

# *Bekanntmachung der Eurex Deutschland*

**MSCI-Indexderivate: Einführung von weiteren Futures, Änderung der Tick-Größen, Umbenennung der MSCI ESG Screened-Derivate**

**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 27.01.2025 in Kraft.

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

EINFÜGUNGEN SIND UNTERSTRICHEN;

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

## Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

[...]

### Teilabschnitt 1.3 Kontraktsspezifikationen für Index-Futures-Kontrakte

Der folgende Teilabschnitt enthält die Kontraktgestaltung für Futures-Kontrakte auf Aktienindizes („Index-Futures-Kontrakte“).

#### 1.3.1 Kontraktgegenstand

[...]

(2) [...]

- Die folgenden MSCI Indizes (zusammen mit den MSCI EM Sector Indizes, den MSCI World Sector Indizes und den MSCI Europe Sector Indizes, wie in Abs. 2a, 2b und 2c definiert, für die Zwecke der Index-Futures-Kontrakte die „MSCI Indizes“):

- [...]
- MSCI Emerging Markets Latin America ex Brazil (USD, NTR) (MSCI Inc.)
- MSCI Emerging Markets Small Cap (NTR, USD) (MSCI Inc.)
- MSCI Emerging Markets Asia Small Cap (NTR, USD) (MSCI Inc.)
- MSCI Emerging Markets EMEA Small Cap (NTR, USD) (MSCI Inc.)
- MSCI Emerging Markets Latin America Small Cap (NTR, USD) (MSCI Inc.)
- [...]
- MSCI India (MSCI Inc.)
- MSCI India Banks (MSCI Inc.)
- [...]
- MSCI Sweden (USD, NTR) (MSCI Inc.)
- MSCI Sweden IMI (NTR, SEK) (MSCI Inc.)
- [...]

[...]

(6) Der Wert eines Kontrakts beträgt:

- [...]
- JPY 1000 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den MSCI Japan (NTR, JPY) Index
- SEK 100 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den MSCI Sweden (NTR, SEK) Index
- [...]

[...]

- USD 10 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den EURO STOXX 50® Index (Produkt-ID: FESQ; das Produkt FESQ ist ein Quanto-Future, d.h. die Produktwährung (USD) unterscheidet sich von der Währung des Index (EURO STOXX 50® Index, berechnet in EUR)), FTSE® All-World Index (NTR, USD), MSCI AC ASEAN (NTR, USD), MSCI Australia Index, MSCI Canada (GTR, USD), MSCI China Tech 100 Index, MSCI Colombia Index, MSCI EAFE (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Asia ex China, MSCI Emerging Markets ex China, MSCI Emerging Markets Asia ex Korea (NTR, USD), MSCI Emerging Markets ESG Enhanced Focus CTB, MSCI Emerging Markets Latin America ex Brazil (USD, NTR), MSCI Emerging Markets Small Cap (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Asia Small Cap (NTR, USD), MSCI Emerging Markets EMEA Small Cap (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Latin America Small Cap (NTR, USD), MSCI Europe Index (NTR, USD), MSCI India Banks (NTR, USD), MSCI Indonesia, MSCI Japan ESG Enhanced Focus CTB, MSCI Japan Index (NTR, USD), MSCI Kokusai Index (NTR), MSCI Kuwait Index, MSCI North America (GTR, USD), MSCI North America (NTR, USD), MSCI North America SMID (NTR, USD), MSCI Pacific Index (NTR), MSCI Pacific ex Japan, MSCI Peru Index, MSCI Qatar, MSCI Saudi Arabia (USD, NTR) (Futures auf MSCI Saudi Arabia können im Orderbuch nur in Vielfachen von 5 Kontrakten gehandelt werden), MSCI Thailand Index, MSCI United Kingdom (NTR, USD), MSCI USA ESG Enhanced Focus CTB, MSCI USA (GTR, USD), MSCI USA (NTR, USD) Index, MSCI USA Equal Weighted Index, MSCI USA Momentum Index, MSCI USA Quality Index, MSCI USA Value Weighted Index, MSCI World ESG Enhanced Focus CTB, MSCI World ex USA, MSCI World Growth (NTR, USD), MSCI World Value (NTR, USD), MSCI World Enhanced Value (NTR, USD), MSCI World Growth Target (NTR, USD), MSCI World Momentum (NTR, USD), MSCI World Equal Weighted (NTR, USD), MSCI World Quality (NTR, USD), MSCI World High Dividend Yield (NTR, USD), MSCI World Minimum Volatility (NTR, USD), den MSCI World Index (NTR & Price, USD), den MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened Index, den MSCI USA ESG Screened Index, den MSCI World ESG Screened Index, den MSCI EM ESG Screened Index, den MSCI EAFE ESG Screened Index, den MSCI Japan ESG Screened Index, den MSCI USA SRI Index, den MSCI World SRI Index, den MSCI EM SRI Index und STOXX Global Thematic Indizes

[...]

[...]

### 1.3.5 Preisabstufungen

#### 1.3.5.1 Generelle Preisabstufungen für Index-Futures-Kontrakte

[...]

- 0,5 Punkte bei
    - [...]
    - MSCI China Tech 100, MSCI EM Asia ex Korea, MSCI Emerging Markets ex China, MSCI Emerging Markets ESG Enhanced Focus CTB, MSCI Emerging Markets Latin America ex Brazil (USD, NTR), MSCI Emerging Markets Small Cap (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Asia Small Cap (NTR, USD), MSCI Emerging Markets EMEA Small Cap (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Latin America Small Cap (NTR, USD), MSCI India Banks (NTR, USD), MSCI Indonesia, MSCI Japan ESG Enhanced Focus CTB, MSCI Kuwait, MSCI North America SMID, MSCI Peru, MSCI Qatar, MSCI Saudi Arabia (USD, NTR), MSCI Thailand, MSCI USA ESG Enhanced Focus CTB, MSCI World ESG Enhanced Focus CTB und MSCI World (Price, USD), STOXX Global Thematic Indizes, dies entspricht einem Wert von USD 5,00
    - MSCI Japan (NTR, JPY), dies entspricht einem Wert von JPY 500,00
    - MSCI Sweden IMI (NTR, SEK), dies entspricht einem Wert von SEK 50,00
    - [...]
- [...]

#### 1.3.5.2 Preisabstufungen bei Standardisierten Futures-Strategien

[...]

- 0,01 Punkte bei
  - MSCI Europe (NTR, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR 1
  - MSCI Europe (Price, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR 1
  - MSCI EMU (NTR, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR 1
  - MSCI Emerging Markets EMEA (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 1
  - [...]
- 0,02 Punkte bei
  - [...]
  - MSCI Brazil (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2
  - MSCI China (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 1
  - [...]
  - ~~MSCI Emerging Markets EMEA (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2~~
  - MSCI Emerging Markets Latin America (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2
  - MSCI Taiwan (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2
  - [...]

■ 0,05 Punkte bei

- ~~– MSCI China (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2,5~~
- [...]
- ~~– MSCI Emerging Markets Index (Price, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2,5~~
- ~~– MSCI India (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 5~~
- ~~– MSCI Thailand (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 0.5~~

■ 0,1 Punkte bei

- ~~– MSCI EM ESG Screened (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 1~~
- ~~– MSCI Saudi Arabia (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 1~~
- MSCI World (Price, USD), dies entspricht einem Wert von USD 1

■ 0,2 Punkte bei

- ~~– MSCI Australia (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2~~
- ~~– MSCI Europe (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2~~
- ~~– MSCI Japan (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2~~
- ~~– MSCI Pacific (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2~~
- ~~– MSCI Pacific ex Japan (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 2~~
- [...]

■ 0,5 Punkte bei

- [...]
- ~~– MSCI Europe (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 5~~
- ~~– MSCI Japan (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 5~~
- [...]

[...]

### Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

#### Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

##### 3.2.1 Blockgeschäfte

[...]

Produkt	Zusätzliche Kontraktvarianten J/N	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte	
		TES	Eurex EnLight und von QTPIP getätigte Eingaben *
[...]			
Aktienindex-Futures			
[...]			
Futures-Kontrakte auf den MSCI EM Sector Indizes (NTR, USD) (FMHC, FMMF, FMMH, FMMI, FMML, FMMR, FMMT, FMMQ, FMMZ)	J		5
<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI EM Small Cap Index (FMTM)</u>	<u>J</u>		<u>5</u>
<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI EM Asia Small Cap Index (FMTA)</u>	<u>J</u>		<u>5</u>
<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI EM EMEA Small Cap Index (FMTE)</u>	<u>J</u>		<u>5</u>
<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI EM Latin America Small Cap Index (FMTL)</u>	<u>J</u>		<u>5</u>
[...]			
Futures-Kontrakte auf den MSCI India Index (FMIN)	J		10
<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI India Banks Index (FMIB)</u>	<u>J</u>		<u>5</u>
[...]			
Futures-Kontrakte auf den MSCI Sweden Index (FMSD)	J		10
<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI Sweden IMI Index (NTR, SEK) (FMSB)</u>	<u>J</u>		<u>5</u>
[...]			

\* Als von QTPIP getätigte Eingaben gelten Eingaben gemäß Ziffer 4.6 (3) der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland. Für Eingaben von STPIP gemäß Ziffer 4.6 (2) der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland gelten die Bestimmungen für die Eingabe von TES Geschäften.

[...]

\*\*\*\*\*

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 27.01.2025 in Kraft.

Frankfurt am Main, 06.01.2025

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Robbert Booij