
ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

EINFÜGUNGEN SIND UNTERSTRICHEN;

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.1 Eingabeintervalle für Kontraktpreise

[...]

3.1.1 Eingabeintervall für Futures-Kontrakte

(a) Eingabeintervalle bei TES-Transaktionen

Die Eingabeintervalle für Futures-Kontrakte bei TES-Transaktionen werden anhand der im Folgenden beschriebenen Parameter festgelegt. Die Geschäftsführung kann hiervon im Ausnahmefall abweichen, wenn eine Festlegung nach den beschriebenen Parametern nicht möglich ist.

[...]

Der synthetische Tagestiefstpreis wird aus den tatsächlich gehandelten Tagestiefstpreisen in allen Verfallmonaten und den Preisspannen zwischen den täglichen Abrechnungspreisen der unterschiedlichen Verfallmonate des jeweiligen Futures-Kontraktes bestimmt.

(b) Eingabeintervalle bei Eurex-EnLight-Transaktionen

Die Eingabeintervalle für Futures-Kontrakte bei Eurex-EnLight-Transaktionen entsprechen den bei TES-Transaktionen geltenden Eingabeintervallen. Abweichungen können durch die Geschäftsführung festgelegt werden, sofern für den jeweiligen Futures-Kontrakt eine unzureichende Anzahl an Preisen zur Bestimmung der Referenzpreise für die Eingabeintervalle im Orderbuch zur Verfügung steht.

[...]

3.1.3 Eingabeintervall für Index- und Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte

(a) Eingabeintervalle bei TES-Transaktionen

Abweichend von Ziffer 3.1.1 ergibt sich das Intervall für Index- und Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte bei TES-Transaktionen aus dem in Basispunkten ausgedrückten -
Täglichen-Abrechnungs-TRF-Spread des jeweiligen Futures-Kontrakts vom vorherigen

Handelstag gemäß Kapitel II Abschnitt 2 Ziffer 2.22.2 der Clearing Conditions der Eurex Clearing AG. Zur Berechnung des Intervalls sind folgende Auf- und Abschläge vorzunehmen:

Produkt	Produkt-ID	Betrag
[...]		
Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte	Gemäß Auflistung in Annex G	+ / - 25 Basispunkte (1 Basispunkt = 0,0001)

(b) Eingabeintervalle bei Eurex-EnLight-Transaktionen

Die Eingabeintervalle für Index- und Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte bei Eurex-EnLight-Transaktionen entsprechen den bei TES-Transaktionen geltenden Eingabeintervallen. Abweichungen können durch die Geschäftsführung festgelegt werden, sofern für den jeweiligen Index- oder Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt eine unzureichende Anzahl an Preisen zur Bestimmung der Referenzpreise für die Eingabeintervalle im Orderbuch zur Verfügung steht.

3.1.4 Eingabeintervall für Eurex-Market-on-Close-Futures-Kontrakte

(a) Eingabeintervalle bei TES-Transaktionen

Abweichend von Ziffer 3.1.1 ergibt sich das Intervall für Eurex-Market-on-Close-Futures-Kontrakte bei TES-Transaktionen aus dem in Indexpunkten ausgedrückten täglichen Bewertungspreis auf Grundlage der gehandelten Preise gemäß Ziffer 1.25.4.1. Die Berechnung erfolgt gemäß Kapitel II Abschnitt 2 Ziffer 2.1.2 Absatz 2 der Clearing Conditions der Eurex Clearing AG.

[...]

Für die Bestimmung des täglichen Bewertungspreises der jeweiligen Kontrakte gelten die in der Tabelle vorgesehenen Referenzzeiten:

Eurex Market-on-Close-Futures-Kontrakte auf	Referenzzeit (MEZ)
EURO STOXX 50® Index-Futures Kontrakte (FES1)	17:25

(b) Eingabeintervalle bei Eurex-EnLight-Transaktionen

Die Eingabeintervalle für Eurex-Market-on-Close-Futures-Kontrakte bei Eurex-EnLight-Transaktionen entsprechen den bei TES-Transaktionen geltenden Eingabeintervallen. Abweichungen können durch die Geschäftsführung festgelegt werden, sofern für den jeweiligen Eurex-Market-on-Close-Futures-Kontrakt eine unzureichende Anzahl an Preisen zur Bestimmung der Referenzpreise für die Eingabeintervalle im Orderbuch zur Verfügung steht.

[...]

3.1.6 Besonderheiten Eingabeintervall für Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden, Index-Dividenden-Futures-Kontrakte und Index-Total-Return-Futures-Kontrakte

(a) Eingabeintervalle bei TES-Transaktionen

Abweichend von Ziffer 3.1.1 und Ziffer 3.1.3 kann bei Futures-Kontrakten auf Aktiendividenden, Index-Dividenden-Futures-Kontrakten und Index-Total-Return-Futures-Kontrakten bei TES-Transaktionen der Kontraktpreis auch außerhalb des Intervalls liegen, sofern die nachfolgenden Voraussetzungen erfüllt sind. Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland gibt die hierfür zulässigen Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden, Index-Dividenden-Futures-Kontrakte und Index-Total-Return-Futures-Kontrakte per Rundschreiben bekannt.

[...]

(b) Eingabeintervalle bei Eurex-EnLight-Transaktionen

Die Eingabeintervalle für Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden, Index-Dividenden-Futures-Kontrakte und Index-Total-Return-Futures-Kontrakte bei Eurex-EnLight-Transaktionen entsprechen den bei TES-Transaktionen geltenden Eingabeintervallen. Abweichungen können durch die Geschäftsführung festgelegt werden, sofern für den jeweiligen Futures-Kontrakt auf Aktiendividenden, Index-Dividenden-Futures-Kontrakt oder Index-Total-Return-Futures-Kontrakt eine unzureichende Anzahl an Preisen zur Bestimmung der Referenzpreise für die Eingabeintervalle im Orderbuch zur Verfügung steht.

[...]

3.1.8 Eingabeintervall für Optionskontrakte

- (1) Die Eingabeintervalle für Optionskontrakte werden auf der Basis der bis zum Zeitpunkt der Eingabe eines Blockgeschäfts festgestellten Tageshöchst- und Tagestiefstwerte des jeweiligen Basiswertes und der im Optionsmarkt der Eurex Deutschland jeweils ermittelten impliziten Volatilitäten theoretische maximale und minimale Werte für den Optionspreis dieses Blockgeschäfts im Tagesverlauf ermittelt. Das sich hieraus ergebende Intervall wird an allen Handelstagen außer den Verfalltagen um die Hälfte des zulässigen maximalen Quote-Spreads erweitert. An den Verfalltagen wird das Intervall um den ganzen zulässigen maximalen Quote-Spread ausgedehnt. Daraus ergibt sich die Spanne der zulässigen Optionspreise für Blockgeschäfte. Werden Options-Strategien und Options-Volatilitätsstrategien eingegeben, gilt zur Bestimmung der Strategie-Tageshöchst- und -Tiefstwerte die Summe der einzelnen in der Optionsstrategie enthaltenen Options-Tageshöchst- bzw. Tiefstpreise.

[...]

[...]

* * * * *