
ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

EINFÜGUNGEN SIND UNTERTRICHEN;

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

3.2.6 Trade-at-Market Geschäfte („TAM“)

(1) Für TAM zugelassene Kontrakte

Folgende Kontrakte sind zugelassen:

Produkt	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte
Index-Total-Return-Futures	
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® 50 Index (TESX) und EURO STOXX® Banks Index (TESB)	100
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® Select Dividend 30 Index (TEDV)	10
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den FTSE® 100 (TTUK)	50
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf die iStoxx Europe Collateral Indizes (TCBX and TC1L)	100
Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf MSCI Indizes (TMWO, TMFA, TMEM)	10
Als Basket-Geschäfte gehandelte Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte gemäß Ziffer 3.2.7	n.a.

Bei Eingabe eines Trade-at-Market Geschäfts ist die Angabe eines in diesem Produkt gültigen Basiswertes durch die in dem Geschäft beteiligten Börsenteilnehmer erforderlich.

(2) Besondere Bestimmungen für TAM-Geschäfte mit Index-Total-Return-Futures

Werden die Bedingungen eines TAM-Geschäfts unter Bezugnahme auf einen offiziellen täglichen Indexschlusskurs als „Custom Underlying Level“ vereinbart und

ist dieser offizielle tägliche Indexschlusskurs während der Off-Book-Trading-Periode gemäß Annex C der Kontraktsspezifikationen am Handelstag (t) dieses Kontrakts nicht verfügbar, wird das TAM-Geschäft entsprechend am nächsten Handelstag (t+1) eingegeben, sodass:

- der TRF-Spread für den Index-Total-Return-Futures-Kontrakt wie vereinbart unter Bezugnahme auf den Handelstag (t) eingegeben wird,
- der gehandelte Futures-Preis (t+1) dem gehandelten Futures-Preis (t) entspricht, so wie er gemäß Ziffer 1.22.8 unter Bezugnahme auf den offiziellen täglichen Indexschlusskurs (t), der als Custom Underlying Level eingegeben wird, berechnet worden wäre („theoretischer gehandelter Futures-Preis (t)“),
- die Börsenteilnehmer ein angepasstes Custom Underlying Level (t+1) bestimmen und vereinbaren, sodass der gemäß Ziffer 1.22.8 berechnete gehandelte Futures-Preis (t+1) dem theoretischen gehandelten Futures-Preis (t) entspricht.

Dabei gilt:

t = vereinbarter Referenzhandelstag (des offiziellen täglichen Indexschlusskurses), und

t+1 = dem vereinbarten Referenzhandelstag unmittelbar folgender Handelstag

[...]
