
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

[...]

1.22.6.3 Funding Rate

Die auf Index-Total-Return-Futures-Kontrakte anwendbare Funding Rate ist der Benchmark-Zinssatz für Overnight-Geschäfte, über die der TRF-Spread ermittelt und gehandelt wird („Funding Rate“).

- Die Funding Rate für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50[®] (SX5E) ist die von der Europäischen Zentralbank (EZB) (als prozentualer Wert) veröffentlichte Euro Short-Term Rate (€STR). Im Hinblick auf die Tage bis zum €STR-Übergangsdatum, jedoch nicht am €STR-Übergangsdatum, zuzüglich des werden die von der Europäischen Zentralbank (EZB) bereitgestellten Spreads zwischen €STR und Eonia[®] (als prozentualer Wert) zum €STR addiert und sind Bestandteil der jeweiligen Funding Rate.
- Die Funding Rate für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50[®] Banks (SX7E) und EURO STOXX[®] Select Dividend 30 (SD3E) ist die von der Europäischen Zentralbank (EZB) (als prozentualer Wert) veröffentlichte Euro Short-Term Rate (€STR)
- Die Funding Rate für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf iStoxx Europe Collateral Indizes ist die von der Europäischen Zentralbank (EZB) (als prozentualer Wert) veröffentlichte Euro Short-Term Rate (€STR)

Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte
und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland

Eurex14

Stand 18.10.2021

- Die Funding Rate für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den FTSE® 100 ist der von der Bank of England (als prozentualer Wert) veröffentlichte Sterling Overnight Index Average (SONIA)

Das „€STR-Übergangsdatum“ ist der 18.10.2021. Zur Sicherstellung ordnungsgemäßer Handelsbedingungen kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland den Termin verschieben; eine solche Verschiebung wird durch Bekanntmachung veröffentlicht.

[...]
