

## *Bekanntmachung der Eurex Deutschland*

### **Aktienindexderivate: Einführung von Total Return Futures auf den FTSE 100-Index (Update)**

### **Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland (eurex14)**

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland hat die Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland beschlossen.

Sie tritt mit Wirkung zum 29.03.2021 in Kraft.

---

Die Änderungen können auf der Internetseite der Eurex Deutschland (<http://www.eurexchange.com>) abgerufen und im „Präsenzordner Regelwerke“ der Eurex Deutschland am Empfang des Handelssaals, Börsenplatz 4, 60313 Frankfurt am Main, Deutschland, während der allgemeinen Öffnungszeiten eingesehen werden.

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

## Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

[...]

### Teilabschnitt 1.22 Kontraktsspezifikationen für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte

[...]

#### 1.22.6 Handelskonventionen

[...]

##### 1.22.6.4 Zinsberechnungsmethode

In die Berechnung der gehandelten Basis der Index-Total-Return-Futures-Kontrakte in Indexpunkten 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 Index-Total-Return-Futures-Kontrakte ist Actual/360 (Act/360), d.h. die tatsächliche Anzahl Tage in dem für die Berechnung herangezogenen Zeitraum wird durch den Annualisierungsfaktor 360 geteilt.
- Die Zinsberechnungsmethode für auf GBP lautende Index-Total-Return-Futures-Kontrakte ist Actual/365 (Act/365), d.h. die tatsächliche Anzahl Tage in dem für die Berechnung herangezogenen Zeitraum wird durch den Annualisierungsfaktor 365 geteilt.

[...]

\*\*\*\*\*

Die vorstehende Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland wird hiermit ausgefertigt. Die Änderung tritt dem Beschluss der Geschäftsführung der Eurex Deutschland entsprechend am 29.03.2021 in Kraft.

Frankfurt am Main, 29.03.2021

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters