

Anhang 1 zu Eurex-Rundschreiben 013/22

3. Details der Initiative

A. Produktüberblick (neue Produkte)

Basiswerte						
Index	Indextyp	Währung	Dividend reinvestm. *	ISIN	Refinitiv	Bloomberg
MSCI Germany	Standard	EUR	NTR	GB00BNZFBV308	.dMIDE00000NEU	MSDEGRN
MSCI Israel		USD	NTR	XC000A2DBS46	.dMIIL00000NUS	NDEUIS
MSCI Europe ESG Screened	ESG	EUR	NTR	GB00BNSPZ808	.dMIEU20000NEU	NE721416
MSCI EMU ESG Screened		EUR	NTR	GB00BNSPZ915	.dMIEM20000NEU	NE721421
MSCI China	Standard	USD	NTR	GB00BN7DFX04	.dMICN00000NUS	NDEUCHF
MSCI Saudi Arabia		USD	NTR	GB00BP68BQ52	.dMISAPz000NUS	M1SAP

* NTR = Net Total Return / GTR = Gross Total Return / Price = Price Return

Eurex-Produkte							
Produkt	Index	Indextyp	Währung	Dividend reinvestm. *	ISIN	Eurex Produkt-kürzel	Produkt-typ
Futures	MSCI Germany	Standard	EUR	NTR	DE000A3CN8C2	FMGY	FINX
Futures	MSCI Israel		USD	NTR	DE000A3DCW73	FMIS	FINX
Futures	MSCI Europe ESG Screened	ESG	EUR	NTR	DE000A3DCW40	FMSR	FINX
Futures	MSCI EMU ESG Screened		EUR	NTR	DE000A3DCW57	FMSO	FINX
Optionen	MSCI China	Standard	USD	NTR	DE000A3DCW16	OMCH	OINX
Optionen	MSCI Saudi Arabia		USD	NTR	DE000A3DCW24	OMSA	OINX

* NTR = Net Total Return / GTR = Gross Total Return / Price = Price Return

B. Kontraktspezifikationen

Beschreibung des Basiswerts	Eine detaillierte Beschreibung des Index-Regelwerks ist auf der MSCI-Website unter www.msci.com zu finden.
Kontraktwert	Siehe nachfolgende Tabelle
Erfüllung	Durch Barausgleich, fällig am ersten Börsentag nach dem Schlussabrechnungstag.
Preisermittlung	In Punkten, mit drei Dezimalstellen (Futures) bzw. einer Dezimalstelle (Optionen)

Minimale Preisveränderung	Siehe nachfolgende Tabelle Im Gegensatz zur minimalen Preisveränderung im Orderbuch können alle MSCI-Futures in den Eurex T7-Trade-Entry-Services (TES) mit einer minimalen Preisveränderung von 0,001 eingegeben werden.
Laufzeiten	Futures: Die nächsten zwölf Quartalsmonate aus dem Zyklus März, Juni, September und Dezember (36 Monate) Optionen: Bis jeweils einschließlich zum nächsten, übernächsten und drittnächsten Verfalltag sowie bis einschließlich zu den sechs danach liegenden Quartalsverfalltagen (März, Juni, September, Dezember) (24 Monate)
Letzter Handelstag/Schlussabrechnungstag	Der dritte Freitag des jeweiligen Verfallmonats, sofern dieser Tag ein Handelstag an Eurex Deutschland ist, andernfalls der unmittelbar vorhergehende Handelstag. Handelsschluss für die auslaufenden Serien ist 22:00 Uhr MEZ/MESZ (Futures) bzw. 17:30 Uhr MEZ/MESZ (Optionen) Der Schlussabrechnungstag ist der auf den letzten Handelstag folgende Handelstag.
Schlussabrechnungspreis	Maßgeblich für die MSCI-Aktienindex-Derivate ist der Schlusskurs des Index am letzten Handelstag.

Weitere Kontraktsspezifikationen							
Produkt	Indexname	Produkt-kürzel	Kontrakt-wert	Tickgröße Orderbuch	Tick-wert	MBTS*	NDL**
Futures	MSCI Germany	FMGY	100 EUR	0,05	5	10	2.000
Futures	MSCI Israel	FMIS	100 USD	0,05	5	10	2.000
Futures	MSCI Europe ESG Screened	FMSR	10 EUR	0,50	5	1	2.000
Futures	MSCI EMU ESG Screened	FMSO	10 EUR	0,50	5	1	2.000
Optionen	MSCI China	OMCH	50 USD	0,1	5	1	5.000
Optionen	MSCI Saudi Arabia	OMSA	10 USD	0,1	1	1	5.000

* MBTS = Minimum Block Trade-Größe / ** NDL = Non-disclosure limit (untertägliches Nichtanzeige-Limit)

C. Handelszeiten (MEZ/MESZ)

Produkt	Produkt-kürzel	Pre-Trading-Periode	Fortlaufender Handel	Post-Trading-Periode bis	Off-Book Trading-Periode	Off-Book Post-Trading-Periode bis	Letzter Handelstag	
							Handel bis	Ausübung bis
MSCI-Futures		01:00-01:10 MEZ	01:10-22:00 MEZ	22:10 MEZ/MESZ	01:15-22:00 MEZ	22:10 MEZ/MESZ	22:00 MEZ/MESZ	--
		02:00-02:10 MESZ	02:10-22:00 MESZ					
MSCI-Optionen		07:30-08:50 MEZ/MESZ	08:50-17:30 MEZ/MESZ	20:30 MEZ/MESZ	09:00-19:00 MEZ/MESZ	19:15 MEZ/MESZ	17:30 MEZ/MESZ	20:30* MEZ/MESZ

(...)

E. Produktgruppe

Die zu den neuen Produkten gehörige Produktgruppe lautet wie folgt

Produkt	Produktgruppe	Abwicklungs- lokations- einheit	Regulatori- scher Status	Abwicklungs- Art	Produktart	Produkt- segment	Produkt- währung	Capacity- Name
Produkte auf MSCI- Indizes in USD	E/I Futures/Options in USD	Nein	Nicht für US-Handel zugelassen	bar	F/O	Aktienindex	USD	Cash USD
Produkte auf MSCI- Indizes in EUR	E/I Futures in EUR	Nein	Nicht für US-Handel zugelassen	bar	F	Aktienindex	EUR	Cash/Physical EUR

(...)

I. Transaktionsentgelte

Produkt/ Produktgruppe	Währung	Ausführungsart	Konten	Standard- Entgelt pro Kontrakt (Kontrakt- volumen ≤ Schwellenwert)	Reduziertes Entgelt pro Kontrakt (Kontrakt- volumen > Schwellenwert)	Schwellenwert (Anzahl Kontrakte)
MSCI-Futures	EUR/USD	Orderbuch	A/P/M	0,60	n.a.	n.a.
		EnLight/ TES	A/P/M	0,90	n.a.	n.a.
MSCI-Optionen	USD	Orderbuch	A	0,54	0,27	3.000
			P	0,50	0,25	2.000
			M	0,50	n. a.	n. a.
		EnLight	A	0,56	0,28	3.000
			P	0,50	0,25	2.000
			M	0,50	n. a.	n. a.
		TES	A	0,58	0,29	3.000
			P	0,50	0,25	2.000
			M	0,50	n. a.	n. a.

J. Produkte, deren Handel eingestellt wird

Für das folgende Produkt werden ab dem 21. Februar 2022 keine neuen Verfälle mehr eingeführt. Des Weiteren kann Eurex auch Verfälle ohne Open Interest deaktivieren.

Der Hintergrund der geplanten Handelseinstellung ist, dass MSCI sein Indexangebot konsolidieren möchte. Der MSCI China Free Index ist seit Juni 2018 identisch mit dem MSCI China-Index, in Bezug auf Index-Zusammenstellung und Gewichtung. Daher wurden Derivate-Kunden gebeten, auf den breiter genutzten MSCI China-Index zu referenzieren. Die Migration in den entsprechenden Futures ist bereits größtenteils abgeschlossen.

Produkt-typ	Eurex Kontrakt-kennung	Indexname	Währung	Dividend reinvestment
Optionen	OMCN	MSCI China Free	USD	NTR