1. Einführungsdatum

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland hat die folgenden Beschlüsse mit Wirkung zum **29. März 2021** gefasst:

- Einführung von FTSE® 100 Index Total Return-Futures
- Einführung von FTSE® 100 Declared Dividend Index-Futures
- Einführung von FTSE® 100 Index-Futures
- Einführung von FTSE® 100 Index-Optionen

2. Produktüberblick

Eurex-Produkt							
Produktname	**Produkt-ID**	**Währung**	**Indextyp**	**Produkttyp**	**Produkt-ISIN**	**Bloomberg**	**Reuters**
FTSE® 100 Index Total Return Futures	TTUK	GBP	Kombiniert	FINX	DE000A2QNKL9	IUEA Index	.TTUK
FTSE® 100 Declared Dividend Index-Futures	FTDD	GBP	Dividende	FINX	DE000A2QNKK1	IUBA Index	.FTDD
FTSE® 100 Index-Futures	FTUK	GBP	Preis	FINX	DE000A2QNKH7	IUAA Index	.FTUK
FTSE® 100 Index-Optionen	OTUK	GBP	Preis	OINX	DE000A2QNKJ3	UKXEUX	.OTUK

3. Kontraktspezifikationen

FTSE® 100 Index Total Return-Futures

FTSE® 100 Index Total Return-Futures bilden die theoretische Leihe von Geld zum Kauf des Basiswert-Index (d. h. des Basket mit den zugehörigen Aktien) am Handelstag ab. Dabei wird ein Halten bis zum Verfallstag unterstellt. Das bedeutet, dass mit sofortiger Wirkung eine Position in den Aktien des zugrundeliegenden Index aufgebaut wird. Der Halter einer Long-Position erhält daher die Ausschüttungen, die in den zugrundeliegenden Aktien des Basket am Kassamarkt anfallen. Im Gegenzug bezahlt der Halter die Finanzierung im Zusammenhang mit dem Kauf. Die Finanzierungskosten bestehen dabei zum Teil aus dem Overnight-Finanzierungszinssatz und dem festgelegten gehandelten „Spread“. Dies bildet den Spread ab, den der Verkäufer zusätzlich im Zusammenhang mit der Benchmark des Overnight-Finanzierungszinssatzes bis zum Verfallsdatum benötigt.

FTSE® 100 Index Total Return-Futures haben die folgenden Basiswerte:

Basiswerte					
Index	**Währung**	**Indextyp**	**ISIN**	**Bloomberg**	**Refinitiv**
FTSE® 100-Index (UKX)	GBP	Preisindex	GB0001383545	UKX	.FTSE~~UKX~~
FTSE® 100 Cumulative Dividend Points-Index ~~(F2DivCD)~~ (UKXCD)	GBP	DVP-Index	GB00BMDK8W82	UKXCD	.FTUKXCD~~.FT UKXCDS~~
Sterling Overnight Index Average (SONIA)	GBP	Funding Rate	GB00B56Z6W79	SONIO/N	SONIAOSR=

Die wesentlichen Eigenschaften der FTSE® 100 Index Total Return-Futures sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt:

Kontraktspezifikationen	
Kontraktname	**FTSE® 100 Index Total Return-Futures**
Produkt-ID	TTUK
Basiswert-Indizes	FTSE® 100-Index (UKX) FTSE® 100 Cumulative Dividend Points-Index ~~(F2DivCD)~~(UKXCD) Sterling Overnight Index Average (SONIA)
Kontraktmultiplikator	GBP 10,00 pro Indexpunkt
Notierung (TRF-Spread) (Basispunkte)	TRF-Spread als annualisierter Zinssatz, ausgedrückt in Basispunkten mit einer Dezimalstelle (+ / - / 0)
Mindest-TRF-Spread-Änderung (Basispunkte)	+/- 0,5 Basispunkte (1 Basispunkt = 0,0001)
Handelsnotation und Clearing-Notation	Off-Book (TES)-Transaktionen sowie börsliche Transaktionen und Quotes werden im Handelssystem T7 ausschließlich in **Handelsnotation** eingegeben und verwaltet. Ist ein TRF-Spread einmal ausgeführt, wird er in die **Clearing-Notation** konvertiert, bevor er an das Clearing-System C7 übertragen wird.
Geschäftstypen: TAC und TAM	• „Trade at Close“ (TAC) mit einem Indexstand basierend auf dem täglichen Schlussstand des Index. • „Trade at Market“ (TAM) mit einem Indexstand wie von den Börsenteilnehmern vorab festgelegt und eingegeben.
Accrued Distributions und Accrued Funding (Indexpunkte)	Die Zahlungen für die Ausschüttungen und die Funding Rate werden ab dem Handelsstart der Produkte akkumuliert und zur Berechnung des TRF-Futures-Preises in Indexpunkten hinzugerechnet. Tägliche Preisschwankungen bei Ausschüttungen und Zahlungen für das Funding werden in die Variation Margin eingerechnet.
Verfallsmonate	Neun Jahre und elf Monate • Die nächsten 12 Quartalsmonate des März, Juni, September und Dezember-Zyklus und • Die folgenden 7 jährlichen Dezember-Verfälle
Barabrechnung	Barabrechnung, fällig am ersten Abwicklungstag nach dem Schlussabrechnungstag.
Letzter Handelstag	Der Börsenhandelstag an Eurex, der dem Verfallstag unmittelbar vorausgeht.
Verfallstag (Schlussabrechnungs-tag)	Der dritte Freitag jedes Verfallsmonats, wenn dieser ein Börsenhandelstag an Eurex ist, andernfalls der Börsenhandelstag, der diesem unmittelbar vorausgeht.
Schlussabrechnungs-preis (SAPr) (Indexpunkte)	Wird am Verfallstag von Eurex ermittelt und basiert auf den folgenden Bestandteilen: Schlussabrechnungspreis der FTSE® 100 Index-Futures (FTUK), Accrued Distributions und Accrued Funding seit dem Handelsstart der Produkte bis zum Verfallstag.
SAPr des Referenz-Preisindex-Future	Schlussabrechnungspreis der FTSE® 100 Index-Futures (FTUK) am Verfallstag
Tick-Size (kleinste Preisveränderung) des Clearing-Preises (Indexpunkte)	In Indexpunkten zum nächsten 0,01
Mindestgröße für Block Trades	100

Bitte entnehmen Sie Anhang 2 die detaillierten Kontraktspezifikationen.

FTSE® 100 Declared Dividend-Index

Kontraktspezifikationen	
Kontraktname	**FTSE® 100 Declared Dividend-Futures (FTDD)**
Kontraktmultiplikator	GBP 50,00 pro Indexpunkt
Kleinste Preisveränderung	0,1 Indexpunkte
Verfallsmonate	• 4 Halbjahresmonate aus dem Juni- und Dezember-Zyklus und • die folgenden 8 Dezember-Jahresverfälle bis zum Jahr 10
Abrechnung	Barabrechnung, fällig am ersten Handelstag nach dem Schlussabrechnungstag
Letzter Handelstag	Der letzte Handelstag ist der Schlussabrechnungstag. Am letzten Handelstag ist der Handelsschluss für die verfallenden Futures um 12:00 Uhr MEZ.
Schlussabrechnungstag und Verfallstag	Schlussabrechnungstag und Verfallstag ist der dritte Freitag jedes Verfallsmonats, wenn dieser ein Handelstag ist, andernfalls der Handelstag, der diesem unmittelbar vorausgeht.
Schlussabrechnungs-preis (SAPr) in Indexpunkten	Wird am Verfallstag von Eurex ermittelt und basiert auf dem finalen Wert der zugrunde liegenden Indexdividenden, wie vom Indexanbieter berechnet; Dividendenpunkte werden ab dem dritten Freitag im Dezember des vorhergehenden Kalenderjahres (jedoch ausschließlich dieses Tages) bis (und einschließlich) zum Schlussabrechnungstag berechnet.
SAPr des Referenz-Preisindex-Future	Wert des FTSE® 100 Declared Dividend-Index (F1DIVD), wie von FTSE International Ltd berechnet. Dieser bildet den kumulierten Wert am Schlussabrechnungstag der als Stammdividenden definierten Barausschüttungen der einzelnen, zum FTSE 100-Index gehörenden, Unternehmen in Indexpunkten ab.
Mindestgröße für Block Trades (TES / EnLight)	50

FTSE® 100 Index-Futures und -Optionen

Kontraktspezifikationen		
Beschreibung des Basiswerts	FTSE® 100-Index Eine detaillierte Beschreibung des Index und der Indexregeln kann der Website von FTSE Russell www.ftsrussell.com entnommen werden.	
Kontraktname	FTSE® 100 Index-Futures (FTUK)	FTSE® 100 Index-Optionen (OTUK)
Kontraktwert	GBP 10,00 pro Indexpunkt	
Kleinste Preisveränderung	0,5 Indexpunkte (Tick-Wert: GBP 5,00)	
Abrechnung	Barabrechnung, fällig am ersten Handelstag nach dem Schlussabrechnungstag.	
Letzter Handelstag	Der letzte Handelstag ist der Schlussabrechnungstag. Am letzten Handelstag ist der Handelsschluss für die verfallenden Serien um 11:15 Uhr MEZ.	
Schlussabrechnungstag und Verfall	Der dritte Freitag jedes Verfallsmonats, wenn dieser ein Handelstag an Eurex ist, andernfalls der Handelstag, der diesem unmittelbar vorausgeht.	
Schlussabrechnungspreis (SAPr)	Wird am Verfallstag von Eurex ermittelt. Der Indexwert basiert auf dem FTSE 100 Expiry-Index („UKXSP"), wie von FTSE International Limited nach der untertägigen Auktion im Exchange Delivery Settlement Price („EDSP") an der London Stock Exchange berechnet.	
Verfallsmonate	Die vier nächsten Quartalsmonate aus dem März, Juni, September und Dezember-Zyklus.	Neun Jahre und elf Monate: Bis zu und einschließlich der nächsten, zweitnächsten, drittnächsten, viertnächsten, fünftnächsten und sechstnächsten aufeinander folgenden Kalendermonate, und bis zu den nächsten sechs aufeinander folgenden Quartalsverfallstagen (März, Juni, September, Dezember) sowie danach bis zu den nächsten zwei Halbjahresverfallstagen (Juni, Dezember), und bis zu den nächsten sieben aufeinander folgenden Jahresverfallstagen (Dezember)
Ausübungspreis-Intervall	-	≤ 6 Monate: 25; 6-36 Monate: 50; > 36 Monate: 100
Ausübung	-	Europäische Ausübung; eine Option kann nur am Schlussabrechnungstag der jeweiligen Optionsserie bis zum Ende der Post-Trading Full-Periode (19:30 Uhr MEZ) ausgeübt werden.
Mindestgröße für Block Trades (TES / EnLight)	500	500

4. Handelszeiten (MEZ)

Produkt	Produkt-ID	Pre-Trading-Periode	Continuous Trading	Pre-Trading-Periode bis	Off-Book Trading-Periode	Off-Book Post-Trading Periode bis	Letzter Handelstag	
							Handel bis	Ausübung bis
Index Total Return-Futures auf den FTSE® 100	TTUK	10:10-10:15	10:15-17:25	17:25-22:10	10:15-22:00 Trade At Close: (TAC) 10:15-18:00	22:10	17:30	-
FTSE® 100 Index Declared Dividend-Futures	FTDD	07:30-08:30	08:30-22:00	22:10	08:30-22:00	22:10	12:00	-
FTSE® 100 Index-Futures	FTUK	07:30-07:50	07:50-22:00	22:10	08:00-22:00	22:10	11:15	-
FTSE® 100 Index-Optionen	OTUK	07:30-08:50	08:50-17:30	19:30	09:00-19:00	19:15	11:15	19:30

5. Transaktions- und Verwaltungsentgelte

Transaktionsentgelt:

Product / Product Group	Currency	Execution Type	Accounts	Standard Fee per Contract (contract volume ≤ threshold)	Reduced Fee per Contract (contract volume > threshold)	Threshold (number of contracts)
Total Return Futures on FTSE® Indices (TTUK)	GBP	Order book	A	1.00	n. a.	n. a.
			P	1.00	n. a.	n. a.
			M	1.00	n. a.	n. a.
		TES	A	1.00	n. a.	n. a.
			P	1.00	n. a.	n. a.
			M	1.00	n. a.	n. a.
FTSE® 100 Index Declared Dividend Futures (FTDD)	GBP	Order book	A	1.20	n. a.	n. a.
			P	1.20	n. a.	n. a.
			M	1.20	n. a.	n. a.
		Eurex EnLight	A	1.80	n. a.	n. a.
			P	1.80	n. a.	n. a.
			M	1.80	n. a.	n. a.
		TES	A	1.80	n. a.	n. a.
			P	1.80	n. a.	n. a.
			M	1.80	n. a.	n. a.
FTSE® 100 Index Futures (FTUK)	GBP	Order book	A	0.35	n. a.	n. a.
			P	0.30	n. a.	n. a.
			M	0.30	n. a.	n. a.
		Eurex EnLight	A	0.40	n. a.	n. a.
			P	0.35	n. a.	n. a.
			M	0.35	n. a.	n. a.
		TES	A	0.40	n. a.	n. a.
			P	0.35	n. a.	n. a.
			M	0.35	n. a.	n. a.
FTSE® 100 Index Options (OTUK)	GBP	Order book	A	0.33	0.17	3,000
			P	0.30	0.15	2,000
			M	0.30	n. a.	n. a.
		Eurex EnLight	A	0.34	0.17	3,000
			P	0,30	0.15	2,000
			M	0.30	n. a.	n. a.
		TES	A	0.35	0.18	3,000
			P	0.30	0.15	2,000
			M	0.30	n. a.	n. a.

Verwaltungsentgelt:

Für offene Positionen fallen die folgenden täglich berechneten Verwaltungsentgelte an:

Product / Product group	Currency	Accounts	Fee per Contract
Total Return Futures on FTSE® Indices	GBP	A/P	0.004
		M	0.002

Bitte entnehmen Sie weitere Details dem aktuellen Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG (nur in Englisch verfügbar), das auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link abrufbar ist:

Handel > Rules & Regs > Eurex-Regelwerke > Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG

6. Handelskalender

Es gilt der bestehende Handelskalender für das Segment der britischen Aktienderivate, der auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link abgerufen werden kann:

Handel > Handelskalender