

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

Index Total Return Futures: Anpassung der Berechnungsparameter auf T+1 von T+2 für MSCI World Index Total Return 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 28.05.2024 in Kraft.

Die Änderungssatzung kann auf der Internetseite der Eurex Deutschland (<https://www.eurex.com/ex-de/>) 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:

EINFÜGUNGEN 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

[...]

1.22.6.5 Tage bis zur Fälligkeit, Funding Days

[...]

Für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte liegen den Tagen bis zur Fälligkeit und den Funding Days, ausgedrückt als tatsächliche Anzahl an Tagen, die Abrechnungstage der zugrundeliegenden enthaltenen Aktien (d.h. auf einer $t+x2$ Abrechnungsbasis) zugrunde, demzufolge gilt:

[...]

Bei Für in EUR, GBP/GBX und USD denominierten Index-Total-Return-Futures-Kontrakten gilt Folgendes:

x Abrechnungstage = 2 Abrechnungstage

Abweichend hiervon gilt für in USD denominierte Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den MSCI World Index Folgendes:

x Abrechnungstage = 1 Abrechnungstag

Zur Klarstellung: Alle Begriffe, die in diesem Teilabschnitt verwendet werden, gelten ausschließlich für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte.

[...]

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 28.05.2024 in Kraft.

Frankfurt am Main, 23.05.2024

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters