Geschäftsführung der Eurex Deutschland den Kurs des Basiswerts nach ihrem eigenem Ermessen ermittelt.

Falls am Ende der Post-Trade-Periode kein offizieller Schlusskurs zur Verfügung steht, wird der letzte verfügbare Kurs der Aktie als Basiswertschlusskurs verwendet.

Falls der in Annex G aufgeführte primäre Kassamarkt einen offiziellen Schlusskurs veröffentlicht, ihn jedoch vor Ende der Post-Trade-Periode nachträglich ändert und erneut veröffentlicht, wird dieser berichtigte offizielle Schlusskurs als Basiswertschlusskurs verwendet. Darüber hinaus wird der berichtigte offizielle Schlusskurs dazu verwendet, die auf betroffene Trades anwendbare Differenz gegenüber deren ursprünglich berechnetem gehandeltem Futures-Preis zu berechnen sowie die auf dem berichtigten Basiswertschlusskurs basierende entsprechende Anpassung zu ermitteln. Diese Anpassungen werden am nächsten Handelstag angewandt.

d) Täglicher-Abrechnungs-TRF-Spread (t)

Falls die Aktien-Total-Return-Futures während eines gesamten Tages oder für einen Teil des Tages nicht für den Handel an der Eurex Deutschland geöffnet sind, kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland den Täglichen-Abrechnungs-TRF-Spread nach eigenem Ermessen ermitteln, basierend entweder auf dem vorherigen Täglichen-Abrechnungs-TRF-Spread oder auf dem letzten auf Basis der zur Verfügung stehenden Marktdaten ermittelten Spread oder auf einem von der Geschäftsführung der Eurex Deutschland zur Abbildung des Fair Value ermittelten Niveau.

### **1.26.10 Ausschüttungskorrektur**

(1) Bei Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten, die einen Distribution Index zur Ermittlung der Accrued Distributions verwenden, werden Ausschüttungen, z. B. Dividenden, an ihrem jeweiligen Ex-Tag in die Berechnung des Distribution Indexes miteinbezogen. Falls in Bezug auf die in den Distribution Index miteinbezogene festgesetzte Ausschüttung:

(a) der tatsächliche Betrag, der von der Eurex Deutschland als gezahlt oder als noch zu zahlen ermittelt wird, von der festgesetzten Ausschüttung abweicht,

(b) die Eurex Deutschland feststellt, dass keine Zahlung erfolgt ist oder noch erfolgen wird,

(c) eine festgesetzte Ausschüttung den obigen Punkten a) oder b) unterliegt, aber nachfolgend von der Eurex Deutschland festgestellt wird, dass der tatsächliche Betrag gezahlt werden wird oder gezahlt wurde,

bestimmt die Geschäftsführung der Eurex Deutschland, ob der gezahlte tatsächliche Betrag von der festgesetzten Ausschüttung abweicht und eine Ausschüttungskorrektur vorliegt. Eine festgesetzte Ausschüttung kann einer oder mehreren Ausschüttungskorrekturen unterliegen.

(2) Im Falle einer Ausschüttungskorrektur kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland nach eigenem Ermessen eine angemessene Anpassung vornehmen. Diese Anpassung basiert auf:

(a) den am Ende des dem Ex-Tag der festgesetzten Ausschüttung unmittelbar vorausgehenden Handelstages offenen Positionen,

(b) der Wertdifferenz zwischen der festgesetzten Ausschüttung und dem von der Eurex Deutschland als gezahlt oder als noch zu zahlen ermittelten tatsächlichen Betrag,

(c) dem Wert von allen zuvor vorgenommenen Anpassungen aufgrund einer Ausschüttungskorrektur,

(d) der Behandlung von Ausschüttungskorrekturen seitens des Indexanbieters des Distribution Indexes.

In dem Fall, dass die festgesetzte Ausschüttung höher ist als der von der Eurex Deutschland als gezahlt oder zu zahlen erachtete tatsächliche Betrag und dass keine vorherige Anpassung vorgenommen wurde, wird der Anpassungsbetrag den Haltern der offenen Kaufpositionen, wie sie bei Geschäftsschluss des dem Absatz 1 lit. a) dieses Abschnitts unterliegenden Ex-Tag der Ausschüttung vorhergehenden Börsentages vorliegen, belastet und den Haltern der offenen Verkaufspositionen gutgeschrieben. Diese Anpassungen werden an dem nächsten nach dem Eintritt einer Marktstörung und der Berechnung der jeweiligen Anpassung folgenden Handelstag ausgeführt.

Wurde eine vorherige Anpassung vorgenommen, bestimmt die Geschäftsführung der Eurex Deutschland die Anwendung aller ggf. vorzunehmender nachfolgender Anpassungen gegenüber Haltern offener Positionen, wie sie bei Geschäftsschluss des dem Absatz 1 lit. a) dieses Abschnitts unterliegenden Ex-Tag der Ausschüttung vorhergehenden Börsentages vorliegen.

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland legt das Datum, an dem eine solche Änderung vorgenommen werden soll, fest. Insbesondere kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland nach ihrem eigenen Ermessen Ausschüttungskorrekturen bis einschließlich 100 Tage nach dem Verfallsdatum des Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakts vornehmen.

#### **1.26.11 Anpassungen der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte aufgrund von Kapitalmaßnahmen**

- (1) Im Fall von Dividenden- oder weiteren Ausschüttungen erfolgt keine Anpassung der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte.

Als Dividenden gelten auch Kapitalherabsetzungen durch Herabsetzung des Nennbetrages der Aktien, falls von einer Gesellschaft der Betrag der Herabsetzung des Nennwertes anstelle einer Dividende ausbezahlt wird bzw. falls dieser Betrag Bestandteil der regulären Ausschüttung ist, sowie garantierte Barabgeltungen von Bezugsrechten und anderen vergleichbaren Werten, die anstelle einer Dividende angeboten werden. Als Dividenden im Sinne dieses Absatzes gelten auch weitere Ausschüttungen, insbesondere außergewöhnlich hohe Dividenden, Boni- oder sonstige Barausschüttungen, sowie Dividenden, die nicht im Rahmen der regulären Dividendenpolitik ausgeschüttet werden bzw. von der Gesellschaft als nicht reguläre Dividende deklariert werden (bspw. Spezialdividenden, Jubiläumsboni).

- (2) Werden Bezugsrechte gewährt, so findet eine Anpassung des Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakts gemäß Absatz 8 statt.

- (3) Bei Kapitalerhöhungen aus Gesellschaftsmitteln erhöht sich die Zahl der dem Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt zugrundeliegenden Aktien entsprechend dem Verhältnis ihres Anteils am bisherigen Grundkapital des die Aktien emittierenden Unternehmens. Gleichzeitig werden die Abrechnungspreise so angepasst, dass der ursprüngliche Kontraktwert erhalten bleibt.

Bei Kapitalherabsetzungen bleiben die Kontraktgröße sowie die Abrechnungspreise des Futures-Kontraktes unverändert, wenn die Kapitalherabsetzung durch Herabsetzung des Nennbetrags der Aktien erfolgt. Bei einer Kapitalherabsetzung durch Einziehung von Aktien oder durch Zusammenlegung verringert sich die Zahl der dem Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt zugrundeliegenden Aktien entsprechend dem Herabsetzungsverhältnis. Gleichzeitig werden die Abrechnungspreise so angepasst, dass der ursprüngliche Kontraktwert erhalten bleibt.

- (4) Bei Aktien-Splits der dem Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt zugrundeliegenden Aktien erhöht sich die Kontraktgröße entsprechend dem Verhältnis des Aktien-Splits.

Gleichzeitig werden die Abrechnungspreise so angepasst, dass der ursprüngliche Kontraktwert erhalten bleibt.

- (5) Bei Kapitalveränderungen (Absatz 3 bis 4) sowie bei Anpassungen gemäß Absatz 2 werden alle im Auftragsbuch vorhandenen Aufträge und Quotes in dem betroffenen Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt von der Eurex Deutschland gelöscht. Die Eurex Deutschland benachrichtigt alle Börsenteilnehmer von einer bevorstehenden Löschung.
- (6) Erfolgt ein öffentliches Angebot zum Erwerb der dem Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt zugrundeliegenden Aktie, wird der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt nach Maßgabe von Absatz 8 angepasst oder abgerechnet, wenn der Bieter über 50 Prozent der dem Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt zugrundeliegenden Aktien oder über 50 Prozent der Stimmrechte an der Emittentin (Zielgesellschaft) der dem Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt zugrundeliegenden Aktie hält oder ihm diese zuzurechnen sind. Der maßgebliche Zeitpunkt für das Vorliegen der Voraussetzungen nach Satz 1 ist das Ende der ersten Angebotsfrist. Bei einer Verlängerung der ersten Angebotsfrist kann die Geschäftsführung auch auf den Zeitpunkt des Endes dieser verlängerten Frist abstellen. Bei Teilangeboten gemäß § 19 WpÜG findet Satz 1 keine Anwendung. Bei Angeboten, die ausländischen Rechtsvorschriften unterliegen, kann die Geschäftsführung von Satz 1-4 abweichende Regelungen treffen.

Bei der Bestimmung des Vorliegens der Voraussetzungen nach Satz 1 berücksichtigt die Eurex Deutschland Veröffentlichungen des Bieters, der Zielgesellschaft oder Behörden sowie vergleichbarer Einrichtungen.

Die Eurex Deutschland veröffentlicht den Zeitpunkt der Wirksamkeit der Anpassung oder Abrechnung. Steht den Aktionären bei einem öffentlichen Angebot die Gegenleistung nicht unmittelbar nach Bekanntgabe der Ergebnisse durch den Bieter zur Verfügung, kann die Eurex Deutschland bestimmen, dass sich die Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte bis zum Zeitpunkt der Zahlung der Gegenleistung oder des Umtauschs der Aktien auf die zum Verkauf oder Umtausch eingereichten Aktien beziehen und auf deren Basis abgerechnet werden. Im Falle der physischen Lieferung sind die Kontrakte entsprechend ausschließlich entweder mit den zum Verkauf oder den zum Umtausch eingereichten Aktien zu beliefern.

Die Anpassung setzt weiter voraus, dass Derivate auf die als Gegenleistung angebotene Aktie gehandelt werden können und ein Handel in der als Gegenleistung angebotene Aktie an einer von der Eurex Deutschland bestimmten Börse möglich ist. Besteht die Gegenleistung in Aktien und in einer Geldleistung, ist die Anpassung ausgeschlossen, wenn der Geldleistungsanteil mehr als 67 Prozent der Gesamtgegenleistung beträgt.

- (7) Wird eine Kapitalmaßnahme im Sinne der vorstehenden Bestimmungen durchgeführt, aber von den vorstehenden Bestimmungen nicht geregelt oder erfasst, wird die Geschäftsführung der Eurex Deutschland die hiervon betroffenen Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte mit dem Ziel anpassen, den ursprünglichen Kontraktwert möglichst aufrechtzuerhalten, geordnete Marktverhältnisse zu

gewährleisten sowie das Clearing und die Abwicklung der Kontrakte zu ermöglichen. Auch für den Fall, dass eine Kapitaltransaktion durchgeführt wird, die durch die Bestimmungen der Ziffer 1.26.11 Absatz 6 nicht geregelt wird, wird die Eurex Deutschland eine sich an diese anlehrende Regelung erlassen. Die Eurex Deutschland informiert die Börsenteilnehmer über die beabsichtigten Maßnahmen.

- (8) Anpassungen von Kontraktgrößen, Abrechnungspreisen und Umrechnungsparametern dienen dem Ziel, den ursprünglichen Kontraktwert zu erhalten. Hierzu werden insbesondere die folgenden Anpassungsmethoden einzeln oder auch kombiniert herangezogen.

R-Faktor-Methode: Wird die R-Faktor-Methode angewendet, werden die Kontraktgrößen angepasst, indem die dem jeweiligen Kontrakt zugrundeliegende Anzahl von Aktien durch einen Anpassungsfaktor (den „R-Faktor“) dividiert wird, und erfolgt die Anpassung der Abrechnungspreise durch Multiplikation mit dem R-Faktor. Der R-Faktor ergibt sich aus der Division des Wertes der relevanten Aktien ohne den jeweiligen Anspruch durch den Wert der relevanten Aktien mit dem jeweiligen Anspruch. Der R-Faktor wird auf acht Dezimalstellen gerundet. Kontraktgrößen werden auf vier Dezimalstellen gerundet.

Basket-Methode: Wird die Basket-Methode angewendet, werden die zugrundeliegenden Aktien eines Kontrakts durch ein Paket von Aktien ohne den jeweiligen Anspruch und durch den Gegenwert des jeweiligen Anspruchs ersetzt. Anpassungen von Kontraktgrößen und Abrechnungspreisen finden nicht statt.

Fair Value-Methode: Bei Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten wird der faire Wert anhand des TRF-Spreads bezogen auf die Restlaufzeit sowie gegebenenfalls anfallender geschätzter Dividenden ermittelt.

#### **1.26.12 Basket-Geschäfte in Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten**

- (1) Mehrere Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte können gleichzeitig als Basket-Geschäft gemäß Ziffer 4.3 Absatz 7 der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland („Basket-Geschäft“) gehandelt werden. Dabei gilt:
- (a) jeder Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt wird einer in Annex G aufgeführten Gruppenkennung zugewiesen und jede Gruppenkennung wird einem in Annex G aufgeführten Bucket („Bucket“) zugewiesen,
  - (b) Börsenteilnehmer wählen gemäß Ziffer 3.2.7 als Bestandteil eines Basket-Geschäfts einen oder mehrere Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die einem oder mehreren Zulässigen Buckets zugeordnet sind, sowie ein Profil aus (beides wie in Annex G definiert), das wiederum den ausgewählten Buckets zugeordnet ist.
  - (c) Die in einem Basket-Geschäft gehandelten Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte werden einer einheitlichen Basket ID zugewiesen. Unter einer Basket ID können weitere Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte gehandelt werden, wenn sie einem Bucket zugeordnet sind, der als Bestandteil für das Basket-Geschäft ausgewählt wurde.

- (2) Der ursprüngliche Käufer eines Basket-Geschäfts ist berechtigt, einen oder mehrere der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die Bestandteil dieses Basket-Geschäfts sind, durch einen oder mehrere andere Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die einem oder mehreren Zulässigen Buckets zugewiesen sind, welche Bestandteil des betreffenden Basket-Geschäfts sind, zu ersetzen.
- (3) Für den Fall, dass die Anforderungen des jeweiligen Profils, das Bestandteil des betreffenden Basket-Geschäfts ist, aufgrund einer Änderung des Werts der gehandelten Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte nicht länger erfüllt sind, ist jede Partei eines Basket-Geschäfts berechtigt, einen oder mehrere der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die Bestandteil dieses Basket-Geschäfts sind, durch einen oder mehrere andere Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die einem oder mehreren Zulässigen Buckets zugewiesen sind, welche Bestandteil des betreffenden Basket-Geschäfts sind, zu ersetzen.
- (4) Die Substitutionsrechte gemäß Ziffer 1.26.12 Absatz 2 und Absatz 3 stehen der jeweiligen Partei eines Basket-Geschäfts nur dann zu, wenn die Anforderungen des jeweiligen Profils, das gemäß Ziffer 3.2.7 (iii) Bestandteil des Basket-Geschäfts ist, auch nach der Ersetzung erfüllt sind.
- (5) Die Ausübung der Substitutionsrechte gemäß Ziffer 1.26.12 Absatz 2 und Absatz 3 erfolgt über ein Glattstellungsgeschäft der zu ersetzenden Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte und ein entgegengesetztes Eröffnungsgeschäft der zusätzlichen Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die über den T7-Entry-Service in das Basket-Geschäft aufgenommen werden sollen („Substitutionsgeschäfte“). Die jeweilige Gegenpartei ist 30 Minuten vor der Eingabe von Substitutionsgeschäften in den T7-Entry-Service durch eine Partei eines Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakts zu informieren.
- (6) Wurde ein Substitutionsgeschäft durch eine Partei eines Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakts in den T7-Entry-Service eingegeben, ist die jeweilige Gegenpartei verpflichtet, das entsprechende Substitutionsgeschäft fristgerecht gemäß Ziffer 4.4 der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland zu bestätigen. Die jeweilige Gegenpartei darf die Bestätigung eines Substitutionsgeschäfts nur verweigern, wenn
- (a) die Anforderungen gemäß Ziffer 1.26.12 Absatz 2, Absatz 3 und/oder Absatz 4 und Absatz 5 nicht erfüllt sind, oder
- (b) die Differenz zwischen dem Nominalwert der zugrundeliegenden Referenzaktien der zu eröffnenden Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte und dem der glattzustellenden Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte über dem höheren der folgenden Werte liegt: 0,05 % des Nominalwerts der zugrundeliegenden Referenzaktien der glattzustellenden Aktien-Total-Return-Futures oder EUR 50.000, oder
- (c) der für das Substitutionsgeschäft verwendete Kurs der zugrundeliegenden Referenzaktien der Aktien-Total-Return-Futures sich nicht innerhalb der Spanne

zwischen dem Tagestiefst- und Tageshöchststand des gehandelten Kurses bewegt, welcher an der Primärbörse der entsprechenden, in Annex G aufgeführten, zugrundeliegenden Referenzaktie bereitgestellt wird, oder

(d) der für das Substitutionsgeschäft verwendete TRF-Spread sich nicht innerhalb der Spanne zwischen entweder dem von der Eurex bereitgestellten Tagestiefststand des gehandelten Spreads oder dem vorherigen Abrechnungs-Spread für dieselbe Fälligkeit abzüglich fünfundzwanzig Basispunkten (je nachdem, welcher Wert niedriger ist) und entweder dem von der Eurex bereitgestellten Tageshöchststand des gehandelten Spreads oder dem vorherigen Abrechnungs-Spread für dieselbe Fälligkeit zuzüglich fünfundzwanzig Basispunkten (je nachdem, welcher Wert höher ist) bewegt, oder

(e) die jeweilige Gegenpartei der Eurex Deutschland bis zum Handelsschluss am jeweiligen Handelstag elektronisch mitteilt, dass ein eingegebenes Substitutionsgeschäft aufgrund interner Richtlinien, geltender Verwaltungsvorschriften oder Gesetze nicht bestätigt werden kann und die entsprechende Mitteilung von der Compliance-Abteilung der jeweiligen Gegenpartei bis 12:00 Uhr MEZ am darauffolgenden Handelstag bestätigt wurde, oder

(f) das Substitutionsgeschäft nach 15:00 Uhr MEZ über den T7-Trade-Entry-Service eingegeben und der Gegenpartei übermittelt wurde.

(7) Die Partei, die die Bestätigung des Substitutionsgeschäfts gemäß Ziffer 1.26.12 Absatz 6 verweigert, muss gegenüber der Eurex Deutschland nachweisen, dass die Anforderungen von Ziffer 6 a) bis f) erfüllt sind. Nach Ziffer 1.26.12 Absatz 6 e) ist weder die entsprechende Partei noch ihre Compliance-Abteilung verpflichtet, entsprechende interne Richtlinien, geltende Verwaltungsvorschriften oder Gesetze genauer zu bezeichnen. Die Übermittlung der Mitteilung und deren Bestätigung gegenüber der Eurex Deutschland gelten als ausreichend.

(8) Nach Erhalt der Bestätigung der Compliance-Abteilung gemäß Ziffer 1.26.12 Absatz 6 e) setzt die Eurex Deutschland die Partei, die das Substitutionsgeschäft eingegeben hat, bis 12:30 MEZ am Handelstag nach dem Handelstag, an dem das Substitutionsgeschäft eingegeben wurde, in Kenntnis, dass das eingegebene Substitutionsgeschäft von der entsprechenden Gegenpartei nicht bestätigt werden kann. Die Partei, die das Substitutionsgeschäft eingegeben hat, kann daraufhin ein anderes Substitutionsgeschäft vorschlagen.

[...]

### **Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book**

[...]

### Teilabschnitt 3.1 Eingabeintervalle für Kontraktpreise

[...]

#### 3.1.3 Eingabeintervall für Index- und Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte

Abweichend von Ziffer 3.1.1 ergibt sich das Intervall für Index- und Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte aus dem in Basispunkten ausgedrückten -Täglichen-Abrechnungs-TRF-Spread des jeweiligen Futures-Kontrakts vom vorherigen Handelstag gemäß Kapitel II Abschnitt 2 Ziffer 2.22.2 der Clearing Conditions der Eurex Clearing AG. Zur Berechnung des Intervalls sind folgende Auf- und Abschläge vorzunehmen:

Produkt	Produkt-ID	Betrag
Index Total Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50®	TESX	+ / - 25 Basispunkte (1 Basispunkt = 0,0001)
Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte	<u>Gemäß Auflistung in Annex G</u>	+ / - 25 Basispunkte (1 Basispunkt = 0,0001)

[...]

### 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	Zusätzliche Kontraktvarianten J/N	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte
Standard		
[...]		
Index-Total-Return-Futures		
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50® (TESX)	N	100
[...]		

[...]

#### 3.2.6 Trade-at-Market Geschäfte

Folgende Kontrakte sind zugelassen:



Product	Minimum number of contracts traded
Index Total Return Futures	
Index Total Return Futures Contracts on the EURO STOXX 50® (TESX)	100
Als Basket-Geschäfte gehandelte Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte gemäß Ziffer 3.2.7	n.a.

[...]

### **3.2.7 Basket-Geschäfte in Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten**

Folgende Kontrakte sind zugelassen:

Produkt	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte	Gruppenkennung	Handelsmodalitäten
Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte	Gemäß Annex G	Gemäß Annex G	Trade at Close (TAC) Trade at Market (TAM)

Bei Eingabe eines Basket-Geschäfts mit Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten muss der Börsenteilnehmer Folgendes eingeben:

- (i) einen oder mehrere der in Annex G aufgeführten Buckets und
- (ii) einen oder mehrere Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die einem der ausgewählten Buckets zugewiesen sind, und
- (iii) ein den ausgewählten Buckets entsprechendes Profil, wie in Annex G aufgeführt.

Bei der Ausführung eines Basket-Geschäfts mit Total-Return-Futures-Kontrakten generiert das Eurex-Handelssystem zusätzlich eine eindeutige Kennung für jeden in dem betreffenden Basket gehandelten Total-Return-Futures-Kontrakt („Basket-ID“).

Bei Eingabe eines Substitutionsgeschäfts gemäß Ziffer 1.26.12 Absatz 5 muss der Börsenteilnehmer (i) eine gültige Basket-ID und (ii) gültige Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die gemäß Ziffer 1.26.12 Absätze 2 bis 5 eröffnet bzw. glattgestellt werden sollen, eingeben.

[...]

**Annex C zu den Kontraktsspezifikationen:**

**Handelszeiten Futures-Kontrakte**

[...]

Index-Futures-Kontrakte

Produkt	Produkt-ID	Pre-Trading-Periode	Fortlaufender Handel	Post-Trading Periode bis	Off-book Trading Periode	Off-book Post-Trading Periode bis	Letzter Handelstag
							Handel bis
[...]							
Index-Total-Return-Futures auf den EURO STOXX 50® Index	TESX	07:30-07:50	07:50-17:25	17:25-22:10	08:00-22:00	22:10	17:30
[...]							

[...]

Total-Return-Futures-Kontrakte

Produkt	Produkt-ID	Pre-Trading-Periode	Fortlaufender Handel	Post-Trading Periode bis	Off-book Trading Periode	Off-book Post-Trading Periode bis	Letzter Handelstag
							Handel bis
<u>Index-Total-Return-Futures auf den EURO STOXX 50®-Index</u>	<u>TESX</u>	<u>07:30-08:15</u>	<u>08:15-17:25</u>	<u>17:25-22:10</u>	<u>08:15-22:00</u> Trade At Close (TAC) <u>08:15-18:00</u>	<u>22:10</u>	<u>17:30</u>
<u>Aktien-Total-Return-Futures</u>	<u>Produkt-ID gemäß Annex G</u>	<u>09:25-09:30</u>	<u>09:30-17:25</u>	<u>17:25-22:10</u>	<u>09:30-22:00</u> Trade At Close (TAC) <u>09:30-18:00</u>	<u>22:10</u>	<u>17:30</u>

alle Zeiten MEZ

[...]

**Annex E Allokationsverfahren (Teil A Ziffer 2.5 Abs. 3 der Handelsbedingungen) und  
Pfadprioritäten (Teil A Ziffer 2.5 Abs. 2 der Handelsbedingungen) \***

Produktgruppe	Allokationsverfahren	Pfadpriorität
[...]		
Index Total Return-Futures	Time	Direkter Pfad
<u>Aktien-Total-Return-Futures</u>	<u>Time</u>	<u>Direkter Pfad</u>
[...]		

\* Tabelle gilt nur für an der New Trading Architektur gehandelte Produkte (Annex F).

[...]

**Annex G zu Ziffer 1.26 der Kontraktsspezifikationen:**

<b>Total-Return-Futures-Kontrakte auf Aktien („Aktien-Total-Return-Futures“)</b>	<b>Produkt- ID</b>	<b>Gruppen- - kennung *</b>	<b>Kassa- markt-ID*</b>	<b>Kontrakt- größe</b>	<b>Währung</b>	<b>Mindest- anzahl der zu handelnd en Kontrakte</b>
Accrued Distributions (Dividendenindizes) ab 24.12.2018						
Accrued Funding ab Produkteinführung am 07.10.2019						
<u>1&amp;1 Drillisch AG</u>	<u>IDRI</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>A2A SpA</u>	<u>TEAM</u>	<u>BX41</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>250</u>
<u>Aalberts NV</u>	<u>TAAI</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Aareal Bank AG</u>	<u>TARL</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>ABN AMRO Group NV</u>	<u>TAAR</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Accor SA</u>	<u>TACR</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>ACS Actividades de Construcción y Servicios SA</u>	<u>TOCI</u>	<u>BA40</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>adidas AG</u>	<u>TADS</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>AEGON NV</u>	<u>TAEN</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>75</u>
<u>Aena SA</u>	<u>TAEP</u>	<u>BA40</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Aeroports de Paris</u>	<u>TW7L</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Ageas SA/NV</u>	<u>TFO4</u>	<u>AA40</u>	<u>XBRU</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>AIB Group PLC</u>	<u>TALB</u>	<u>BX41</u>	<u>XDUB</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>75</u>
<u>Air France-KLM</u>	<u>TAFR</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Air Liquide SA</u>	<u>TAIR</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Airbus SE</u>	<u>TEAD</u>	<u>AA40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Akzo Nobel NV</u>	<u>TAKU</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Allianz SE</u>	<u>TALV</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Alstom SA</u>	<u>TAOM</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Amadeus IT Group SA</u>	<u>TAI3</u>	<u>BA40</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Amundi SA</u>	<u>TAMU</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Anheuser-Busch InBev SA</u>	<u>TITK</u>	<u>AA40</u>	<u>XBRU</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>ArcelorMittal SA</u>	<u>TISP</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>ARKEMA SA</u>	<u>TAKE</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Aroundtown SA</u>	<u>TAT1</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>ASM International NV Bearer</u>	<u>TASI</u>	<u>AA41</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>ASML Holding NV</u>	<u>TASM</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>ASR Nederland NV</u>	<u>TASR</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Assicurazioni Generali SpA</u>	<u>TASG</u>	<u>BX40</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Atlantia SpA</u>	<u>TAOP</u>	<u>BX40</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>250</u>

<b>Total-Return-Futures-Kontrakte auf Aktien („Aktien-Total-Return-Futures“)</b>	<b>Produkt- ID</b>	<b>Gruppen- - kennung *</b>	<b>Kassa- markt-ID*</b>	<b>Kontrakt- größe</b>	<b>Währung</b>	<b>Mindest- anzahl der zu handelnd en Kontrakte</b>
AtoS SA	TAXI	AX40	XPAR	100	EUR	5
Aurubis AG	TNDA	AA41	XETR	100	EUR	5
AXA SA	TAXA	AX40	XPAR	100	EUR	25
Banca BPM	TBPV	BX41	XMIL	100	EUR	100
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA (BBVA)	TBBV	BA40	XMAD	100	EUR	400
Banco Comercial Portugues SA	TBCP	BA41	XLIS	100	EUR	750
Banco de Sabadell SA	TBDS	BA40	XMAD	100	EUR	150
Banco Santander SA	TBSD	BA40	XMAD	100	EUR	3000
Bank of Ireland	TBIR	BX41	XDUB	100	EUR	50
Bankia SA	TFV0	BA41	XMAD	100	EUR	75
Bankinter SA	TBAK	BA40	XMAD	100	EUR	50
BASF SE	TBAS	AA40	XETR	100	EUR	75
Bayer AG	TBAY	AA40	XETR	100	EUR	75
Beiersdorf AG	TBEI	AA40	XETR	100	EUR	5
Biomerieux	TBIM	AX41	XPAR	100	EUR	5
BMW AG	TBMW	AA40	XETR	100	EUR	5
BNP Paribas SA	TBNP	AX40	XPAR	100	EUR	250
Bouygues SA	TBYG	AX40	XPAR	100	EUR	10
Brenntag AG	TBNR	AA41	XETR	100	EUR	10
Bureau Veritas SA	TBVI	AX41	XPAR	100	EUR	25
CaixaBank SA	TCRT	BA40	XMAD	100	EUR	75
Cargemini SA	TCGM	AX40	XPAR	100	EUR	5
Carrefour SA	TCAR	AX40	XPAR	100	EUR	25
Cellnex Telecom SA	TCLN	BA40	XMAD	100	EUR	25
CNH Industrial NV	TFIM	AA40	XMIL	100	EUR	50
Commerzbank AG	TCBK	AA40	XETR	100	EUR	25
Compagnie de Saint-Gobain SA	TGOB	AX40	XPAR	100	EUR	10
Continental AG	TCON	AA40	XETR	100	EUR	5
Covestro AG Inhaber-Aktien oN	T1CO	AA40	XETR	100	EUR	5
Covivio	TFDR	AX41	XPAR	100	EUR	5
Crédit Agricole SA	TXCA	AX40	XPAR	100	EUR	25
CRH PLC	TCRG	BX40	XDUB	100	EUR	10
Daimler AG	TDAI	AA40	XETR	100	EUR	250
Danone SA	TBSN	AX40	XPAR	100	EUR	5
Dassault Aviation SA	TAVM	AX41	XPAR	100	EUR	10

<b>Total-Return-Futures-Kontrakte auf Aktien („Aktien-Total-Return-Futures“)</b>	<b>Produkt- ID</b>	<b>Gruppen- - kennung *</b>	<b>Kassa- markt-ID*</b>	<b>Kontrakt- größe</b>	<b>Währung</b>	<b>Mindest- anzahl der zu handelnd en Kontrakte</b>
Dassault Systemes SA	TDYS	AX40	XPAR	100	EUR	5
Davide Campari-Milano SpA	TDVC	BX41	XMIL	100	EUR	50
Delivery Hero AG	TDHE	AA41	XETR	100	EUR	10
Deutsche Bank AG	TDBK	AA40	XETR	100	EUR	400
Deutsche Börse AG	TDB1	AA40	XETR	100	EUR	5
Deutsche Lufthansa AG	TLHA	AA40	XETR	100	EUR	25
Deutsche Post AG	TDPW	AA40	XETR	100	EUR	10
Deutsche Telekom AG	TDTE	AA40	XETR	100	EUR	25
Deutsche Wohnen SE	TDWN	AA41	XETR	100	EUR	10
Edenred S A	TQSV	AX41	XPAR	100	EUR	25
EDP - Energias de Portugal SA	TEDP	BA41	XLIS	100	EUR	100
Eiffage SA	TEF3	AX41	XPAR	100	EUR	5
Electricité de France (EDF)	TE2F	AX41	XPAR	100	EUR	50
Elisa Oyj	TEIA	AA41	XHEL	100	EUR	10
Enagas SA	TEG4	BA40	XMAD	100	EUR	125
Endesa SA Acciones Port EO	TEDS	BA40	XMAD	100	EUR	25
Enel SpA	TENE	BX40	XMIL	100	EUR	750
ENGIE	TGZF	AX40	XPAR	100	EUR	1250
Eni SpA	TENI	BX40	XMIL	100	EUR	1250
EON SE	TEOA	AA40	XETR	100	EUR	50
Erste Group Bank AG	TEBS	AA41	XVIE	100	EUR	10
EssilorLuxottica SA	TESL	AX40	XPAR	100	EUR	5
Établissements Franz Colruyt SA	TEFC	AA40	XBRU	100	EUR	10
EURAZEO SE	TEUQ	AX41	XPAR	100	EUR	5
Eurofins Scientific Group SA	TESS	AX41	XPAR	100	EUR	1
Eutelsat Communications SA	TE3B	AX41	XPAR	100	EUR	25
Evonik Industries AG	TEVK	AA41	XETR	100	EUR	10
EXOR NV	TIIL	AA40	XMIL	100	EUR	5
Faurecia SA	TFAU	AX41	XPAR	100	EUR	10
Ferrari NV	T2FE	AA40	XMIL	100	EUR	10
Ferrovial SA	TUFG	BA40	XMAD	100	EUR	25
Fiat Chrysler Automobiles NV	TFIA	AA40	XMIL	100	EUR	50
FinecoBank Banca Fineco SpA	TFBK	BX41	XMIL	100	EUR	50
Flutter Entertainment PLC	TPLS	BX41	XDUB	100	EUR	5
Fortum Oyj	TFOT	AA41	XHEL	100	EUR	25

<b>Total-Return-Futures-Kontrakte auf Aktien („Aktien-Total-Return-Futures“)</b>	<b>Produkt- ID</b>	<b>Gruppen- - kennung *</b>	<b>Kassa- markt-ID*</b>	<b>Kontrakt- größe</b>	<b>Währung</b>	<b>Mindest- anzahl der zu handelnd en Kontrakte</b>
<u>Fraport AG</u>	<u>TFRA</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>freenet AG</u>	<u>TFNT</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Fresenius Medical care AG &amp; Co KGaA</u>	<u>TFME</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Fresenius SE &amp; CoKGaA</u>	<u>TFRE</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Galapagos NV</u>	<u>TGLP</u>	<u>AA40</u>	<u>XBRU</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Galp Energia SGPS SA</u>	<u>TGAL</u>	<u>BA41</u>	<u>XLIS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>GEA Group AG</u>	<u>TG1A</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Gecina SA</u>	<u>TGI6</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Getlink</u>	<u>TTNU</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Glanbia PLC</u>	<u>TGL9</u>	<u>BX41</u>	<u>XDUB</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Grifols SA</u>	<u>TOZT</u>	<u>BA40</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Groupe Bruxelles</u>	<u>TEAI</u>	<u>AA40</u>	<u>XBRU</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Hannover Rück SE</u>	<u>THNR</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>HeidelbergCement AG</u>	<u>THEI</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Heineken Holding NV</u>	<u>THEH</u>	<u>AA41</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Heineken NV</u>	<u>THNK</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Henkel KGaA - Vz</u>	<u>THEN</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Hermes International SA</u>	<u>TDIO</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>1</u>
<u>HOCHTIEF AG</u>	<u>THOT</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Hugo Boss AG</u>	<u>TBOS</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Huhtamäki Oyj</u>	<u>THUK</u>	<u>AA41</u>	<u>XHEL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Iberdrola SA</u>	<u>TIBE</u>	<u>BA40</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Iliad SA</u>	<u>TILD</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Industria de Diseño Textil SA</u>	<u>TIXD</u>	<u>BA40</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>175</u>
<u>Infineon Technologies AG</u>	<u>TIFX</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>ING Groep NV</u>	<u>TING</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>400</u>
<u>Ingenico Group SA</u>	<u>TIIE</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Inmobiliaria Colonial SA</u>	<u>TCOL</u>	<u>BA41</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Intesa Sanpaolo SpA</u>	<u>TIES</u>	<u>BX40</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>100</u>
<u>Ipsen SA</u>	<u>TIPN</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Italgas SpA</u>	<u>TIGA</u>	<u>BX41</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>100</u>
<u>Jeronimo Martins SGPS</u>	<u>TJEM</u>	<u>BA41</u>	<u>XLIS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>K+S Aktiengesellschaft</u>	<u>TSDF</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>KBC Groep NV</u>	<u>TKDB</u>	<u>AA40</u>	<u>XBRU</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>225</u>
<u>Kering</u>	<u>TPPX</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>1</u>

<b>Total-Return-Futures-Kontrakte auf Aktien („Aktien-Total-Return-Futures“)</b>	<b>Produkt- ID</b>	<b>Gruppen- - kennung *</b>	<b>Kassa- markt-ID*</b>	<b>Kontrakt- größe</b>	<b>Währung</b>	<b>Mindest- anzahl der zu handelnd en Kontrakte</b>
<u>Kerry Group PLC</u>	<u>TKYG</u>	<u>BX40</u>	<u>XDUB</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Kesko Oy</u>	<u>TKEK</u>	<u>AA41</u>	<u>XHEL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Kingspan Group PLC</u>	<u>TKRX</u>	<u>BX41</u>	<u>XDUB</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Kion Group AG</u>	<u>TKGX</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Klépierre SA</u>	<u>TCL6</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Kone Corp</u>	<u>TKC4</u>	<u>AA41</u>	<u>XHEL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Koninklijke Ahold Delhaize NV</u>	<u>TAHO</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Koninklijke Boskalis Westminster NV</u>	<u>TKBW</u>	<u>AA41</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Koninklijke DSM NV</u>	<u>TDSM</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Koninklijke KPN NV</u>	<u>TKPN</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>100</u>
<u>Koninklijke Philips NV</u>	<u>TPHI</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Lagardère SCA</u>	<u>TLAG</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>LANXESS AG</u>	<u>TLXS</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>LEG Immobilien AG</u>	<u>TLEG</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Legrand SA</u>	<u>TLRC</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Leonardo-Finmeccanica SpA</u>	<u>TFMN</u>	<u>BX40</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Linde PLC</u>	<u>TLIN</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>L'Oréal SA</u>	<u>TLOL</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE</u>	<u>TMOH</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>75</u>
<u>Mapfre SA</u>	<u>TCMA</u>	<u>BA41</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>1000</u>
<u>Mediobanca SpA</u>	<u>TME9</u>	<u>BX40</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Merck KGaA</u>	<u>TMRK</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Merlin Properties SOCIMI SA</u>	<u>TMRL</u>	<u>BA40</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Metso Corp</u>	<u>TVLM</u>	<u>AA41</u>	<u>XHEL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Michelin et Cie SCpA</u>	<u>TMCH</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Moncler SrL Azioni nom oN</u>	<u>TMON</u>	<u>BX40</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>MorphoSys AG</u>	<u>TMOR</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>MTU Aero Engines AG</u>	<u>TMTX</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG</u>	<u>TMUE</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Natixis SA</u>	<u>TNBP</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Natural Energy Group SA</u>	<u>TGAN</u>	<u>BA40</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Neste OYJ</u>	<u>TNEF</u>	<u>AA41</u>	<u>XHEL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>NN GROUP NV</u>	<u>TNNG</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Nokia Corp Oyj</u>	<u>TCGE</u>	<u>AA40</u>	<u>XHEL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Nokian Renkaat Oyj</u>	<u>TNRE</u>	<u>AA41</u>	<u>XHEL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>



<b>Total-Return-Futures-Kontrakte auf Aktien („Aktien-Total-Return-Futures“)</b>	<b>Produkt- ID</b>	<b>Gruppen- - kennung *</b>	<b>Kassa- markt-ID*</b>	<b>Kontrakt- größe</b>	<b>Währung</b>	<b>Mindest- anzahl der zu handelnd en Kontrakte</b>
OMV AG	TOMV	AA41	XVIE	100	EUR	10
Orange	TFTE	AX40	XPAR	100	EUR	400
Orion Corp (New) RS	TORN	AA41	XHEL	100	EUR	10
Orpea	TORP	AX41	XPAR	100	EUR	5
Pernod-Ricard SA	TPER	AX40	XPAR	100	EUR	50
Peugeot SA	TPEU	AX40	XPAR	100	EUR	25
Pirelli & C SpA	TPIR	BX41	XMIL	100	EUR	50
Porsche Automobil Holding SE	TPOR	AA41	XETR	100	EUR	75
Poste Italiane SpA	T7PI	BX40	XMIL	100	EUR	50
ProSiebenSat1 Media AG	TPSM	AA40	XETR	100	EUR	10
Proximus PLC	TBX7	AA40	XBRU	100	EUR	10
Prysmian SpA	TPRY	BX40	XMIL	100	EUR	10
Publicis Groupe SA	TPU4	AX40	XPAR	100	EUR	5
Qiagen NV	TQIA	AA41	XETR	100	EUR	10
Raiffeisen Bank International AG	TRIB	AA41	XVIE	100	EUR	10
Randstad NV	TRSH	AA40	XAMS	100	EUR	5
Recordati SPA	TRE9	BX41	XMIL	100	EUR	10
Red Electrica Corporación SA	TRE2	BA40	XMAD	100	EUR	25
Rémy Cointreau SA	TRCO	AX41	XPAR	100	EUR	5
Renault SA	TRNL	AX40	XPAR	100	EUR	5
Repsol SA	TREP	BA40	XMAD	100	EUR	25
Rexel SA	TRXL	AX41	XPAR	100	EUR	50
Rheinmetall AG	TRHM	AA41	XETR	100	EUR	5
Royal Dutch Shell plc - A shares	TRDS	AA40	XAMS	100	EUR	125
Rubis SCA	TRUB	AX41	XPAR	100	EUR	10
RWE AG	TRWE	AA40	XETR	100	EUR	25
Ryanair Holding PLC	TRYA	BX41	XDUB	100	EUR	25
Safran SA	TSEJ	AX40	XPAR	100	EUR	50
Saipem SpA	TSPE	BX41	XMIL	100	EUR	100
Sampo PLC	TSMP	AA41	XHEL	100	EUR	10
Sanofi	TSNW	AX40	XPAR	100	EUR	5
SAP SE	TSAP	AA40	XETR	100	EUR	175
SBM Offshore NV	TSBM	AA41	XAMS	100	EUR	25
Schneider Electric SE	TSND	AX40	XPAR	100	EUR	5
SCOR SE	TSDR	AX41	XPAR	100	EUR	10

<b>Total-Return-Futures-Kontrakte auf Aktien („Aktien-Total-Return-Futures“)</b>	<b>Produkt- ID</b>	<b>Gruppen- - kennung *</b>	<b>Kassa- markt-ID*</b>	<b>Kontrakt- größe</b>	<b>Währung</b>	<b>Mindest- anzahl der zu handelnd en Kontrakte</b>
<u>SES SA</u>	<u>TSES</u>	<u>AA41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Siemens Gamesa Renewable Energy SA</u>	<u>TGTQ</u>	<u>BA41</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Siemens Healthineers AG</u>	<u>TSHH</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Siemens AG</u>	<u>TSIE</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>150</u>
<u>Signify NV</u>	<u>TLIG</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Siltronic AG Namens-Aktien oN</u>	<u>TWAF</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Smurfit Kappa Group PLC</u>	<u>TSK3</u>	<u>BX41</u>	<u>XDUB</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Snam SpA</u>	<u>TSNF</u>	<u>BX40</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>100</u>
<u>Société Générale SA</u>	<u>TSGE</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>125</u>
<u>Sodexo SA</u>	<u>TSJ7</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Solvay SA</u>	<u>TSOL</u>	<u>AA40</u>	<u>XBRU</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>STMicroelectronics NV</u>	<u>TSGM</u>	<u>AA40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Stora Enso Oyj</u>	<u>TENU</u>	<u>AA41</u>	<u>XHEL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Suez</u>	<u>TSEV</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Symrise AG</u>	<u>TSY1</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>TAG Immobilien AG</u>	<u>ITAG</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>TechnipFMC</u>	<u>TTHP</u>	<u>AA40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Telecom Italia SpA</u>	<u>TTQI</u>	<u>BX41</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>4000</u>
<u>Telefonica Deutschland O2</u>	<u>TO2D</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>75</u>
<u>Telefónica SA</u>	<u>TTNC</u>	<u>BA40</u>	<u>XMAD</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>350</u>
<u>Telenet Group Holding NV</u>	<u>TTNE</u>	<u>AA40</u>	<u>XBRU</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Téléperformance SA</u>	<u>TRCF</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Tenaris SA</u>	<u>TTEN</u>	<u>AA41</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>Terna SpA</u>	<u>TUEI</u>	<u>BX40</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>100</u>
<u>Thales SA</u>	<u>TCSE</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>ThyssenKrupp AG</u>	<u>TTKA</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Total SA</u>	<u>TTOT</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>350</u>
<u>UBI Banca</u>	<u>TBPD</u>	<u>BX41</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>100</u>
<u>Ubisoft Entertainment SA</u>	<u>TUEN</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>UCB SA</u>	<u>TUNC</u>	<u>AA40</u>	<u>XBRU</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Umicore SA</u>	<u>TNVJ</u>	<u>AA40</u>	<u>XBRU</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Unibail-Rodamco SE</u>	<u>TUBL</u>	<u>AX40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>50</u>
<u>UniCredit SpA</u>	<u>TCRI</u>	<u>BX40</u>	<u>XMIL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Unilever NV</u>	<u>TUNI</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>350</u>
<u>Uniper SE Namens-Aktien oN</u>	<u>TUNO</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>

<b>Total-Return-Futures-Kontrakte auf Aktien („Aktien-Total-Return-Futures“)</b>	<b>Produkt- ID</b>	<b>Gruppen- - kennung *</b>	<b>Kassa- markt-ID*</b>	<b>Kontrakt- größe</b>	<b>Währung</b>	<b>Mindest- anzahl der zu handelnd en Kontrakte</b>
<u>United Internet AG</u>	<u>TUTD</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>UPM Kymmene Corp</u>	<u>TRPL</u>	<u>AA41</u>	<u>XHEL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Valéo SA</u>	<u>TVSA</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Veolia Environnement SA</u>	<u>TVVD</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>VINCI SA</u>	<u>TSQU</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>200</u>
<u>Vivendi SA</u>	<u>TVVU</u>	<u>AX40</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>voestalpine AG</u>	<u>TVOE</u>	<u>AA41</u>	<u>XVIE</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Vonovia SE</u>	<u>TANN</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Vopak</u>	<u>TVPK</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>VW AG - Vz</u>	<u>TVO3</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Wärtsilä Corp</u>	<u>TMTA</u>	<u>AA41</u>	<u>XHEL</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>25</u>
<u>Wendel SA</u>	<u>TMFX</u>	<u>AX41</u>	<u>XPAR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Wirecard AG</u>	<u>TWDI</u>	<u>AA40</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>5</u>
<u>Wolters Kluwer NV</u>	<u>TWOS</u>	<u>AA40</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>
<u>Zalando SE Inhaber-Aktien oN</u>	<u>TZAL</u>	<u>AA41</u>	<u>XETR</u>	<u>100</u>	<u>EUR</u>	<u>10</u>

\* Die Gruppenkennung sowie die Kassamarkt-ID werden von der Eurex Deutschland entsprechend der nachfolgenden Tabelle vergeben und haben lediglich eine interne Zuordnungsfunktion. Bei einem Wechsel des Referenzmarkts der zugrundeliegenden Aktie im Elektronischen Handelssystem innerhalb der Euronext-Börsen Euronext Brussels, Euronext Paris und Euronext Amsterdam kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland für einen Kontrakt die Kassamarkt-ID ändern und damit einen anderen als den bei der Einführung des Kontrakts festgelegten maßgeblichen Kassamarkt bestimmen.

<b>ID des Kassamarktes</b>	<b>Maßgeblicher Kassamarkt</b>
<u>XVIE</u>	<u>Elektronisches Handelssystem der Wiener Börse</u>
<u>XBRU</u>	<u>Elektronisches Handelssystem der Euronext Brussels</u>
<u>XETR</u>	<u>Elektronisches Handelssystem der Frankfurter Wertpapierbörse</u>
<u>XMAD</u>	<u>Elektronisches Handelssystem der Bolsa de Madrid</u>
<u>XHEL</u>	<u>Elektronisches Handelssystem der Nasdaq OMX Helsinki</u>
<u>XPAR</u>	<u>Elektronisches Handelssystem der Euronext Paris</u>
<u>XDUB</u>	<u>Elektronisches Handelssystem der Irish Stock Exchange</u>
<u>XMIL</u>	<u>Elektronisches Handelssystem der Borsa Italiana</u>
<u>XAMS</u>	<u>Elektronisches Handelssystem der Euronext Amsterdam</u>
<u>XLIS</u>	<u>Elektronisches Handelssystem der Euronext Lisbon</u>

<b>Gruppenkennung</b>	<b>Bucket / Bucket-ID**</b>	<b>Gruppenbeschreibung (ausschließlich zu Informationszwecken)</b>
<u>AA40</u>	<u>B1</u>	<u>AA-Länderrating / Large Cap</u>
<u>AA41</u>	<u>B2</u>	<u>AA-Länderrating / Mid Cap</u>

Gruppenkennung	Bucket / Bucket-ID**	Gruppenbeschreibung (ausschließlich zu Informationszwecken)
AX40	B3	AA-Länderrating / Large Cap / unterliegt FTS
AX41	B4	AA-Länderrating / Mid Cap / unterliegt FTS
BA40	B5	Single A-Länderrating / Large Cap
BA41	B6	Single A-Länderrating / Mid Cap
BX40	B7	Single A-Länderrating/Large Cap / unterliegt FTS
BX41	B8	Single A-Länderrating/Mid Cap / unterliegt FTS

Profil- bezeich- nung	Profil- ID	Profilbeschreibung (ausschließlich zu Informationszwecken)				
		Zulässige Buckets	Bucket- Beschränkungen	Beschränkung im Hinblick auf das nominale ADV	Individuelle Beschränkung	Beschränkung für Unternehmen der Finanzbranche
Profil 0	PRF0	Alle				
Profil 1	PRF1	Alle		Höchstens 1 ADV	Höchstens 50 %	
Profil 2	PRF2	B1		Höchstens 1 ADV	Höchstens 50 %	Höchstens 30 %
Profil 3	PRF3	B1 und B3	B3 höchstens 50 %	Höchstens 1 ADV	Höchstens 50 %	Höchstens 30 %
Profil 4	PRF4	B1, B3, B5 und B7		Höchstens 1 ADV	Höchstens 50 %	Höchstens 30 %
Profil 5	PRF5	B1, B2, B3 und B4	B2 +B4 höchstens 50 %	Höchstens 1 ADV	Höchstens 50 %	Höchstens 30 %
Profil 6	PRF6	B1, B3, B5 und B7		Höchstens 1 ADV	Höchstens 50 %	
Profil 7	PRF7	B1 und B2	B2 höchstens 50 %	Höchstens 1 ADV	Höchstens 50 %	Höchstens 30 %
Profil 8	PRF8	B1 und B3		Höchstens 1 ADV	Höchstens 50 %	Höchstens 30 %
Profil 9	PRF9	B1, B3 und B5		Höchstens 1 ADV	Höchstens 50%	Höchstens 30%

Dabei gilt:

- **Zulässige Buckets** bezeichnet den Bucket oder die Buckets, der bzw. die zur Feststellung der Zulässigkeit des in einem Basket-Geschäft gehandelten Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakts verwendet wird bzw. werden. Lediglich Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die dem/den vorstehend aufgeführten Zulässigen Bucket(s) zugewiesen sind, können Teil eines Basket-Geschäfts in Bezug auf ein Profil werden.
- **Bucket-Beschränkungen** bezeichnet die Beschränkung nach dem Nominalwert der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte in den einzelnen Buckets, die Teil eines Basket-Geschäfts darstellen sollen, nach Abschluss, wobei diese Beschränkung als Prozentsatz des Nominalwerts aller Aktien-Total-Return-Futures in dem Basket ausgedrückt wird.
- **Beschränkung im Hinblick auf das nominale ADV** bezeichnet die Beschränkung im Hinblick auf das Vielfache des Nominalwerts der einzelnen Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte in einem Basket-Geschäft, ermittelt auf Grundlage des gehandelten Durchschnittlichen Tagesvolumens (Average Daily Value – ADV) der zugrundeliegende Aktie, wie in diesem Annex aufgeführt. Das ADV entspricht dem von Bloomberg bestimmten durchschnittlichen Tagesvolumen an den zurückliegenden zwanzig Tagen.

- **Individuelle Beschränkung** bezeichnet die Beschränkung nach dem Nominalwert der einzelnen Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die Teil eines Basket-Geschäfts darstellen sollen, nach Abschluss, wobei diese Beschränkung als Prozentsatz des Nominalwerts aller Aktien-Total-Return-Futures des Basket-Geschäfts ausgedrückt wird.
- **Beschränkung für Unternehmen der Finanzbranche** bezeichnet die Beschränkung nach dem Nominalwert der Teil eines Basket-Geschäfts darstellenden Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte auf die spezifische zugrundeliegende Aktie, wenn diese als Aktie eines Unternehmens der Finanzbranche gilt, nach Abschluss, wobei diese Beschränkung als Prozentsatz des Nominalwerts aller Aktien-Total-Return-Futures in dem Basket ausgedrückt wird. „Unternehmen der Finanzbranche“ hat die in Artikel 4 Absatz 1 Unterabsatz 27 CRR (Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012) aufgeführte Bedeutung.

[...]

\*\*\*\*\*