

Anhang 1 zu Eurex-Rundschreiben 102/20

Liquiditäts- klasse	Anzahl der Produkte	Größe	Larger Size- Faktor	Spread	Tighter Spread- Faktor	Laufzeitbereich	Basispreis- fenster
1	45 21	Quantitativer Ansatz durch Betrachtung der verfügbaren Liquidität in den zugrunde liegenden Aktien und notierten Optionen	2,0 1,5	10% 20%	0,65/0,75 0,25	8 Verfälle	7 von 15
2	40 75		1,5	10% 20%	0,75/0,80 0,50	8 Verfälle	7 von 15
3	494 423		1,1 1,5	20%	1,0 0,75	6 Verfälle	5 von 7 7 von 15