

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

MSCI-Futures: Einführung von vier weiteren Produkten und Einstellung des Handels in 15 Futures

Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland

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 06.09.2021 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 1.3 Kontraktsspezifikationen für Index-Futures-Kontrakte

Der folgende Teilabschnitt enthält die Kontraktgestaltung für Futures-Kontrakte auf Aktienindizes („Index-Futures-Kontrakte“).

1.3.1 Kontraktgegenstand

[...]

(2) [...]

- Die folgenden MSCI Indizes (zusammen mit den MSCI EM Sector Indizes, den MSCI World Sector Indizes und den MSCI Europe Sector Indizes, wie in Abs. 2a, 2b und 2c definiert, für die Zwecke der Index-Futures-Kontrakte die „MSCI Indizes“):

[...]

– MSCI Belgium (NTR, EUR) (MSCI Inc.)

~~– MSCI Brazil (NTR, USD) (MSCI Inc.)~~

[...]

– MSCI Chile (MSCI Inc.)

~~– MSCI China (NTR, USD) (MSCI Inc.)~~

[...]

~~– MSCI Emerging Markets Asia (MSCI Inc.)~~

~~– MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened (NTR, USD) (MSCI Inc.)~~

[...]

– ~~MSCI Switzerland (NTR, CHF) (MSCI Inc.)~~

– MSCI Switzerland (USD, NTR) (MSCI Inc.)

[...]

[...]

(5) Der Wert eines Kontrakts beträgt:

- EUR 1 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den Micro-DAX® (Produkt ID: FDXS), den Micro-Euro STOXX 50® (Produkt ID: FSXE) und den Micro-SMI® (Produkt ID: FSMS)
- ~~CHF 1 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den Micro-SMI® (Produkt ID: FSMS)~~
- [...]
- EUR 500 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den MSCI Italy Index
- ~~CHF 1 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den Micro-SMI® (Produkt ID: FSMS)~~
- CHF 10 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den ~~MSCI Switzerland (NTR, CHF)~~, SMI®, SLI® und den SMIM®
- [...]
- USD 10 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den EURO STOXX 50® Index (Produkt ID: FESQ; das Produkt FESQ ist ein Quanto-Future, d.h. die Produktwährung (USD) unterscheidet sich von der Währung des Index (EURO STOXX 50® Index, berechnet in EUR)), RDX® USD Index, MSCI AC ASEAN (NTR, USD), MSCI Australia Index, MSCI Canada (GTR, USD), MSCI Canada (NTR, USD), MSCI China Tech 100 Index, MSCI Colombia Index, MSCI EAFE (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Asia ex China, MSCI Emerging Markets Asia ex Korea (NTR, USD), MSCI Emerging Markets ESG Enhanced Focus, MSCI Emerging Markets Latin America ex Brazil (USD, NTR), MSCI Europe (GTR, USD), MSCI Europe Index (NTR, USD), MSCI Frontier Markets Index, MSCI Indonesia, MSCI Japan ESG Enhanced Focus, MSCI Japan Index (NTR, USD), MSCI Japan (GTR, USD), MSCI Kokusai Index (NTR & GTR), MSCI Kuwait Index, MSCI North America (GTR, USD), MSCI North America (NTR, USD), MSCI North America SMID (NTR, USD), MSCI Pacific Index (NTR & GTR), MSCI Pacific ex Japan, MSCI Peru Index, MSCI Qatar, MSCI Russia Index (Price, USD), MSCI Saudi Arabia (USD, NTR) (Futures auf MSCI Saudi Arabia können im Orderbuch nur in Vielfachen von 5 Kontrakten gehandelt werden), MSCI Thailand Index, MSCI United Kingdom (NTR, USD), MSCI USA ESG Enhanced Focus, MSCI USA (GTR, USD), MSCI USA (NTR, USD) Index, MSCI USA Equal Weighted Index, MSCI USA Momentum Index, MSCI USA Quality Index, MSCI USA Value Weighted Index, MSCI World ESG Enhanced Focus, MSCI World Growth (NTR, USD), MSCI World Value (NTR, USD), MSCI World Index (GTR, USD), den MSCI World Index (NTR & Price, USD), ~~den MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened Index~~, den MSCI USA ESG Screened Index, den MSCI World ESG Screened Index, den MSCI EM ESG Screened Index, den MSCI EAFE ESG Screened Index und den MSCI Japan ESG Screened Index
- USD 50 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf MSCI ACWI (Price, USD), MSCI Chile Index, ~~MSCI China Index~~, MSCI China Free Index, MSCI China Hong Kong Listed Large Cap Index, MSCI Czech Republic Index, MSCI EAFE (Price, USD), MSCI Egypt Index, MSCI Emerging Market Index (Price, USD), MSCI Emerging Markets EMEA ex Turkey (USD, NTR), die MSCI Emerging Market Sector Indizes, MSCI GCC Countries Index (NTR, USD), MSCI Hong Kong Listed Large Cap Index, MSCI Mexico Index, MSCI Pakistan (NTR, USD), MSCI

Philippines Index, MSCI Russia Index (NTR, USD), MSCI United Arab Emirates Index und den MSCI World Midcap Index

- USD 100 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den MSCI AC Asia (NTR, USD), MSCI AC Asia Pacific Index, MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index, MSCI AC Asia ex Japan (NTR, USD), MSCI ACWI (NTR, USD), MSCI ACWI ex USA Index, MSCI Argentina Index, [MSCI Brazil Index](#), MSCI Emerging Markets Index (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Growth (USD, NTR), MSCI Emerging Markets Value (USD, NTR), MSCI Emerging Markets Asia Index, MSCI Emerging Markets EMEA Index, MSCI Emerging Markets Latin America Index, MSCI Hungary Index, MSCI India Index, MSCI Malaysia Index, MSCI Morocco Index, MSCI Taiwan (USD, NTR), MSCI New Zealand, MSCI Poland Index, MSCI South Africa Index, die MSCI World Sector Indizes, den MSCI World Small Cap Index, den STOXX® USA 500 ESG-X Index und den STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Value Index, STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Size Index, STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Quality Index, STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Multi-Factor Index, STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Momentum Index und den STOXX USA 500 Industry Neutral Ax Low Risk Index.

[...]

1.3.5 Preisabstufungen

1.3.5.1 Generelle Preisabstufungen für Index-Futures-Kontrakte

Der Preis eines Index-Futures-Kontrakts wird in Punkten ermittelt. Die kleinste Preisveränderung (Tick) beträgt

[...]

- 0,1 Punkte bei

[...]

- MSCI Russia (Price, USD), dies entspricht einem Wert von USD 1
- MSCI ACWI (Price, USD), MSCI Chile, [MSCI China](#), MSCI China Free, MSCI Czech Republic, MSCI EAFE (Price, USD), MSCI Emerging Markets (Price, USD), MSCI Emerging Markets Sectors, MSCI Mexico, MSCI Philippines, MSCI Russia (NTR, USD) und MSCI United Arab Emirates, dies entspricht einem Wert von USD 5
- MSCI AC Asia (NTR, USD), MSCI AC Asia ex Japan (NTR, USD), MSCI AC Asia Pacific, MSCI AC Asia Pacific ex Japan, MSCI Argentina, [MSCI Brazil](#), MSCI China Hong Kong Listed Large Cap, MSCI Emerging Markets (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Asia, MSCI Emerging Markets EMEA, MSCI Emerging Markets Latin America, MSCI Emerging Markets Growth (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Value (NTR, USD), MSCI Hong Kong Listed Large Cap, MSCI Hungary, MSCI India, MSCI Malaysia, MSCI Morocco, MSCI New Zealand, MSCI Poland, MSCI South Africa, MSCI Taiwan (NTR, USD), den MSCI World Sektoren und MSCI World Small Cap, dies entspricht einem Wert von USD 10

- 0,5 Punkte bei

- [MSCI Switzerland \(NTR, CHF\)](#), dies entspricht einem Wert von CHF 5,00
- TecDAX®, ATX®, CECE® EUR, dies entspricht einem Wert von EUR 5,00
- [...]
- MSCI Egypt, MSCI Emerging Markets EMEA ex Turkey (USD, NTR), MSCI GCC Countries, MSCI Pakistan (NTR, USD), und MSCI World Midcap, dies entspricht einem Wert von USD 25,00
- [MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened Index](#), MSCI USA ESG Screened Index, MSCI World ESG Screened Index, MSCI EM ESG Screened Index, MSCI EAFE ESG Screened Index und MSCI Japan ESG Screened Index, dies entspricht einem Wert von USD 5
- [...]

1.3.5.2 Preisabstufungen bei Standardisierten Futures-Strategien

Abweichend zu Ziffer 1.3.5.1 beträgt die kleinste Preisveränderung (Tick) für Standardisierte Futures-Strategien im Sinne von Ziffer 2.2.1 der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland (z. B. Futures-Kalender-Spread):

[...]

- 0,02 Punkte bei
 - MSCI AC Asia ex Japan Index (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2
 - [MSCI Brazil \(NTR, USD\)](#), dies entspricht einem Wert von USD 2
 - [...]
- 0,05 Punkte bei
 - [MSCI China \(NTR, USD\)](#), MSCI China Free Index (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2,5
 - [...]

[...]

Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

3.2.1 Blockgeschäfte

[...]

Produkt	Zusätzliche Kontraktvarianten J/N	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte	
		TES	Eurex EnLight und von QTPIP getätigte Eingaben *
[...]			
Aktienindex-Futures			
[...]			
Futures-Kontrakte auf den MSCI Belgium (FMBE)	J	10	
<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI Brazil (FMBZ)</u>	<u>J</u>	<u>20</u>	
[...]			
<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI China Index (FMCH)</u>	<u>J</u>	<u>20</u>	
Futures-Kontrakte auf den MSCI China Free Index (FMCN)	J	20	
[...]			
Futures-Kontrakte auf den MSCI Emerging Markets Asia Index (FMEA)	J	50	
<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened (FMSS)</u>	<u>J</u>	<u>1</u>	
[...]			
<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI Switzerland Index (NTR, CHF) (FMST)</u>	<u>J</u>	<u>5</u>	
Futures-Kontrakte auf den MSCI Switzerland Index (NTR, USD) (FMSZ)	J	5	
[...]			

* Als von QTPIP getätigte Eingaben gelten Eingaben gemäß Ziffer 4.6 (3) der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland. Für Eingaben von STPIP gemäß Ziffer 4.6 (2) gelten die Bestimmungen für die Eingabe von TES Geschäften.

[...]

Annex E Allokationsverfahren (Teil A Ziffer 2.5 Abs. 3 der Handelsbedingungen) und Pfadprioritäten (Teil A Ziffer 2.5 Abs. 2 der Handelsbedingungen) *

Produktgruppe	Allokationsverfahren	Pfadpriorität
[...]		
DAX®-Futures, Euro STOXX 50®-Futures, Mini-DAX®-Futures, Micro-Euro STOXX 50®-Futures, Micro-DAX®-Futures, STOXX® Europe 600-Futures, EURO STOXX® Banks- und STOXX® Europe 600 Banks-Futures, sowie Futures auf MSCI AC Asia ex Japan Index (NTR, USD), MSCI Australia (NTR, USD), <u>MSCI Brazil (NTR, USD)</u> , <u>MSCI China (NTR, USD)</u> , MSCI China Free Index (NTR, USD), MSCI EAFE (Price, USD), [...]	Time	n/a
[...]		

* Tabelle gilt nur für an der New Trading Architektur gehandelte Produkte (Annex F).

[...]

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 06.09.2021 in Kraft.

Frankfurt am Main, 12.08.2021

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters