X-pand into the Future

e u r e x *r u n d s c h r e i b e n 098/14*

Datum: 15. Mai 2014
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich und Vendoren
Autorisiert von: Mehtap Dinc

Exchange for Physicals-Funktionalität für Indexprodukte (EFPI): Eingabemöglichkeit von Geschäften mit Referenz zum Indexschlusspreis zuzüglich Basis

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 059/14

Kontakt: Derivatives Trading Operations, T +49-69-211-1 12 10, Christine Heyde (Product Development), T +49-69-211-1 56 98, christine.heyde@eurexchange.com

Zielgruppe:

Ü Alle Abteilungen

Anhänge:

1. Eurex Clearing-Rundschreiben 059/14
2. Nur in englischer Sprache: Eingabezeiten eines „Trade at Index Close“ (TAIC)-Geschäfts in Verbindung mit § 3.4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „Clearing von OTC-Geschäften“

Zusammenfassung:

Der Vorstand der Eurex Clearing AG hat die Erweiterung der Exchange for Physicals-Funktionalität für Indexprodukte (EFPI) um die Eingabemöglichkeit von Geschäften mit Referenz zum Indexschlusspreis zuzüglich Basis („Trade at Index Close“) mit Wirkung zum **2. Juni 2014** beschlossen.

Dieses Rundschreiben enthält alle Informationen zur Einführung von „Trade at Index Close“-Geschäften. Informationen speziell zum Clearing dieser neuen Geschäfte sowie die geänderten Abschnitte der relevanten Regelwerke der Eurex Clearing AG sind im Eurex Clearing-Rundschreiben 059/14 enthalten, welches wir unseren Handelsteilnehmern als Anhang 1 zur Verfügung stellen.

Exchange for Physicals-Funktionalität für Indexprodukte (EFPI): Eingabemöglichkeit von Geschäften mit Referenz zum Indexschlusspreis zuzüglich Basis

Der Vorstand der Eurex Clearing AG hat die Erweiterung der Exchange for Physicals-Funktionalität für Indexprodukte (EFPI) um die Eingabemöglichkeit von Geschäften mit Referenz zum Indexschlusspreis zuzüglich Basis („Trade at Index Close“) mit Wirkung zum 2. Juni 2014 beschlossen.

Dieses Rundschreiben enthält Informationen zum Handel der eingeführten „Trade at Index Close“-Geschäfte. Weitere Informationen zum Clearing dieser neuen Geschäfte sowie die geänderten Abschnitte der relevanten Regelwerke der Eurex Clearing AG sind Eurex Clearing-Rundschreiben 059/14 zu entnehmen, welches wir unseren Handelsteilnehmern als Anhang 1 zur Verfügung stellen.

1. „Trade at Index Close“-Transaktion

Zwei Teilnehmer, die sich auf den Geschäftsabschluss eines Aktienindex-Future mit der Maßgabe geeinigt haben, dass die Preisfestlegung mit Referenz zum zukünftigen Schlusspreis des zugrundeliegenden Index plus Basis („garantierter Preis”) erfolgt, können dieses Geschäft über die EFPI Trade Entry-Funktionalität eingeben, sofern sich das Geschäft als „Trade at Index Close“ qualifiziert.

2. Beschreibung der Kennzeichnungspflichten eines „Trade at Index Close“ im EFPI-Trade Entry-Fenster im Zusammenhang mit § 8.2 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „Exchange for Physicals-Funktionalität für Indexprodukte (EFPI)“

2.1. Im Feld „RefID“ des EFPI-Trade Entry-Fensters

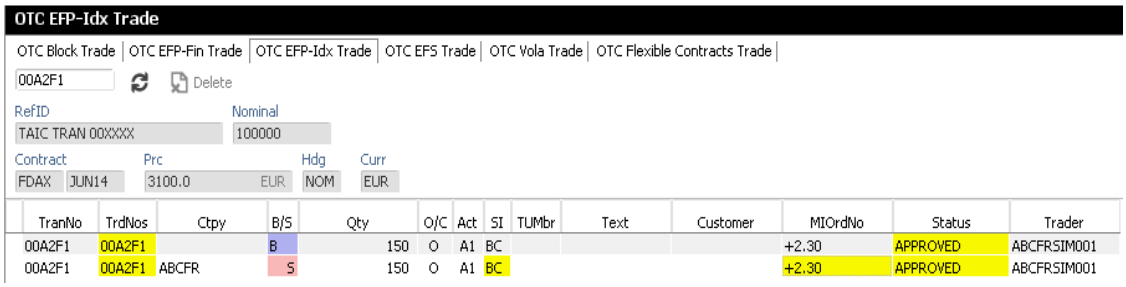
2.1.1. Angabe, dass es sich bei dem Geschäft um einen „Trade at Index Close“ handelt (Abkürzung „TAIC“)

2.1.2. Angabe der -Transaktionsnummer (TranNo; Abkürzung „TRAN“) von zusammengehörigen Geschäften eines Produktes im Fall der Aufteilung dieser Geschäfte

2.2. Im Feld „MIOrdNo/Text 3” des EFPI-Trade Entry-Fensters

Angabe der vereinbarten Basis.

2.3. Eingabebeispiel (Screenshot)



3. Eingabezeiten eines „Trade at Index Close“-Geschäfts im Zusammenhang mit § 3.4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „Clearing von OTC-Geschäften“

Die Geschäftseingabe hat zu erfolgen, wenn der nächste offizielle Schlusspreis des zugrundeliegenden Index verfügbar ist:

I. Regelfall

Feststellung des Indexschlusspreises erfolgt bis 17:50 Uhr MEZ: Die Eingabe der Geschäfte hat bis spätestens 18:15 Uhr MEZ des aktuellen Handelstages zu erfolgen.

II. Zulässige Ausnahmen

a. Feststellung des Indexschlusspreises erfolgt grundsätzlich nach 17:50 Uhr MEZ: Die Eingabe der Geschäfte hat bis spätestens 09:15 Uhr MEZ am nachfolgenden Handelstag zu erfolgen.
b. Feststellung des Indexschlusspreises erfolgt ausnahmsweise nach 17:50 Uhr MEZ, aber vor Handelsschluss: Die Eingabe der Geschäfte hat spätestens 15 Minuten nach Veröffentlichung des Indexschlusspreises zu erfolgen.
c. Feststellung des Indexschlusspreises erfolgt ausnahmsweise nach 17:50 Uhr MEZ, aber nach Handelsschluss: Die Eingabe der Geschäfte hat bis spätestens 09:15 Uhr MEZ am nachfolgenden Handelstag zu erfolgen.

Bitte entnehmen Sie die Eingabezeiten auf Einzelproduktbasis aus Anhang 2.

4. Eingabe von „Trade at Index Close“- Geschäften im Zusammenhang mit § 9.2 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „EFPI-Trade-Funktionalität“ zugelassenen Produkte

Für die Eingabe von „Trade at Index Close“-Geschäften werden alle zur EFPI-Trade-Funktionalität zugelassenen Produkte einbezogen.

5. Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte eines „Trade at Index Close“-Geschäfts im Zusammenhang mit § 9.4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „Block Trade-Funktionalität“

Die Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte für Futures-Geschäfte, die Bestandteil eines EFPI-„Trade at Index Close“ sind, beträgt ein Zehntel der für Block Trades in dem jeweiligen Index-Future festgelegten Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte.

6. Pflichten des Teilnehmers zum Nachweis des Vorliegens der Voraussetzungen eines Trade at Index Close im Zusammenhang mit § 4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „Nachweis des Basisinstrumentes bei Nutzung der EFP, EFPI-Trade-Funktionalität und der EFS-Trade-Funktionalität“

Die Einhaltung der Kriterien bezüglich Minimum Block Trade Size, Preis, Kennzeichnungspflicht und Eingabezeitpunkt wird auf täglicher Basis stichprobenartig überwacht.

Weiterhin werden wöchentlich Detailprüfungen für ausgewählte Geschäfte vorgenommen. Bei dieser Detailprüfung wird der Teilnehmer gebeten, für die entsprechenden Geschäfte einen Nachweis gemäß § 4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen zu erbringen.

Der Nachweis muss den garantierten Preis sowie den Zusammenhang mit dem jeweiligen offiziellen Schlusspreis des zugrundeliegenden Indexes ausweisen und kann per Fax oder E-Mail erfolgen.

7. Nichtlieferung von Nachweisen über die zugrunde liegenden Geschäfte bei EFPI-Geschäften

Sollte der Teilnehmer seine Nachweispflicht gemäß § 4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen nicht erbringen, kann Eurex Clearing das entsprechende Geschäft aufheben. Erfolgt die Aufhebung des Geschäfts, werden die Kosten der Aufhebung in Höhe von EUR 100 gemäß § 17.1 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen dem Teilnehmer in Rechnung gestellt.

Sollte eine Geschäftsaufhebung nicht mehr möglich sein, wird Eurex Clearing den Verstoß mit einer Vertragsstrafe in Höhe von EUR 1.000 gemäß Ziffer 17.1 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen ahnden.

8. Weiterführende Informationen

Weiterführende Informationen zur Eingabe eines „Trade at Index Close“-Geschäfts im EFPI-Trade Entry-Fenster werden rechtzeitig zum Produktstart auf der Eurex-Website www.eurexchange.com veröffentlicht.

15. Mai 2014

clear to trade

e u r e x c l e a r i n g
rundschreiben 059/14

Datum: 15. Mai 2014
Empfänger: Alle Clearing Mitglieder der Eurex Clearing AG, alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich AG und Vendoren
Autorisiert von: Heike Eckert

Exchange for Physicals-Funktionalität für Indexprodukte (EFPI): Eingabemöglichkeit von Geschäften mit Referenz zum Indexschlusspreis zuzüglich Basis

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 098/14

Kontakt: Derivatives Clearing, T +49-69-211-1 12 50, clearing@eurexclearing.com,
Risk Control, T +49-69-211-1 24 52, risk@eurexclearing.com

Zielgruppe:

Ü Alle Abteilungen

Anhänge:

1. Geänderte Abschnitte der Bedingungen für die Nutzung der OTC-Trade-Entry-Funktionalitäten (Allgemeine Teilnahmebedingungen)
2. Nur in englischer Sprache: Eingabezeiten eines „Trade at Index Close“ (TAIC)-Geschäfts in Verbindung mit § 3.4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „Clearing von OTC-Geschäften“

Zusammenfassung:

Mit Wirkung zum **2. Juni 2014** erweitert Eurex Clearing das Angebot der Exchange for Physicals (für Index-Futures)-Funktionalität (EFPI) um die Eingabemöglichkeit von Geschäften mit Referenz zum Indexschluss-preis zuzüglich Basis („Trade at Index Close“).

Dieses Rundschreiben enthält Informationen zum Clearing der „Trade at Index Close“-Geschäfte sowie die geänderten Abschnitte der Bedingungen für die Nutzung der OTC-Trade-Entry-Funktionalitäten (Allgemeine Teilnahmebedingungen) der Eurex Clearing AG. Weitere Informationen zum Handel in den neuen „Trade at Index Close“-Geschäften sind dem Eurex-Rundschreiben 098/14 zu entnehmen.

Exchange for Physicals-Funktionalität für Indexprodukte (EFPI): Eingabemöglichkeit von Geschäften mit Referenz zum Indexschlusspreis zuzüglich Basis

Mit Wirkung zum 2. Juni 2014 erweitert Eurex Clearing das Angebot der Exchange for Physicals (für Index-Futures)-Funktionalität (EFPI) um die Eingabemöglichkeit von Geschäften mit Referenz zum Indexschluss-preis zuzüglich Basis („Trade at Index Close“).

Dieses Rundschreiben enthält Informationen zum Clearing der „Trade at Index Close“-Geschäfte sowie die geänderten Abschnitte der Bedingungen für die Nutzung der OTC-Trade-Entry-Funktionalitäten (Allgemeine Teilnahmebedingungen) der Eurex Clearing AG. Weitere Informationen zum Handel in den neuen „Trade at Index Close“-Geschäften sind dem Eurex-Rundschreiben 098/14 zu entnehmen.

1. „Trade at Index Close“-Transaktion

Zwei Teilnehmer, die sich auf den Geschäftsabschluss eines Aktienindexfuture mit der Maßgabe geeinigt haben, dass die Preisfestlegung mit Referenz zum zukünftigen Schlusspreis des zugrundeliegenden Index plus Basis („garantierter Preis”) erfolgt, können dieses Geschäft über die EFPI Trade Entry-Funktionalität eingeben, sofern sich das Geschäft als „Trade at Index Close“ qualifiziert.

2. Beschreibung der Kennzeichnungspflichten eines „Trade at Index Close“-Geschäfts im EFPI-Trade-Entry-Window im Zusammenhang mit § 8.2 der Allgemeinen Teilnahme-bedingungen „Exchange for Physicals-Funktionalität für Indexprodukte (EFPI)“

2.1. Im Feld „RefID“ des EFPI-Trade Entry-Fensters

2.1.1. Angabe, dass es sich bei dem Geschäft um einen „Trade at Index Close“ handelt (Abkürzung: „TAIC“)

2.1.2. Angabe der Transaktionsnummer (TranNo; Abkürzung „TRAN“) von zusammengehörigen Geschäften eines Produktes im Fall der Aufteilung dieser Geschäfte

2.2. Im Feld „MlOrdNo/Text 3” des EFPI-Trade Entry-Fensters

Angabe der vereinbarten Basis.

3. Eingabezeiten eines „Trade at Index Close“-Geschäfts im Zusammenhang mit § 3.4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „Clearing von OTC-Geschäften“

Die Geschäftseingabe hat zu erfolgen, wenn der nächste offizielle Schlusspreis des zugrundeliegenden Index verfügbar ist:

I. Regelfall

Feststellung des Indexschlusspreises erfolgt bis 17:50 Uhr MEZ: Die Eingabe der Geschäfte hat bis spätestens 18:15 Uhr MEZ des aktuellen Handelstages zu erfolgen.

II. Zulässige Ausnahmen

a. Feststellung des Indexschlusspreises erfolgt grundsätzlich nach 17:50 Uhr MEZ: Die Eingabe der Geschäfte hat bis spätestens 09:15 Uhr MEZ am nachfolgenden Handelstag zu erfolgen.
b. Feststellung des Indexschlusspreises erfolgt ausnahmsweise nach 17:50 Uhr MEZ aber vor Handelsschluss: Die Eingabe der Geschäfte hat spätestens 15 Minuten nach Veröffent-lichung des Indexschlusspreises zu erfolgen.
c. Feststellung des Indexschlusspreises erfolgt ausnahmsweise nach 17:50 Uhr MEZ aber nach Handelsschluss: Die Eingabe der Geschäfte hat bis spätestens 09:15 Uhr MEZ am nach-folgenden Handelstag zu erfolgen.

Bitte entnehmen Sie die Eingabezeiten der einzelnen Produkte dem Anhang 2.

4. Eingabe von „Trade at Index Close“-Geschäften im Zusammenhang mit § 9.2 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „EFPI-Trade-Funktionalität“ zugelassenen Produkte

Für die Eingabe von „Trade at Index Close“-Geschäften werden alle zur EFPI-Trade-Funktionalität zugelassenen Produkte einbezogen

5. Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte eines „Trade at Index Close“-Geschäfts im Zusammenhang mit § 9.4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „Block Trade-Funktionalität“

Die Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte für Futures-Geschäfte, die Bestandteil eines EFPI-„Trade at Index Close“ sind, beträgt ein Zehntel der für Block Trades in dem jeweiligen Index-Future festgelegten Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte.

6. Pflichten des Teilnehmers zum Nachweis des Vorliegens der Voraussetzungen eines Trade at Index Close im Zusammenhang mit § 4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen „Nachweis des Basisinstrumentes bei Nutzung der EFP, EFPI-Trade-Funktionalität und der EFS-Trade-Funktionalität“

Die Einhaltung der Kriterien bezüglich Minimum Block Trade Size, Preis, Kennzeichnungspflicht und Eingabezeitpunkt wird auf täglicher Basis stichprobenartig überwacht.

Weiterhin werden wöchentlich Detailprüfungen für ausgewählte Geschäfte vorgenommen. Bei dieser Detailprüfung wird der Teilnehmer gebeten, für die entsprechenden Geschäfte einen Nachweis gemäß § 4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen zu erbringen.

Der Nachweis muss den garantierten Preis sowie den Zusammenhang mit dem jeweiligen offiziellen Schlusspreis des zugrundeliegenden Indexes ausweisen und kann per Fax oder E-Mail erfolgen.

7. Nichtlieferung von Nachweisen über die zugrundeliegenden Geschäfte bei EFPI-Geschäften

Sollte der Teilnehmer seine Nachweispflicht gemäß § 4 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen nicht erbringen, kann Eurex Clearing das entsprechende Geschäft aufheben. Erfolgt die Aufhebung des Geschäfts, werden die Kosten der Aufhebung in Höhe von EUR 100 gemäß § 17.1 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen dem Teilnehmer in Rechnung gestellt.

Sollte eine Geschäftsaufhebung nicht mehr möglich sein, wird Eurex Clearing den Verstoß mit einer Vertragsstrafe in Höhe von EUR 1.000 gemäß § 17.1 der Allgemeinen Teilnahmebedingungen ahnden.

8. Änderungen der Allgemeinen Teilnahmebedingungen

Bitte entnehmen Sie die relevanten Änderungen der Allgemeinen Teilnahmebedingungen dem Anhang 1.

Ab dem 2. Juni 2014 werden die geänderten Allgemeinen Teilnahmebedingungen zum Download auf der Webseite der Eurex Clearing AG www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link verfügbar sein:

Ressourcen > Regelwerke > Bedingungen für die Nutzung der OTC-Trade-Entry-Funktionalitäten

15. Mai 2014

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

2.2. Exchange for Physicals (for Index Futures) Trades

2.2.1 Mit der Exchange for Physicals (for Index Futures) Trade („EFPI“) - Funktionalität wird Teilnehmern die Möglichkeit eröffnet, nach dem außerbörslichen Abschluss von Kassageschäften gemäß Ziffer 11 auf eigene Rechnung oder auf Rechnung von Kunden über den Kauf eines Kaufgegenstandes gemäß Ziffer 11 und den gleichzeitigen Verkauf von Index-Futures-Kontrakten, und umgekehrt, die Futures-Kontrakte gemäß den nachfolgenden Bestimmungen mittels eines an die Teilnehmerschnittstelle zu sendenden Requests in das Eurex® Clearing-System der Eurex Clearing AG (nachstehend „Eurex Clearing-System“) einzugeben und clearen zu lassen.

Grundsätzlich sind in diesem Zusammenhang folgende Konstellationen zur Eingabe vorgesehen:

2.2.1.1 Klassische EFPI Geschäfte

- Zwei Teilnehmer schließen sowohl das außerbörsliche Kassageschäft, als auch das Futures Geschäft miteinander ab, oder
- Zwei Teilnehmer schließen das Futures Geschäft miteinander ab. Ein Teilnehmer ist offizieller Exchange Traded Fund (ETF) Market Maker („Authorised Participant“) und schließt das entsprechende Kassageschäft mit dem ETF Emittenten ab. Der zweite Teilnehmer schließt das entsprechende Kassageschäft mit einem oder mehreren (Auktion) Dritten ab
- Die von den Vertragsparteien eines Futures Geschäfts jeweils abgeschlossenen Kassageschäfte müssen sich nicht auf einen identischen Geschäftsgegenstand beziehen. Dabei muss aber jedes Geschäft die Voraussetzungen der Ziffer 11 erfüllen.

2.2.1.2 Trade at Index Close

- Zwei Teilnehmer schließen ein Futures Geschäft gemäß Ziffer 11.1 basierend auf dem nächstverfügbaren offiziellen Schlusspreis des zugrundeliegenden Indexes zuzüglich Basis („garantierter Preis“) miteinander ab.

Die Eurex Clearing AG kann in die EFPI-Trade-Funktionalität weitere Kontrakte

einbeziehen oder einbezogene Kontrakte zukünftig ausschließen. Eine Kombination von zwei Futures Geschäften des gleichen Produkts ist zulässig.

2.2.2 Hat sich ein Teilnehmer auf eigene Rechnung oder im Auftrag eines Kunden mit einem anderen Teilnehmer oder mit einem weiteren Kunden außerbörslich über den Kauf/Verkauf eines Futures-Kontraktes und den gleichzeitigen Verkauf/Kauf eines Kaufgegenstandes gemäß Ziffer 11 geeinigt und entsprechen die Merkmale des Futures-Kontraktes den Kontraktspezifikationen in den Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich in ihrer jeweils gültigen Fassung (nachstehend die „Eurex Kontraktspezifikationen"), liegt ein „EFPI"-Geschäft im Sinne dieser Allgemeinen Teilnahmebedingungen vor, sofern die Eurex Clearing AG den Futures-Kontrakt gemäß Ziffer 9.2 zur EFPI-Trade-Funktionalität zugelassen hat. Zudem muss der Kontraktpreis von EFPI-Geschäften die Anforderungen gemäß Ziffer 5 dieser Allgemeinen Teilnahmebedingungen erfüllen. Zur Klarstellung, Futures Geschäfte im Rahmen eines Trade at Index Close stellen EFPI Geschäfte dar, ungeachtet dessen, dass nur ein Teilnehmer an dem entsprechenden Kassageschäft beteiligt sein kann.

[…]

4 Nachweis des Basisinstrumentes bei Nutzung der EFP, EFPI-Trade-Funktionalität und der EFS-Trade-Funktionalität

4.1 Teilnehmer, die die EFP-, beziehungsweise EFPI-Trade-Funktionalität oder die EFS-Trade-Funktionalität nutzen, sind verpflichtet, der Eurex Clearing AG gegenüber nachzuweisen, dass den für sie geclearten Futures-Kontrakten ein gegenläufiges Grundgeschäft über eines der gemäß Ziffer 10-12 festgelegten Basisinstrumente zugrunde liegt. Diese Nachweispflicht gilt bei einem Trade at Index Close nicht.

Der Teilnehmer hat geeignete Vorkehrungen zu treffen um sicherzustellen, dass die ausführende Partei des gegenläufigen Grundgeschäftes der Nachweispflicht nachkommen kann.

Teilnehmer, die die EFPI-Trade-Funktionalität für einen Trade at Index Close nutzen, sind verpflichtet, der Eurex Clearing AG gegenüber das Vorliegen der Voraussetzungen eines Trade at Index Close in Bezug auf das Futures Geschäft nachzuweisen.

4.2 Im Rahmen der EFP-Trade-Funktionalität, der EFPI-Trade-Funktionalität und der EFS-Trade Funktionalität erfüllt der Teilnehmer seine Nachweispflicht gemäß Ziffer 4.1 in Bezug auf das gegenläufige Grundgeschäft, wenn er auf Anforderung der Eurex Clearing AG eine Bestätigung über den Abschluss eines entsprechenden gegenläufigen Grundgeschäfts über eines der gemäß Ziffer 10-12 festgelegten Basisinstrumente vorlegt. Aus der Bestätigung (z.B. Snapshot aus dem Front- oder Backoffice-System) muss der Zusammenhang zwischen dem ~~gegenläufiges~~ gegenläufigen Grundgeschäft über das jeweilige Basisinstrument und dem entsprechenden Futuresgeschäft ersichtlich sein.

Bei Futures Geschäften im Rahmen eines Trade at Index Close erfüllt der Teilnehmer seine Nachweispflicht gemäß Ziffer 4.1 in Bezug auf das Vorliegen der Voraussetzungen eines Trade at Index Close, wenn er auf Anforderung der Eurex Clearing AG eine Bestätigung über den Abschluss eines dem jeweiligen Future Geschäfts zugrunde-liegenden Trade at Index Close Geschäfts vorlegt. Aus der Bestätigung (z.B. Snapshot aus dem Front- oder Backoffice-System) muss der garantierte Preis sowie der Zusammenhang mit dem jeweiligen offiziellen Schlusspreis des zugrundeliegenden Indexes ersichtlich sein.

Der jeweilige Nachweis ist auf Verlangen der Eurex Clearing AG unverzüglich zu erbringen, spätestens aber bis zum Ende des Tages an dem die Eurex Clearing AG den Nachweis verlangt.

4.3 Erfüllt der Teilnehmer seine Nachweispflicht gemäß Ziffer 4.1 und 4.2 nicht, kann die Eurex Clearing AG das entsprechende OTC-Geschäft aufheben. Die Aufhebung erfolgt gemäß Ziffer 13.3 Absatz 1. Die Kosten der Aufhebung werden den Teilnehmern gemäß Ziffer 13.4 in Rechnung gestellt.

4.4 Wird ein Geschäft in Futures-Kontrakten gemäß Ziffer 3.6 dieser Allgemeinen Teilnahmebedingungen an einen anderen Teilnehmer übertragen, geht auch die Verpflichtung zum Nachweis des Kassageschäftes auf den anderen Teilnehmer über.

[…]

5 Kontraktpreis von OTC-Geschäften

[…]

5.7 Für EFPI-Futures Geschäfte im Rahmen eines Trade at Index Close gemäß Ziffer 2.2.1.2 muss der Kontraktpreis aus dem nächstverfügbaren offiziellen Schlusspreis des zugrundeliegenden Indexes zuzüglich Basis bestehen. Die ~~ssdie~~ Basis muss stets aus einer fixen Zahl bestehen und die Preisgestaltung der Transaktion muss deutlich und zweifelsfrei sein.

5.8~~7~~ Wird ein Geschäft in Futures-Kontrakten gemäß Ziffer 3.6 dieser Allgemeinen Teilnahmebedingungen an einen anderen Teilnehmer übertragen, geht auch die Verpflichtung zum Nachweis des zugrundeliegenden Grundgeschäftes auf den anderen Teilnehmer über.

[…]

8 Pflichtangaben

[…]

8.2. EFPI-Trade-Funktionalität (OTC EFPI-Trade-Entry-Window)

8.2.1 Der Käufer von Index-Futures-Kontrakten hat bei deren Eingabe in das Eurex Clearing-System mittels der EFPI-Trade-Funktionalität im Falle des Kaufes von Aktienindex-Futures-Kontrakten und Volatilitätsindex-Futures-Kontrakten

- den gehandelten Futures-Kontrakt (Instrument, Verfallmonat und -jahr)
- den Kontraktpreis
- die Kontraktanzahl
- die Referenznummer des Aktienkorbes oder börsengehandelten Indexfondsanteils
- den Marktwert des Aktienkorbes oder börsengehandelten Indexfondsanteils
- den Kontraktwert der Futures Position
- die Benutzerkennung des Händlers des Käufers für das System der Eurex-Börsen
- den Open-/Close-Code
- das Positionskonto
- die Settlement-Institution und
- die Benutzerkennung des Verkäufers für das System der Eurex-Börsen

sowie im Falle des Kaufes von Agrarindex-Futures-Kontrakten

- den gehandelten Futures-Kontrakt (Instrument, Verfallmonat und -jahr)
- den Kontraktpreis
- die Kontraktanzahl
- das Kassamarktprodukt, den Liefertermin und den Lieferort
- das Volumen des Kassageschäftes (nominal), welches dem gegenläufigen Futures-Geschäft zu Grunde liegt
- die Benutzerkennung des Händlers des Käufers für das System der Eurex-Börsen
- den Open-/Close-Code
- das Positionskonto
- die Settlement-Institution und
- die Benutzerkennung des Verkäufers für das System der Eurex-Börsen.

einzugeben.

Sowie im Falle des Kaufes von Aktienindex-Futures-Kontrakten im Rahmen eines Trade at Index Close im Feld „RefID“ der Eingabemaske

- Kennzeichnung, dass es sich um ein Futures Geschäft im Rahmen eines Trade at Index Close handelt und
- die Referenznummer (TranNo) von zusammengehörigen Geschäften im Fall der Aufteilung auf mehrere Futures Geschäfte des gleichen Produktes

und im Feld „Text 3“ der Eingabemaske

- die im Rahmen des garantierten Preises vereinbarte Basis

[…]

11. Kassageschäft im Rahmen der EFPI-Trade-Funktionalität

11.1 Aktienindex-Futures-Kontrakte

Von der Eurex Clearing AG wurden folgende Kombinationen von Basisinstrumenten, und Aktienindex-Futures-Kontrakten zugelassen:

Zugelassene Basisinstrumente (Reportende Transaktion)	Positionserzeugende Transaktion
Aktienkorb	Eurex Aktienindex Futures
Börsengehandelter Indexfondsanteil	Eurex Aktienindex Futures

Kassageschäfte, die Bestandteil eines EFPI-Geschäfts gemäß Ziffer 2.2 sind, müssen die nachfolgend genannten Voraussetzungen erfüllen.

Die Kontraktanzahl der gehandelten Futures-Kontrakte muss sich in einem bestimmten Verhältnis zum Marktwert des Aktienkorbes oder börsengehandelten Indexfondsanteils befinden. Der Marktwert des Aktienkorbes oder börsengehandelten Indexfondsanteils hat mindestens ein Drittel des Gegenwertes des Mindestgeschäftsvolumens eines Block-Handelsgeschäftes in dem jeweiligen Indexfuture (d.h. Indexstand x Kontraktwert x Mindestabschlussgröße für Blocktrades / 3) zu betragen und darf gegenüber dem Kontraktwert der Futures-Position um maximal 20 Prozent abweichen. Die Anforderungen an den Marktwert des Aktienkorbes oder des börsengehandelten Indexfondsanteils gilt nicht bei einem Trade at Index Close.

Der Aktienkorb oder börsengehandelte Indexfondsanteil hat sich aus mindestens zehn verschiedenen Indexkomponenten oder einer Anzahl von Aktientiteln, die mindestens die Hälfte des dem Futures-Kontrakt zugrunde liegenden Aktienindex repräsentieren, zusammenzusetzen. Der Marktwert des Teils des Aktienkorbes oder börsengehandelten Indexfondsanteils, dessen Werte Bestandteil des dem Futures-Kontrakt zugrunde liegenden Aktienindex sind, muss mindestens 20 Prozent des Marktwertes des gesamten Kassageschäftes betragen. Sämtliche im Aktienkorb oder börsengehandelten Indexfondsanteils befindlichen Aktienwerte müssen Bestandteil des STOXX® Europe TMI Index, des Dow Jones Global Titans 50SM Index, der Dow Jones Sector Titans Indices, des MSCI World Index, des MSCI Emerging Markets Index, des MSCI Frontier Markets Index, des RDX® USD Index oder des Sensex Index sein.

Die Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte für Futures Geschäfte, die Bestandteil eines EFPI-Geschäfts gemäß Ziffer 2.2.1.2 Trade at Index Close sind, beträgt ein Zehntel der für Block-Trades in dem jeweiligen Indexfuture festgelegten Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte -gemäß Ziffer 9.4.

[…]

Entry times of a "Trade at Index Close" (TAIC) trade in connection with § 3.4 of the General Conditions for Participation "Clearing of OTC trades"

Product ID	Product Long Name	Product ISIN	Currency	TAIC Deadline - for Trade Entry
F2MX	FUT ON MDAX	DE000A0BRCY6	EUR	18:15 CET
FATF	FUT ON ATX FIVE INDEX	DE000A1YD5L7	EUR	18:15 CET
FATX	FUT ON ATX INDEX	DE000A1YD5K9	EUR	18:15 CET
FCEE	FUT ON CECE EUR	DE000A1YD5M5	EUR	18:15 CET
FDAX	FUT ON DAX INDEX	DE0008469594	EUR	18:15 CET
FDIV	FUT ON DIVDAX	DE000A0SNKW6	EUR	18:15 CET
FEDV	FUT ON EURO STOXX SEL.DIV 30	DE000A0ME643	EUR	18:15 CET
FESA	FUT ON EURO STOXX AUTOM.&PARTS	DE0005303648	EUR	18:15 CET
FESB	FUT ON EURO STOXX BANKS	DE0005705651	EUR	18:15 CET
FESC	FUT ON EURO STOXX CHEMICALS	DE0002272028	EUR	18:15 CET
FESE	FUT ON EURO STOXX OIL & GAS	DE0005303655	EUR	18:15 CET
FESF	FUT ON EURO STOXX FIN.SERVICES	DE0007200743	EUR	18:15 CET
FESG	FUT ON EURO STOXX IND.GOODS&SE	DE0002271152	EUR	18:15 CET
FESH	FUT ON EURO STOXX HEALTHCARE	DE0005705669	EUR	18:15 CET
FESI	FUT ON EURO STOXX INSURANCE	DE0005303663	EUR	18:15 CET
FESL	FUT ON EURO STOXX REAL EST.	DE000A0V8N36	EUR	18:15 CET
FESM	FUT ON EURO STOXX MEDIA	DE0007200735	EUR	18:15 CET
FESN	FUT ON EURO STOXX CONSTR.&MAT.	DE0002271194	EUR	18:15 CET
FESO	FUT ON EURO STOXX FOOD&BEVER.	DE0002271160	EUR	18:15 CET
FESR	FUT ON EURO STOXX RETAIL	DE0002271137	EUR	18:15 CET
FESS	FUT ON EURO STOXX BASIC RES.	DE0002272036	EUR	18:15 CET
FEST	FUT ON EURO STOXX TELECOMM.	DE0005705685	EUR	18:15 CET
FESU	FUT ON EURO STOXX UTILITIES	DE0007200727	EUR	18:15 CET
FESV	FUT ON EURO STOXX TRAVEL& LEI.	DE0002271186	EUR	18:15 CET
FESX	FUT ON EURO STOXX 50	DE0009652388	EUR	18:15 CET
FESY	FUT ON EURO STOXX TECHNOLOGY	DE0005705677	EUR	18:15 CET
FESZ	FUT ON EURO STOXX PERS& HOUSE	DE0002271145	EUR	18:15 CET
FEXF	FUT ON EURO STOXX 50 EX FIN	DE000A1PHPP5	EUR	18:15 CET
FFOX	FUT ON OMX HELSINKI 25 INDEX	DE000A0G86R0	EUR	18:15 CET
FGSB	FUT ON DJ BNKS TTNS 30	DE000A0V8NY5	USD	09:15 CET (t+1)
FGSE	FUT ON DJ OILGAS TTNS30	DE000A0V8NZ2	USD	09:15 CET (t+1)
FGSI	FUT ON DJ INS TTNS 30	DE000A0V8N02	USD	09:15 CET (t+1)
FGST	FUT ON DJ TELE TTNS 30	DE000A0V8N10	USD	09:15 CET (t+1)
FGSU	FUT ON DJ UTIL TTNS 30	DE000A0V8N28	USD	09:15 CET (t+1)
FLCE	FUTURE ON ESTX LARGE	DE000A1DKQG2	EUR	18:15 CET
FLCP	FUTURE ON STXE LARGE 200 (50 E	DE000A1DKQL2	EUR	18:15 CET
FMAS	FUT ON MSCI ASIA-P EX JP (NTR)	DE000A1RRXL3	USD	09:15 CET (t+1)
FMCE	FUTURE ON ESTX MID	DE000A1DKQH0	EUR	18:15 CET
FMCL	FUT ON MSCI CHILE (NTR	DE000A1XQ6U2	USD	09:15 CET (t+1)
FMCN	FUT ON MSCI CHINA FREE (NTR)	DE000A1XQ6V0	USD	09:15 CET (t+1)
FMCO	FUT ON MSCI COLOMBIA (NTR)	DE000A1XQ6W8	USD	09:15 CET (t+1)
FMCP	FUTURE ON STXE MID 200 (50 EUR	DE000A1DKQM0	EUR	18:15 CET
FMCZ	FUT ON MSCI CZECH REP. (NTR)	DE000A1XQ6X6	USD	09:15 CET (t+1)
FMEA	FUT ON MSCI EM ASIA (NTR)	DE000A1XQ6R8	USD	09:15 CET (t+1)
FMEE	FUT ON MSCI EM EMEA (NTR)	DE000A1XQ6S6	USD	09:15 CET (t+1)
FMEG	FUT ON MSCI EUROPE GROWTH	DE000A1YDP11	EUR	09:15 CET (t+1)
FMEL	FUT ON MSCI EM LATIN AM. (NTR)	DE000A1XQ6T4	USD	09:15 CET (t+1)
FMEM	FUT ON MSCI EMERG. M.(NTR,USD)	DE000A1XQ6Q0	USD	09:15 CET (t+1)
FMEN	FUT ON MSCI EM. MA (NTR, EUR)	DE000A11Q349	EUR	09:15 CET (t+1)
FMEP	FUT ON MSCI EUR. (PRICE, EUR)	DE000A11Q323	EUR	09:15 CET (t+1)
FMEU	FUT ON MSCI EUROPE (NTR,EUR)	DE000A1RRXG3	EUR	09:15 CET (t+1)
FMEV	FUT ON MSCI EUROPE VALUE	DE000A1YDPZ5	EUR	09:15 CET (t+1)
FMEY	FUT ON MSCI EGYPT (NTR)	DE000A1XQ6Y4	USD	09:15 CET (t+1)

Entry times of a "Trade at Index Close" (TAIC) trade in connection with § 3.4 of the General Conditions for Participation "Clearing of OTC trades"

Product ID	Product Long Name	Product ISIN	Currency	TAIC Deadline - for Trade Entry
FMFM	FUT ON MSCI FRONTIER M. (NTR)	DE000A1RRXN9	USD	09:15 CET (t+1)
FMHU	FUT ON MSCI HUNGARY (NTR)	DE000A1XQ6Z1	USD	09:15 CET (t+1)
FMIN	FUT ON MSCI INDIA (NTR)	DE000A1XQ600	USD	09:15 CET (t+1)
FMJP	FUT ON MSCI JAPAN (NTR)	DE000A1A4130	USD	09:15 CET (t+1)
FMMA	FUT ON MSCI MOROCCO (NTR)	DE000A1XQ634	USD	09:15 CET (t+1)
FMMX	FUT ON MSCI MEXICO (NTR)	DE000A1XQ626	USD	09:15 CET (t+1)
FMMY	FUT ON MSCI MALAYSIA (NTR)	DE000A1XQ618	USD	09:15 CET (t+1)
FMPE	FUT ON MSCI PERU (NTR)	DE000A1XQ642	USD	09:15 CET (t+1)
FMPH	FUT ON MSCI PHILIPPINES (NTR)	DE000A1XQ659	USD	09:15 CET (t+1)
FMPL	FUT ON MSCI POLAND (NTR)	DE000A1XQ667	USD	09:15 CET (t+1)
FMRS	FUT ON MSCI RUSSIA (NTR)	DE000A1XQ675	USD	09:15 CET (t+1)
FMRU	FUT ON MSCI RUSSIA (PRICE)	DE000A1KQVP5	USD	09:15 CET (t+1)
FMTH	FUT ON MSCI THAILAND (NTR)	DE000A1XQ691	USD	09:15 CET (t+1)
FMWN	FUT ON MSCI WORLD (NTR, EUR)	DE000A11Q364	EUR	09:15 CET (t+1)
FMWO	FUT ON MSCI WORLD (NTR,USD)	DE000A1RRXJ7	USD	09:15 CET (t+1)
FMWP	FUT ON MSCI WORLD (PRICE, USD)	DE000A11Q356	USD	09:15 CET (t+1)
FMZA	FUT ON MSCI SOUTH AFRICA (NTR)	DE000A1XQ683	USD	09:15 CET (t+1)
FRDE	FUT ON RDX EUR	DE000A1YD5N3	EUR	18:15 CET
FRDX	FUT ON RDX INDEX	DE000A1N5H40	USD	18:15 CET
FSCE	FUTURE ON ESTX SMALL	DE000A1DKQJ6	EUR	18:15 CET
FSCP	FUTURE ON STXE SMALL 200 (50 E	DE000A1DKQN8	EUR	18:15 CET
FSLI	FUT ON SLI	DE000A0QZD69	CHF	18:15 CET
FSMI	FUT ON SWISS MARKET INDEX	CH0008616432	CHF	18:15 CET
FSMM	FUT ON SMIM	DE000A0E4RE8	CHF	18:15 CET
FSTA	FUT ON STOXX E 600 AUTO&P	DE000A0DMX08	EUR	18:15 CET
FSTB	FUT ON STOXX E 600 BANKS	DE0005705610	EUR	18:15 CET
FSTC	FUT ON STOXX E 600 CHEMIC.	DE000A0DMX16	EUR	18:15 CET
FSTE	FUT ON STOXX E 600 OIL & GAS	DE000A0AEU04	EUR	18:15 CET
FSTF	FUT ON STOXX E 600 FIN SERV	DE000A0AEUY8	EUR	18:15 CET
FSTG	FUT ON STOXX E 600 INDUS GO&S	DE000A0AEU38	EUR	18:15 CET
FSTH	FUT ON STOXX E 600 HEALTHCARE	DE0005705628	EUR	18:15 CET
FSTI	FUT ON STOXX E 600 INSURANCE	DE0002272085	EUR	18:15 CET
FSTL	FUT ON STOXX E 600 REAL EST.	DE000A0V8N44	EUR	18:15 CET
FSTM	FUT ON STOXX E 600 MEDIA	DE000A0AEU20	EUR	18:15 CET
FSTN	FUT ON STOXX E 600 CONST&MAT	DE000A0DMX24	EUR	18:15 CET
FSTO	FUT ON STOXX E 600 FOOD&BEVE.	DE000A0AEU12	EUR	18:15 CET
FSTR	FUT ON STOXX E 600 RETAIL	DE000A0DMXX1	EUR	18:15 CET
FSTS	FUT ON STOXX E 600 BASIC RES.	DE000A0AEUZ5	EUR	18:15 CET
FSTT	FUT ON STOXX E 600 TELECOMM.	DE0005705644	EUR	18:15 CET
FSTU	FUT ON STOXX E 600 UTILITIES	DE0002272077	EUR	18:15 CET
FSTV	FUT ON STOXX E 600 TRAV. & L.	DE000A0DMXY9	EUR	18:15 CET
FSTX	FUT ON STOXX EUROPE 50	DE0009652362	EUR	18:15 CET
FSTY	FUT ON STOXX E 600 TECHNOLOGY	DE0005705636	EUR	18:15 CET
FSTZ	FUT ON STOXX E 600 PER&HOUSE	DE000A0DMXZ6	EUR	18:15 CET
FT50	FUT ON DJGT 50 USD	DE000A0V8NX7	USD	09:15 CET (t+1)
FTDX	FUT ON TECDAX	DE0002270287	EUR	18:15 CET
FXXE	FUTURE ON EURO STOXX	DE000A1DKQF4	EUR	18:15 CET
FXXP	FUTURE ON STXE 600 (50 EUR)	DE000A1DKQK4	EUR	18:15 CET

Entry times of a "Trade at Index Close" (TAIC) trade in connection with § 3.4 of the General Conditions for Participation "Clearing of OTC trades"

Product ID	Product Long Name	Product ISIN	Currency	TAIC Deadline - for Trade Entry
F2MX	FUT ON MDAX	DE000A0BRCY6	EUR	18:15 CET
FATF	FUT ON ATX FIVE INDEX	DE000A1YD5L7	EUR	18:15 CET
FATX	FUT ON ATX INDEX	DE000A1YD5K9	EUR	18:15 CET
FCEE	FUT ON CECE EUR	DE000A1YD5M5	EUR	18:15 CET
FDAX	FUT ON DAX INDEX	DE0008469594	EUR	18:15 CET
FDIV	FUT ON DIVDAX	DE000A0SNKW6	EUR	18:15 CET
FEDV	FUT ON EURO STOXX SEL.DIV 30	DE000A0ME643	EUR	18:15 CET
FESA	FUT ON EURO STOXX AUTOM.&PARTS	DE0005303648	EUR	18:15 CET
FESB	FUT ON EURO STOXX BANKS	DE0005705651	EUR	18:15 CET
FESC	FUT ON EURO STOXX CHEMICALS	DE0002272028	EUR	18:15 CET
FESE	FUT ON EURO STOXX OIL & GAS	DE0005303655	EUR	18:15 CET
FESF	FUT ON EURO STOXX FIN.SERVICES	DE0007200743	EUR	18:15 CET
FESG	FUT ON EURO STOXX IND.GOODS&SE	DE0002271152	EUR	18:15 CET
FESH	FUT ON EURO STOXX HEALTHCARE	DE0005705669	EUR	18:15 CET
FESI	FUT ON EURO STOXX INSURANCE	DE0005303663	EUR	18:15 CET
FESL	FUT ON EURO STOXX REAL EST.	DE000A0V8N36	EUR	18:15 CET
FESM	FUT ON EURO STOXX MEDIA	DE0007200735	EUR	18:15 CET
FESN	FUT ON EURO STOXX CONSTR.&MAT.	DE0002271194	EUR	18:15 CET
FESO	FUT ON EURO STOXX FOOD&BEVER.	DE0002271160	EUR	18:15 CET
FESR	FUT ON EURO STOXX RETAIL	DE0002271137	EUR	18:15 CET
FESS	FUT ON EURO STOXX BASIC RES.	DE0002272036	EUR	18:15 CET
FEST	FUT ON EURO STOXX TELECOMM.	DE0005705685	EUR	18:15 CET
FESU	FUT ON EURO STOXX UTILITIES	DE0007200727	EUR	18:15 CET
FESV	FUT ON EURO STOXX TRAVEL& LEI.	DE0002271186	EUR	18:15 CET
FESX	FUT ON EURO STOXX 50	DE0009652388	EUR	18:15 CET
FESY	FUT ON EURO STOXX TECHNOLOGY	DE0005705677	EUR	18:15 CET
FESZ	FUT ON EURO STOXX PERS& HOUSE	DE0002271145	EUR	18:15 CET
FEXF	FUT ON EURO STOXX 50 EX FIN	DE000A1PHPP5	EUR	18:15 CET
FFOX	FUT ON OMX HELSINKI 25 INDEX	DE000A0G86R0	EUR	18:15 CET
FGSB	FUT ON DJ BNKS TTNS 30	DE000A0V8NY5	USD	09:15 CET (t+1)
FGSE	FUT ON DJ OILGAS TTNS30	DE000A0V8NZ2	USD	09:15 CET (t+1)
FGSI	FUT ON DJ INS TTNS 30	DE000A0V8N02	USD	09:15 CET (t+1)
FGST	FUT ON DJ TELE TTNS 30	DE000A0V8N10	USD	09:15 CET (t+1)
FGSU	FUT ON DJ UTIL TTNS 30	DE000A0V8N28	USD	09:15 CET (t+1)
FLCE	FUTURE ON ESTX LARGE	DE000A1DKQG2	EUR	18:15 CET
FLCP	FUTURE ON STXE LARGE 200 (50 E	DE000A1DKQL2	EUR	18:15 CET
FMAS	FUT ON MSCI ASIA-P EX JP (NTR)	DE000A1RRXL3	USD	09:15 CET (t+1)
FMCE	FUTURE ON ESTX MID	DE000A1DKQH0	EUR	18:15 CET
FMCL	FUT ON MSCI CHILE (NTR	DE000A1XQ6U2	USD	09:15 CET (t+1)
FMCN	FUT ON MSCI CHINA FREE (NTR)	DE000A1XQ6V0	USD	09:15 CET (t+1)
FMCO	FUT ON MSCI COLOMBIA (NTR)	DE000A1XQ6W8	USD	09:15 CET (t+1)
FMCP	FUTURE ON STXE MID 200 (50 EUR	DE000A1DKQM0	EUR	18:15 CET
FMCZ	FUT ON MSCI CZECH REP. (NTR)	DE000A1XQ6X6	USD	09:15 CET (t+1)
FMEA	FUT ON MSCI EM ASIA (NTR)	DE000A1XQ6R8	USD	09:15 CET (t+1)
FMEE	FUT ON MSCI EM EMEA (NTR)	DE000A1XQ6S6	USD	09:15 CET (t+1)
FMEG	FUT ON MSCI EUROPE GROWTH	DE000A1YDP11	EUR	09:15 CET (t+1)
FMEL	FUT ON MSCI EM LATIN AM. (NTR)	DE000A1XQ6T4	USD	09:15 CET (t+1)
FMEM	FUT ON MSCI EMERG. M.(NTR,USD)	DE000A1XQ6Q0	USD	09:15 CET (t+1)
FMEN	FUT ON MSCI EM. MA (NTR, EUR)	DE000A11Q349	EUR	09:15 CET (t+1)
FMEP	FUT ON MSCI EUR. (PRICE, EUR)	DE000A11Q323	EUR	09:15 CET (t+1)
FMEU	FUT ON MSCI EUROPE (NTR,EUR)	DE000A1RRXG3	EUR	09:15 CET (t+1)
FMEV	FUT ON MSCI EUROPE VALUE	DE000A1YDPZ5	EUR	09:15 CET (t+1)
FMEY	FUT ON MSCI EGYPT (NTR)	DE000A1XQ6Y4	USD	09:15 CET (t+1)

Entry times of a "Trade at Index Close" (TAIC) trade in connection with § 3.4 of the General Conditions for Participation "Clearing of OTC trades"

Product ID	Product Long Name	Product ISIN	Currency	TAIC Deadline - for Trade Entry
FMFM	FUT ON MSCI FRONTIER M. (NTR)	DE000A1RRXN9	USD	09:15 CET (t+1)
FMHU	FUT ON MSCI HUNGARY (NTR)	DE000A1XQ6Z1	USD	09:15 CET (t+1)
FMIN	FUT ON MSCI INDIA (NTR)	DE000A1XQ600	USD	09:15 CET (t+1)
FMJP	FUT ON MSCI JAPAN (NTR)	DE000A1A4130	USD	09:15 CET (t+1)
FMMA	FUT ON MSCI MOROCCO (NTR)	DE000A1XQ634	USD	09:15 CET (t+1)
FMMX	FUT ON MSCI MEXICO (NTR)	DE000A1XQ626	USD	09:15 CET (t+1)
FMMY	FUT ON MSCI MALAYSIA (NTR)	DE000A1XQ618	USD	09:15 CET (t+1)
FMPE	FUT ON MSCI PERU (NTR)	DE000A1XQ642	USD	09:15 CET (t+1)
FMPH	FUT ON MSCI PHILIPPINES (NTR)	DE000A1XQ659	USD	09:15 CET (t+1)
FMPL	FUT ON MSCI POLAND (NTR)	DE000A1XQ667	USD	09:15 CET (t+1)
FMRS	FUT ON MSCI RUSSIA (NTR)	DE000A1XQ675	USD	09:15 CET (t+1)
FMRU	FUT ON MSCI RUSSIA (PRICE)	DE000A1KQVP5	USD	09:15 CET (t+1)
FMTH	FUT ON MSCI THAILAND (NTR)	DE000A1XQ691	USD	09:15 CET (t+1)
FMWN	FUT ON MSCI WORLD (NTR, EUR)	DE000A11Q364	EUR	09:15 CET (t+1)
FMWO	FUT ON MSCI WORLD (NTR,USD)	DE000A1RRXJ7	USD	09:15 CET (t+1)
FMWP	FUT ON MSCI WORLD (PRICE, USD)	DE000A11Q356	USD	09:15 CET (t+1)
FMZA	FUT ON MSCI SOUTH AFRICA (NTR)	DE000A1XQ683	USD	09:15 CET (t+1)
FRDE	FUT ON RDX EUR	DE000A1YD5N3	EUR	18:15 CET
FRDX	FUT ON RDX INDEX	DE000A1N5H40	USD	18:15 CET
FSCE	FUTURE ON ESTX SMALL	DE000A1DKQJ6	EUR	18:15 CET
FSCP	FUTURE ON STXE SMALL 200 (50 E	DE000A1DKQN8	EUR	18:15 CET
FSLI	FUT ON SLI	DE000A0QZD69	CHF	18:15 CET
FSMI	FUT ON SWISS MARKET INDEX	CH0008616432	CHF	18:15 CET
FSMM	FUT ON SMIM	DE000A0E4RE8	CHF	18:15 CET
FSTA	FUT ON STOXX E 600 AUTO&P	DE000A0DMX08	EUR	18:15 CET
FSTB	FUT ON STOXX E 600 BANKS	DE0005705610	EUR	18:15 CET
FSTC	FUT ON STOXX E 600 CHEMIC.	DE000A0DMX16	EUR	18:15 CET
FSTE	FUT ON STOXX E 600 OIL & GAS	DE000A0AEU04	EUR	18:15 CET
FSTF	FUT ON STOXX E 600 FIN SERV	DE000A0AEUY8	EUR	18:15 CET
FSTG	FUT ON STOXX E 600 INDUS GO&S	DE000A0AEU38	EUR	18:15 CET
FSTH	FUT ON STOXX E 600 HEALTHCARE	DE0005705628	EUR	18:15 CET
FSTI	FUT ON STOXX E 600 INSURANCE	DE0002272085	EUR	18:15 CET
FSTL	FUT ON STOXX E 600 REAL EST.	DE000A0V8N44	EUR	18:15 CET
FSTM	FUT ON STOXX E 600 MEDIA	DE000A0AEU20	EUR	18:15 CET
FSTN	FUT ON STOXX E 600 CONST&MAT	DE000A0DMX24	EUR	18:15 CET
FSTO	FUT ON STOXX E 600 FOOD&BEVE.	DE000A0AEU12	EUR	18:15 CET
FSTR	FUT ON STOXX E 600 RETAIL	DE000A0DMXX1	EUR	18:15 CET
FSTS	FUT ON STOXX E 600 BASIC RES.	DE000A0AEUZ5	EUR	18:15 CET
FSTT	FUT ON STOXX E 600 TELECOMM.	DE0005705644	EUR	18:15 CET
FSTU	FUT ON STOXX E 600 UTILITIES	DE0002272077	EUR	18:15 CET
FSTV	FUT ON STOXX E 600 TRAV. & L.	DE000A0DMXY9	EUR	18:15 CET
FSTX	FUT ON STOXX EUROPE 50	DE0009652362	EUR	18:15 CET
FSTY	FUT ON STOXX E 600 TECHNOLOGY	DE0005705636	EUR	18:15 CET
FSTZ	FUT ON STOXX E 600 PER&HOUSE	DE000A0DMXZ6	EUR	18:15 CET
FT50	FUT ON DJGT 50 USD	DE000A0V8NX7	USD	09:15 CET (t+1)
FTDX	FUT ON TECDAX	DE0002270287	EUR	18:15 CET
FXXE	FUTURE ON EURO STOXX	DE000A1DKQF4	EUR	18:15 CET
FXXP	FUTURE ON STXE 600 (50 EUR)	DE000A1DKQK4	EUR	18:15 CET