X-pand into the Future

e u r e x *circular 009/03*

Date: Frankfurt, January 24, 2003
Recipients: All Eurex members and vendors
Authorized by: Peter Reitz

High Priority

Introduction of Delta-neutral Trading Products (DNTPs) – Further Information

Related Eurex Circulars: 002/03, 006/03

Contact: Michael Durica (Product Development):Tel. +49-69-21 01-59 23

Content may be most important for:

- Front Office / Trading
- Middle + Back Office
- Auditing / Security Coordination

Attachments:

1. Update to the Conditions for Trading at Eurex Deutschland and Eurex Zürich (German only)
2. Updates to the Implementation Regulations for the Handling of Erroneous Entries at Eurex Deutschland and Eurex Zürich (German only)

Summary:

As already announced in Circular 002/03, and 006/03 Eurex will introduce Index and Fixed Income Delta-neutral Trading products on January 27, 2003. Additional information related to the introduction is provided in the Circular under the following headings:

1. **Trading Conditions**
2. **Mistrade Regulations**
3. **DNTP Product Assignment to Broadcast Groups**
4. **DNTP Products Permitted for US Trading**
5. **Correction to Contract Specifications**

Eurex Deutschland
D-60485 Frankfurt am Main
www.eurexchange.com

Functional Member Readiness
Tel. +49-69-2101-1700
Fax +49-69-2101-1701

Alternative
Tel. +49-69-9770-1700
Fax +49-69-9770-1701

Management Board:
Rudolf Ferscha (CEO), Jürg Spillmann,
Daniel Gisler, Thomas Lenz,
Peter Reitz, Michael Widmer

Introduction of Delta-neutral Trading Products (DNTPs) – Further Information

As already announced in Circular 002/03, and 006/03 Eurex will introduce Index and Fixed Income Delta-neutral Trading Products (DNTPs) on **January 27, 2003**. Additional information related to the introduction is provided below:

1. Trading Conditions

The update to section 1.3.1 and the new section 1.3.7 of the Conditions for Trading at Eurex Deutschland and Eurex Zürich are included as Attachment 1. These concern the treatment of orders and quotes for DNTPs. Currently, only the German language version is available; the English version will be published on our web-site under 'market place > rules and regulations > trading conditions' on January 27, 2003.

2. Mistrade Regulations

For DNTP transactions, the reference price used to adjudge a mistrade is the reference price of the options contract, calculated according to the usual method. No reference price is used for the associated futures transaction, since in the event of a mistrade in the option, the futures transaction is also cancelled. The corresponding updates to sections 1.1.2 and 1.2.2 of the mistrade regulations are included as Attachment 2. As with the trading conditions, the English language version will be published on our web-site on January 27, 2003.

3. Broadcast Group Product Assignment for DNTPs

Each DNTP is assigned to the same public broadcast stream group as its underlying options contract, as shown below.

Product ID	Long Name	Broadcast Group
DDAX	*DNTP FDAX ODAX*	C
DEXX	*DNTP FESX OESX*	D
DSOX	*DNTP FSTX OSTX*	D
DLTS	*DNTP FSMI OSMI*	F
DBUN	*DNTP FGBL OGBL*	A
DBOB	*DNTP FGBM OGBM*	A
DSHZ	*DNTP FGBS OGBS*	A

4. DNTP Products Permitted for US Trading

Based on the CFTC approval for the Eurex fixed income products (Options and Futures) the following DNTPs will be enabled for trading by US-based members.

Product ID	Long Name	Future Leg ID	Future Leg Long Name	Option Leg ID	Option Leg Long Name
DBUN	*DNTP FGBL OGBL*	FGBL	*FUT 8½ -10½ Y GOV.BONDS 6%*	OGBL	*OPT ON EURO BUND FUTURE*
DBOB	*DNTP FGBM OGBM*	FGBM	*FUT 4½ -5 ½ Y GOV.BONDS 6%*	OGBM	*OPT ON EURO BOBL FUTURE*
DSHZ	*DNTP FGBS OGBS*	FGBS	*FUT 1¾ -2¼ Y GOV.BONDS 6%*	OGBS	*OPT ON EURO SCHATZ FUTURE*

5. Correction to Contract Specifications

The definition of the last trading day in the contract specifications included in Circular 002/03 was incorrect. The correct definition is as follows:

Last Trading Day

The series available in a DNTP will be available for trading until **one Exchange day before the Last Trading Day** of the underlying options contract.

Frankfurt, January 24, 2003

Eurex Deutschland
D-60485 Frankfurt am Main
www.eurexchange.com

Functional Member Readiness
Tel. +49-69-2101-1700
Fax +49-69-2101-1701

Management Board:
Rudolf Ferscha (CEO), Jürg Spillmann,
Daniel Gisler, Thomas Lenz,
Peter Reitz, Michael Widmer

1 Abschnitt: Allgemeine Vorschriften

1.3 Teilabschnitt: Auftragsarten und deren Ausführung

1.3.1 Arten der Aufträge und Quotes

(1) …

(2) Folgende Quotes können von den Börsenteilnehmern in das System der Eurex-Börsen eingegeben werden:

a. …;

b. …;

c. in Inter-Product-Spreads sowie in Delta-neutralen Produkten Quotes – auch einseitig – von allen Börsenteilnehmern.

(3) …

1.3.7 Aufträge und Quotes über Delta-neutrale Produkte

(1) Aufträge bzw. Quotes über Delta-neutrale Produkte sind Aufträge bzw. Quotes hinsichtlich des Kaufs einer bestimmten Anzahl von Optionskontrakten und dem gleichzeitigen Verkauf einer aus dem Delta des Optionskontraktes abgeleiteten Anzahl von Future-Kontrakten zu einem von den Eurex-Börsen festgesetzten Preis des Future-Kontraktes. Der Future-Kontrakt und der Optionskontrakt beziehen sich stets auf den denselben Basiswert oder der Future-Kontrakt ist Basiswert des Optionskontraktes. Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen legen die als Delta-neutrales Produkt handelbaren Kombinationen von Futures und Optionen, aus denen sich ein Delta-neutrales Produkt zusammensetzt, und eine Preisspanne des Future-Kontraktes, deren Überschreiten zu einer Preisanpassung des Future-Kontraktes führt, fest.

(2) Aufträge oder Quotes über Delta-neutrale Produkte können nur gegen andere Aufträge oder Quotes über dieselben Delta-neutralen Produkte ausgeführt werden. Eine Ausführung von Aufträgen oder Quotes über Delta-neutrale Produkte gegen Aufträge oder Quotes über andere Delta-neutrale Produkte ist nicht möglich.

Zulässige Auftragsarten über Delta-neutrale Produkte sind:

a. unlimitierte Aufträge

b. limitierte Aufträge

(3) Aufträge oder Quotes über Delta-neutrale Produkte können nur während der Trading Periode eingegeben und geändert werden. Alle Aufträge oder Quotes über Delta-neutrale Produkte werden vor jeder Preisanpassung des Future-Kontraktes und nach Beendigung der Trading Periode gelöscht.

Ausführungsbestimmungen zur Behandlung von Fehleingaben an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

1.1 Gemäß Nummer 1.2.6 Abs. 2 der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

1.1.1 Geltungsbereich

Die nachfolgenden Ausführungsbestimmungen zu Nummer 1.2.6 Abs. 2 der Handelsbedingungen betreffen Fehleingaben im Handel mit Optionskontrakten auf Aktien, börsengehandelte Indexfondsanteile und Aktienindizes.

1.1.2 Voraussetzungen

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen werden ein Geschäft zur Gewährleistung geordneter und fairer Marktverhältnisse aufheben, wenn

a. der Preis des durch die Fehleingabe zustande gekommenen Geschäftes erheblich vom Marktpreis - nachfolgend "Referenzpreis" genannt - abweicht und

b. der die Fehleingabe tätigende Börsenteilnehmer gegenüber den Eurex-Börsen unverzüglich geltend macht, dass er den Auftrag oder den Quote irrtümlich unrichtig in das System der Eurex-Börsen eingegeben hat.

Die Geltendmachung etwa darüber hinausgehender Rechte bleibt unberührt.

Zur Feststellung, ob der Preis des Geschäftes erheblich vom Referenzpreis abweicht, werden diese Preise nach Maßgabe der folgenden Regelungen zueinander ins Verhältnis gesetzt:

Der Referenzpreis wird grundsätzlich gebildet aus dem Durchschnitt der Preise des unmittelbar vor und des unmittelbar nach der Fehleingabe zustande gekommenen Geschäftes. Ist nur einer dieser beiden Preise vorhanden, so wird dieser als Referenzpreis herangezogen.

Ist ein Referenzpreis nach der vorstehenden Bestimmung nicht zu ermitteln oder entspricht der so ermittelte Referenzpreis nicht den fairen Marktverhältnissen, ermitteln die Eurex-Börsen mit Hilfe des von ihnen eingesetzten Optionspreismodells einen "theoretisch fairen" Preis und ziehen diesen als Referenzpreis heran. Hilfsweise wählen die Eurex-Börsen aus dem Kreis der zum Handel an den Eurex-Börsen zugelassenen Teilnehmer, die nicht an dem Geschäft beteiligt sind, drei kompetente Personen (Chefhändler), welche jeweils einen Marktpreis für die betroffene Optionsserie zu berechnen haben; der Durchschnitt dieser drei ermittelten Preise ergibt sodann den Referenzpreis.

Bei der Beurteilung, ob eine erhebliche Abweichung des Preises des Geschäftes vom Referenzpreis vorliegt, ist zwischen Optionskontrakten auf Aktien deutscher Aktiengesellschaften (deutsche Aktienoptionen) bzw. auf deutsche Aktienindizes, auf den Dow Jones STOXX 50-Index, den Dow Jones EURO STOXX 50-Index, den Dow Jones Global Titans 50-Index[SM], die Dow Jones EURO STOXX[SM]-Sektorindizes sowie auf die Dow Jones STOXX[SM]-Sektorindizes, Optionskontrakten auf börsengehandelte Indexfondsanteile und Optionskontrakten auf Aktien Schweizer Aktiengesellschaften (Schweizer Aktienoptionen) bzw. Schweizer Aktienindizes und Optionskontrakten auf Aktien finnischer Aktiengesellschaften (finnische Aktienoptionen) bzw. finnische Aktienindizes, Optionskontrakten auf niederländische Aktiengesellschaften (niederländische Aktienoptionen), Optionskontrakten auf italienische Aktiengesellschaften (italienische Aktienoptionen), Optionskontrakten auf französische Aktiengesellschaften (französische Aktienoptionen), Optionskontrakten auf Aktien von Aktiengesellschaften des Neuen Marktes (Neuer Markt-Aktienoptionen) und Optionskontrakten auf Aktien US-amerikanischer Aktiengesellschaften (US-amerikanische Aktienoptionen) wie folgt zu unterscheiden:

Von einer erheblichen Abweichung des Preises des Geschäftes vom Referenzpreis ist bei Optionskontrakten auf Aktien deutscher Aktiengesellschaften (deutsche Aktienoptionen), auf Aktien Schweizer Aktiengesellschaften (Schweizer Aktienoptionen), auf Aktien finnischer Aktiengesellschaften (finnische Aktienoptionen), auf Aktien niederländischer Aktiengesellschaften (niederländische Aktienoptionen), auf Aktien italienischer Aktiengesellschaften (italienische Aktienoptionen), auf Aktien französischer Aktiengesellschaften (französische Aktienoptionen), auf Aktien von Aktiengesellschaften des Neuen Marktes (Neuer Markt-Aktienoptionen), auf Aktien US-amerikanischer Aktiengesellschaften (US-amerikanische Aktienoptionen), auf Dow Jones EURO STOXX[SM]-Sektorindizes, auf Dow Jones STOXX[SM]-Sektorindizes und auf börsengehandelte Indexfondsanteile ist auszugehen, wenn dessen Abweichung den jeweils gültigen Maximum Spread bezogen auf den Referenzpreis übersteigt.

Vorstehende Regelung zur Bestimmung einer erheblichen Abweichung vom Referenzpreis findet ebenfalls Anwendung auf Low Exercise Price Options (LEPO) auf die jeweiligen Aktiengesellschaften und börsengehandelte Indexfondsanteile.

Von einer erheblichen Abweichung des Preises des Geschäftes vom Referenzpreis ist bei Optionskontrakten auf deutsche Aktienindizes, finnische Aktienindizes bzw. bei Optionskontrakten auf den Dow Jones STOXX 50-Index sowie den Dow Jones EURO STOXX 50-Index auszugehen, wenn dessen Abweichung

- 20 Punkte [1) 2)] übersteigt oder
- sofern die Abweichung 20 Punkte [1) 2)] nicht übersteigt, die Abweichung 20 Prozent des Referenzpreises sowie 3 Punkte [1) 2)] übersteigt.

[1)] Ausgenommen sind Optionen auf den Nemax 50: Eine erhebliche Abweichung des Preises des Geschäfts vom Referenzpreis liegt bei Optionskontrakten auf den Nemax 50 nur dann vor, wenn die Abweichung 50 Punkte übersteigt, oder, wenn die Abweichung 50 Punkte nicht übersteigt, 20 Prozent des Referenzpreises sowie 5 Punkte übersteigt.

[2)] Ausgenommen sind ferner Optionskontrakte auf den Dow Jones EURO STOXX 50-Index mit Laufzeiten von mehr als 24 Monaten: bei diesen Optionskontrakten ist von einer erheblichen

Abweichung des Preises des Geschäftes vom Referenzpreis auszugehen, wenn dessen Abweichung den jeweils gültigen Maximum Spread bezogen auf den Referenzpreis übersteigt.

Von einer erheblichen Abweichung des Preises des Geschäftes vom Referenzpreis ist bei Schweizer Aktienindizes auszugehen, wenn die Abweichung 75 Prozent des jeweils gültigen Maximum Spreads bezogen auf den Referenzpreis übersteigt.

Von einer erheblichen Abweichung des Preises des Geschäftes vom Referenzpreis ist bei Optionskontrakten auf den Dow Jones Global Titans 50 Index^{SM} auszugehen, wenn dessen Abweichung

- fünf Punkte übersteigt oder
- sofern die Abweichung fünf Punkte nicht übersteigt, die Abweichung 20 Prozent des Referenzpreises sowie 1 Punkt übersteigt.

Die Regelungen unter Ziffer 1.1.2 gelten entsprechend für einen kombinierten Auftrag gemäß Ziffer 1.3.1 Abs. 1 lit. c der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, der irrtümlich unrichtig in das System der Eurex-Börsen eingegeben und mit zwei limitierten Aufträgen (Ziffer 1.3.1 Abs. 1 lit. b Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich) zusammengeführt wurde (Matching). Bezüglich der beiden zustande gekommenen Geschäfte ist jedoch separat zu beurteilen, ob eine erhebliche Abweichung des Preises eines dieser Geschäfte oder beider Geschäfte vom Marktpreis ("Referenzpreis") vorliegt. Weicht der Preis nur eines der beiden Geschäfte erheblich vom Marktpreis ("Referenzpreis") im Sinne der vorstehenden Regelungen ab, wird nur dieses Geschäft aufgehoben. Das zweite Geschäft, dessen Preis dem Marktpreis ("Referenzpreis") entspricht, wird nicht aufgehoben.

Wird ein kombinierter Auftrag gemäß Ziffer 1.3.1 Abs. 1 lit. c der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, der irrtümlich unrichtig in das System der Eurex-Börsen eingegeben wurde, mit einem kombinierten Auftrag zusammengeführt (Matching), finden die unter Ziffer 1.3 geregelten Ausführungsbestimmungen zur Behandlung von Fehleingaben Anwendung.

Bei Geschäften in Delta-neutralen Produkten ist der Referenzpreis des Optionsgeschäfts maßgeblich und wird gemäß der vorstehenden Bestimmungen ermittelt. Für das Future-Geschäft erfolgt keine gesonderte Ermittlung eines Referenzpreises, da dieses im Falle einer erheblichen Abweichung des Preises des Optionsgeschäfts vom ermittelten Referenzpreis mit dem Optionsgeschäft zusammen aufgehoben wird.

1.1.3 Form der Geltendmachung

Der die Fehleingabe geltend machende Börsenteilnehmer hat die irrtümliche Fehleingabe per Telefon oder per Telefax gegenüber den Eurex-Börsen geltend zu machen. Die Geltendmachung einer Fehleingabe gegenüber einer der Eurex-Börsen gilt als gegenüber allen Eurex-Börsen abgegeben.

1.1.4 Aufhebung

Die Aufhebung des Geschäftes durch die Eurex-Börsen erfolgt durch die Eingabe eines Gegengeschäftes zu dem Fehleingabepreis in das System der Eurex-Börsen.

1.1.5 Kosten

Dem Verursacher wird von den Eurex-Börsen eine Bearbeitungsgebühr – je nach Aufwand, mindestens jedoch in Höhe von EUR 150 [1)] bzw. CHF 250 [2)] pro Fehleingabe – in Rechnung gestellt. Alle anfallenden Entgelte der Eurex-Börsen – auch für das Aufhebungsgeschäft – werden von den Eurex-Börsen storniert.

[1)] Optionen, die in EUR notiert werden.

[2)] Optionen, die in CHF notiert werden.

1.1.6 Sonstiges

Die Eurex-Börsen übersenden den beteiligten Parteien eine Bestätigung, aus der hervorgeht, dass das betreffende Geschäft entsprechend Nummer 1.2.6 Abs. 2 der Handelsbedingungen in Verbindung mit diesen Durchführungsbestimmungen von den Eurex-Börsen aufgehoben worden ist. Die Eurex-Börsen veröffentlichen erforderliche Preisberichtigungen mittels elektronischer Medien. Art und Umfang der Veröffentlichung bestimmt die Geschäftsführung der Eurex Deutschland beziehungsweise der Eurex Zürich.

1.2 Gemäß Nummer 1.2.6 Abs. 2 der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

1.2.1 Geltungsbereich

Die nachfolgenden Ausführungsbestimmungen zu Nummer 1.2.6 Abs. 2 der Handelsbedingungen betreffen Fehleingaben im Handel mit Optionskontrakten auf Zins-Futures.

1.2.2 Voraussetzungen

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen werden ein Geschäft zur Gewährleistung geordneter und fairer Marktverhältnisse aufheben, wenn

a. der Preis des durch die Fehleingabe zustande gekommenen Geschäftes erheblich vom Marktpreis - nachfolgend "Referenzpreis" genannt - abweicht und

b. der die Fehleingabe tätigende Börsenteilnehmer gegenüber den Eurex-Börsen unverzüglich geltend macht, dass er den Auftrag oder den Quote irrtümlich unrichtig in das System der Eurex-Börsen eingegeben hat.

Die Geltendmachung etwa darüber hinausgehender Rechte bleibt unberührt.

Zur Feststellung, ob der Preis des Geschäftes erheblich vom Referenzpreis abweicht, werden diese Preise nach Maßgabe der folgenden Regelungen zueinander ins Verhältnis gesetzt:

Der Referenzpreis wird grundsätzlich gebildet aus dem Durchschnitt der Preise des unmittelbar vor und des unmittelbar nach der Fehleingabe zustande gekommenen Geschäftes. Ist nur einer dieser beiden Preise vorhanden, so wird dieser als Referenzpreis herangezogen.

Ist ein Referenzpreis nach der vorstehenden Bestimmung nicht zu ermitteln oder entspricht der so ermittelte Referenzpreis nicht den fairen Marktverhältnissen, ermitteln die Eurex-Börsen mit Hilfe des von ihr eingesetzten Optionspreismodells einen "theoretisch fairen" Preis und ziehen diesen als Referenzpreis heran. Hilfsweise wählen die Eurex-Börsen aus dem Kreis der zum Handel an den Eurex-Börsen zugelassenen Teilnehmer, die nicht an dem Geschäft beteiligt sind, drei kompetente Personen (Chefhändler), welche jeweils einen Marktpreis für die betroffene Optionsserie zu berechnen haben; der Durchschnitt dieser drei ermittelten Preise ergibt sodann den Referenzpreis.

Für Optionskontrakte auf Futures auf eine fiktive Schuldverschreibung der Bundesrepublik Deutschland oder der Treuhandanstalt sowie für Optionskontrakte auf Geldmarkt-Zins-Futures ist von einer erheblichen Abweichung vom Referenzpreis auszugehen, wenn der Preis des Geschäftes für einen Referenzpreis

- von bis zu 0,09 Punkten um mehr als 0,03,
- von bis zu 0,29 Punkten um mehr als 0,04,
- von bis zu 0,59 Punkten um mehr als 0,06,
- von bis zu 0,99 Punkten um mehr als 0,08 und
- für einen Referenzpreis von mehr als 1,00 Punkten um mehr als 0,1 Punkte vom Referenzpreis abweicht.

Für Optionskontrakte auf Futures auf eine fiktive Anleihe der Schweizerischen Eidgenossenschaft ist von einer erheblichen Abweichung vom Referenzpreis auszugehen, wenn der Preis des Geschäftes

- im ersten Verfallmonat mehr als das Zehnfache der kleinsten Preisveränderung (10 Ticks)
- in jedem weiteren Verfallmonat mehr als das Fünfzehnfache der kleinsten Preisveränderung (15 Ticks) vom Referenzpreis abweicht.

Die Regelungen unter Ziffer 1.2.2 gelten entsprechend für einen kombinierten Auftrag gemäß Ziffer 1.3.1 Abs. 1 lit. c der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, der irrtümlich unrichtig in das System der Eurex-Börsen eingegeben und mit zwei limitierten Aufträgen (Ziffer 1.3.1 Abs. 1 lit. b Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich) zusammengeführt wurde (Matching). Bezüglich der beiden zustande gekommenen Geschäfte ist jedoch separat zu beurteilen, ob eine erhebliche Abweichung des Preises eines dieser Geschäfte oder beider

Geschäfte vom Marktpreis ("Referenzpreis") vorliegt. Weicht der Preis nur eines der beiden Geschäfte erheblich vom Marktpreis ("Referenzpreis") im Sinne der vorstehenden Regelungen ab, wird nur dieses Geschäft aufgehoben. Das zweite Geschäft, dessen Preis dem Marktpreis ("Referenzpreis") entspricht, wird nicht aufgehoben.

Wird ein kombinierter Auftrag gemäß Ziffer 1.3.1 Abs. 1 lit. c der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, der irrtümlich unrichtig in das System der Eurex-Börsen eingegeben wurde, gleichfalls mit einem kombinierten Auftrag zusammengeführt (Matching), finden die unter Ziffer 1.3 geregelten Ausführungsbestimmungen zur Behandlung von Fehleingaben Anwendung.

Bei Geschäften in Delta-neutralen Produkten ist der Referenzpreis des Optionsgeschäfts maßgeblich und wird gemäß der vorstehenden Bestimmungen ermittelt. Für das Future-Geschäft erfolgt keine gesonderte Ermittlung eines Referenzpreises, da dieses im Falle einer erheblichen Abweichung des Preises des Optionsgeschäftes vom ermittelten Referenzpreis mit dem Optionsgeschäft zusammen aufgehoben wird.

1.2.3 Form der Geltendmachung

Der die Fehleingabe geltend machende Börsenteilnehmer hat die irrtümliche Fehleingabe per Telefon oder per Telefax gegenüber den Eurex-Börsen geltend zu machen. Die Geltendmachung einer Fehleingabe gegenüber einer der Eurex-Börsen gilt als gegenüber allen Eurex-Börsen abgegeben.

1.2.4 Aufhebung

Die Aufhebung des Geschäftes durch die Eurex-Börsen erfolgt durch die Eingabe eines Gegengeschäftes zu dem Fehleingabepreis in das System der Eurex-Börsen.

1.2.5 Kosten

Dem Verursacher wird von den Eurex-Börsen eine Bearbeitungsgebühr – je nach Aufwand, mindestens jedoch in Höhe von EUR 150 [1)] bzw. CHF 250 [2)] pro Fehleingabe – in Rechnung gestellt. Alle anfallenden Entgelte der Eurex-Börsen – auch für das Aufhebungsgeschäft – werden von den Eurex-Börsen storniert.

[1)] Optionen, die in EUR notiert werden.

[2)] Optionen, die in CHF notiert werden.

1.2.6 Sonstiges

Die Eurex-Börsen übersenden den beteiligten Parteien eine Bestätigung, aus der hervorgeht, dass das betreffende Geschäft entsprechend Nummer 1.2.6 Abs. 2 der Handelsbedingungen in Verbindung mit diesen Durchführungsbestimmungen von den Eurex-Börsen aufgehoben worden ist. Die Eurex-Börsen veröffentlichen erforderliche Preisberichtigungen mittels elektronischer Medien. Art und Umfang der Veröffentlichung bestimmt die Geschäftsführung der Eurex Deutschland beziehungsweise der Eurex Zürich.

[……]