

Anhang 1 zu Eurex-Rundschreiben 052/26

3. Details der Initiative

A. Produktüberblick (neue Produkte)

Basiswerte						
Index	Indextyp	Währung	Dividend reinvestm. *	ISIN	Refinitiv**	Bloomberg**
MSCI USA Enhanced Value	Factor	USD	NTR	GB00BVC81F00	.dMIUS000EVNUS	M1USEV
MSCI USA High Dividend Yield	Factor	USD	NTR	GB00BVC81G17	.dMIUS0000ZNUS	M1CXNNA
MSCI USA Minimum Volatility	Factor	USD	NTR	GB00BVC81H24	.dMIUS0000YNUS	M1CXAAE
MSCI Europe Enhanced Value	Factor	EUR	NTR	GB00BVC81J48	.dMIEU000EVNEU	M7EUEV
MSCI Europe Equal Weighted	Factor	EUR	NTR	GB00BVC81K52	.dMIEU0000ENEU	M7EUEWE
MSCI Europe High Dividend Yield	Factor	EUR	NTR	GB00BVC81L69	.dMYEU00000NEU	M7EUHDVD
MSCI Europe Minimum Volatility	Factor	EUR	NTR	GB00BQTY5Z49	.dMIEU0000YNEU	M3EUMINV
MSCI Europe Momentum	Factor	EUR	NTR	GB00BVC81M76	.dMIEU0MOM0NEU	MAEUMMT
MSCI Europe Quality	Factor	EUR	NTR	GB00BVC81N83	.dMIEU0000vNEU	M7EUQU

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

** Für diese Indizes gibt es auch eine Realtime-Berechnung unter separater Ticker-Kennung, für die finale Abrechnung ist jedoch der End-of-Day-Index relevant.

Eurex Produkte							
Produkt	Index	Indextyp	Währung	Dividend reinvestm. *	ISIN	Eurex Produkt- kürzel	Produkt-typ
Futures	MSCI USA Enhanced Value	Factor	USD	NTR	DE000A4AV7G6	FMUH	FINX
Futures	MSCI USA High Dividend Yield	Factor	USD	NTR	DE000A4AV7H4	FMUD	FINX
Futures	MSCI USA Minimum Volatility	Factor	USD	NTR	DE000A4AV7J0	FMUO	FINX
Futures	MSCI Europe Enhanced Value	Factor	EUR	NTR	DE000A4AV7K8	FMLV	FINX
Futures	MSCI Europe Equal Weighted	Factor	EUR	NTR	DE000A4AV7L6	FMLE	FINX
Futures	MSCI Europe High Dividend Yield	Factor	EUR	NTR	DE000A4AV7M4	FMLD	FINX
Futures	MSCI Europe Minimum Volatility	Factor	EUR	NTR	DE000A4AV7N2	FMLO	FINX
Futures	MSCI Europe Momentum	Factor	EUR	NTR	DE000A4AV7P7	FMLM	FINX
Futures	MSCI Europe Quality	Factor	EUR	NTR	DE000A4AV7Q5	FMLQ	FINX

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

Produktüberblick (Einführung von wöchentlichen Verfällen)

Eurex Produkte							
Produkt	Index	Indextyp	Währung	Dividend reinvestm. *	ISIN	Eurex Produkt- kürzel	Produkt- typ
Options	MSCI EAFE	Standard	USD	Price	DE000A2DB9F7	OMFP	OINX
Options	MSCI World	Standard	USD	NTR	DE000A1RRXK5	OMWO	OINX
Options	MSCI World	Standard	USD	Price	DE000A11Q4A0	OMWP	OINX
Options	MSCI World	Standard	EUR	NTR	DE000A11Q4B8	OMWN	OINX
Options	MSCI Emerging Markets	Standard	USD	Price	DE000A11Q380	OMEF	OINX

B. Kontraktsspezifikationen

Beschreibung des Basiswerts	Eine detaillierte Beschreibung des Index-Regelwerks ist auf der MSCI-Website unter www.msci.com zu finden.
Kontraktwert	Siehe nachfolgende Tabelle
Abrechnung	Durch Barausgleich, fällig am ersten Börsentag nach dem Schlussabrechnungstag.
Preisermittlung	In Punkten, mit drei Dezimalstellen (Futures) bzw. zwei Dezimalstellen (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. Auch bei den MSCI-Optionen ist die minimale Preisveränderung bei Eingaben über Eurex T7-Trade-Entry-Services (TES) in der Regel geringer
Laufzeiten	Futures: Die nächsten zwölf Quartalsmonate aus dem Zyklus März, Juni, September und Dezember (36 Monate) Optionen (mit wöchentlichen Verfällen): Bis zu sechs wöchentlich Verfälle, drei monatliche Verfälle, acht danach liegende Quartalsverfalltage (März, Juni, September, Dezember), zwei halbjährliche Verfälle (Juni, Dezember), sowie zwei jährliche Verfälle (Dezember) (bis zu 60 Monaten)
Letzter Handelstag/Schlussabrechnungstag	Der jeweilige Freitag (wöchentliche Verfälle) bzw. 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 USA Enhanced Value	FMUH	10 USD	1	10	1	1.000
Futures	MSCI USA High Dividend Yield	FMUD	10 USD	1	10	1	1.000
Futures	MSCI USA Minimum Volatility	FMUO	10 USD	1	10	1	1.000
Futures	MSCI Europe Enhanced Value	FMLV	10 EUR	1	10	1	1.000
Futures	MSCI Europe Equal Weighted	FMLE	10 EUR	1	10	1	1.000
Futures	MSCI Europe High Dividend Yield	FMLD	10 EUR	1	10	1	1.000
Futures	MSCI Europe Minimum Volatility	FMLO	10 EUR	1	10	1	1.000
Futures	MSCI Europe Momentum	FMLM	10 EUR	1	10	1	1.000
Futures	MSCI Europe Quality	FMLQ	10 EUR	1	10	1	1.000

* MBTS = Minimum Block Trade Size / ** NDL = Non-disclosure limit (untertägiges 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		02:15-22:00 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 group *
MSCI USA Enhanced Value	E/I Futures/Options in USD	Nein	Nicht für US-Handel zugelassen	bar	F/O	Equity index	USD	Cash Section 871m USD
MSCI USA High Dividend Yield								Cash USD
MSCI USA Minimum Volatility								
MSCI Europe Enhanced Value								
MSCI Europe Equal Weighted								

Produkt	Produktgruppe	Abwicklungs- lokations- einheit	Regulatori- scher Status	Abwicklungs- Art	Produktart	Produkt- segment	Produkt- währung	Capacity group *
MSCI Europe High Dividend Yield	E/I Futures/Opt ions in EUR							
MSCI Europe Minimum Volatility								
MSCI Europe Momentum								
MSCI Europe Quality								

* weitere Informationen zu Section 871(m) IRC im Rundschreiben

(...)

I. Transaktionsentgelte

Produkt/ Produktgruppe	Währung	Ausführungsart	Konten	Standard-Entgelt pro Kontrakt (Kontraktvolumen ≤ Schwellenwert)	Reduziertes Entgelt pro Kontrakt (Kontraktvolumen > Schwellenwert)	Schwellenwert (Anzahl Kontrakte)
MSCI-Futures	USD	Order book	A/P/M	0,70	n.a.	n.a.
		EnLight/ TES	A/P/M	1,00	n.a.	n.a.
MSCI-Futures	EUR	Order book	A/P/M	0,70	n.a.	n.a.
		EnLight/ TES	A/P/M	1,00	n.a.	n.a.
MSCI Options (denominated in USD)	USD	Order book	A	0,58	0,29	3.000
			P	0,50	0,25	2.000
			M	0,50	n. a.	n. a.
		EnLight/ TES	A	0,58	0,29	3.000
			P	0,50	0,25	2.000
			M	0,50	n. a.	n. a.
MSCI Options (denominated in EUR)	EUR	Order book	A	0,58	0,29	3.000
			P	0,50	0,25	2.000

Produkt/ Produktgruppe	Währung	Ausführungsart	Konten	Standard-Entgelt pro Kontrakt (Kontraktvolumen ≤ Schwellenwert)	Reduziertes Entgelt pro Kontrakt (Kontraktvolumen > Schwellenwert)	Schwellenwert (Anzahl Kontrakte)
			M	0,50	n. a.	n. a.
		EnLight/ TES	A	0,58	0,29	3.000
			P	0,50	0,25	2.000
			M	0,50	n. a.	n. a.