

[.....]

## Abschnitt 2

### Clearing von Futures-Kontrakten

Die nachfolgenden Teilabschnitte regeln das Clearing von Geschäften in den in Ziffer 1 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Futures-Kontrakte.

[.....]

#### 2.4 Teilabschnitt Clearing von Index-Futures-Kontrakten

[.....]

##### 2.4.2 Schlussabrechnungspreis

Der Schlussabrechnungspreis der Index-Futures-Kontrakte wird von der Eurex Clearing AG am Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.3.4 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich) eines Kontrakts festgelegt.

- (1) Maßgebend für die DAX<sup>®</sup> -, MDAX<sup>®</sup> - und TecDAX<sup>®</sup> -Futures-Kontrakte ist der Wert des jeweiligen Index auf Grundlage der mittels des elektronischen Handelssystems der Frankfurter Wertpapierbörse ermittelten Auktionspreise für die im jeweiligen Index enthaltenen Wertpapiere einer von den Geschäftsführungen der Eurex-Börsen bestimmten untertägigen Auktion.
- (2) Maßgebend für die OMXH25-Futures-Kontrakte ist der Wert des Index auf Grundlage der durchschnittlichen Preise der im OMXH25 enthaltenen Aktien, soweit diesen Preisen ein Geschäft mit einer Mindestanzahl der jeweiligen im OMXH25 enthaltenen Aktie zugrunde liegt, gewichtet nach dem Volumen der Transaktionen, die an der Helsinki Stock Exchange seit dem Handelsbeginn im fortlaufenden Handel des elektronischen Handelssystems der Helsinki Stock Exchange am Schlussabrechnungstag gehandelt werden.
- (3) Maßgebend für die SMI<sup>®</sup> -Futures-Kontrakte ist der Wert des Index auf der Grundlage der mittels des elektronischen Handelssystems der virt-x im Rahmen der Eröffnungsauktion für die im SMI<sup>®</sup> enthaltenen Wertpapiere und Wertrechte ermittelten Preise. Maßgebend für die SMIM<sup>®</sup> -Futures-Kontrakte ist der Wert des Index auf der Grundlage der mittels des elektronischen Handelssystems der SWX Schweizer Börse bzw. der virt-x für die im SMIM<sup>®</sup> enthaltenen Wertpapiere und Wertrechte ermittelten Eröffnungspreise.

- (4) Maßgebend für die Dow Jones EURO STOXX<sup>®</sup> 50 Index, [Dow Jones EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 Index](#), Dow Jones STOXX<sup>®</sup> 50 Index, Dow Jones STOXX<sup>®</sup> 600 Index, [Dow Jones STOXX<sup>®</sup> Large 200 Index](#), Dow Jones STOXX<sup>®</sup> Mid 200 Index, [Dow Jones STOXX<sup>®</sup> Small 200 Index](#) sowie Dow Jones EURO STOXX<sup>®</sup> Sector Index und Dow Jones STOXX<sup>®</sup> 600 Sector Index Futures-Kontrakte ist der Wert des jeweiligen Index auf der Grundlage des Durchschnitts der jeweiligen Dow Jones STOXX<sup>®</sup> Indizes-Berechnungen an diesem Tag in der Zeit von 11:50 Uhr MEZ bis 12:00 Uhr MEZ.
- (5) Maßgebend für die Dow Jones Global Titans 50<sup>SM</sup> Index Futures-Kontrakte ist der Wert des Index auf der Grundlage des Durchschnitts der Dow Jones Global Titans 50<sup>SM</sup> Index-Berechnungen an diesem Tag in der Zeit von 16:50 Uhr MEZ bis 17:00 Uhr MEZ.
- (6) Maßgebend für die Dow Jones Italy Titans 30<sup>SM</sup> Index Futures-Kontrakte ist der Wert des Index auf Grundlage der mittels des elektronischen Handelssystems der Borsa Italiana im Rahmen der Eröffnungsauktion für die im Dow Jones Italy Titans 30<sup>SM</sup> Index enthaltene Wertpapiere und Wertrechte ermittelten Preise.
- (7) Maßgebend für die RDXxt<sup>®</sup> USD – RDX Extended Index Futures-Kontrakte ist der Wert des jeweiligen Index auf der Grundlage der mittels des elektronischen Handelssystems der London Stock Exchange im Rahmen der Schlussauktion für die im RDXxt<sup>®</sup> USD – RDX Extended Index enthaltenen Wertpapiere und Wertrechte ermittelten Preise.
- (8) Sollten außergewöhnliche Umstände vorliegen, insbesondere wenn aufgrund technischer Probleme der Handel aussetzt oder wenn es aus sonstigen Gründen nicht zu einer Preisfeststellung in einem oder mehreren Wertpapieren oder Wertrechten kommt, kann von der Eurex Clearing AG der Schlussabrechnungspreis in einem anderen Verfahren festgelegt werden.

#### 2.4.3 Erfüllung, Lieferung

[.....]

## Abschnitt 3

### Clearing von Optionskontrakten

Die nachfolgenden Teilabschnitte regeln das Clearing von Geschäften in den in Ziffer 2 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich benannten Optionskontrakte.

[...]

#### 3.4 Teilabschnitt Clearing von Indexoptionskontrakten

[.....]

##### 3.4.3 Schlussabrechnungspreis

- (1) Maßgebend für die DAX<sup>®</sup>, MDAX<sup>®</sup> und TecDAX<sup>®</sup>-Optionskontrakte ist der Wert des jeweiligen Index auf Grundlage der mittels des elektronischen Handelssystems der Frankfurter Wertpapierbörse ermittelten Auktionspreise für die im jeweiligen Index enthaltenen Wertpapiere einer von den Geschäftsführungen der Eurex-Börsen bestimmten untertägigen Auktion.
- (2) Maßgebend für die OMXH25-Optionskontrakte ist der Wert des Index auf Grundlage der durchschnittlichen Preise der im OMXH25 enthaltenen Aktien, soweit diesen Preisen ein Geschäft mit einer Mindestanzahl der jeweiligen im OMXH25 enthaltenen Aktie zugrunde liegt, gewichtet nach dem Volumen der Transaktionen, die an der Helsinki Stock Exchange seit dem Handelsbeginn und im fortlaufenden Handel des elektronischen Handelssystems der Helsinki Stock Exchange am Ausübungstag gehandelt werden.
- (3) Maßgebend für die SMI<sup>®</sup>-Optionskontrakte ist der Wert des Index auf der Grundlage der mittels des elektronischen Handelssystems der virt-x im Rahmen der Eröffnungsauktion für die im SMI<sup>®</sup> enthaltenen Wertpapiere und Wertrechte ermittelten Preise. Maßgebend für die SMIM<sup>®</sup>-Optionskontrakte ist der Wert des Index auf der Grundlage der mittels des elektronischen Handelssystems der SWX Schweizer Börse bzw. der virt-x für die im SMIM<sup>®</sup> enthaltenen Wertpapiere und Wertrechte ermittelten Eröffnungspreise.
- (4) Maßgebend für die Dow Jones EURO STOXX<sup>®</sup> 50 Index, [Dow Jones EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 Index](#), Dow Jones STOXX<sup>®</sup> 50 Index, Dow Jones STOXX<sup>®</sup> 600 Index, [Dow Jones STOXX<sup>®</sup> Large 200 Index](#), Dow Jones STOXX<sup>®</sup> Mid 200 Index, [Dow Jones STOXX<sup>®</sup> Small 200 Index](#) sowie Dow Jones EURO STOXX<sup>®</sup> Sector Index und Dow Jones STOXX<sup>®</sup> 600 Sector Index Options-Kontrakte ist der Wert

des jeweiligen Index auf der Grundlage des Durchschnitts der jeweiligen Dow Jones STOXX<sup>®</sup> Indizes-Berechnungen in der Zeit von 11:50 Uhr MEZ bis 12:00 Uhr MEZ.

- (5) Maßgebend für die Dow Jones Global Titans 50<sup>SM</sup> Index Options-Kontrakte ist der Wert des Index auf der Grundlage des Durchschnitts der Dow Jones Global Titans 50<sup>SM</sup> Index-Berechnungen an diesem Tag in der Zeit von 16:50 Uhr MEZ bis 17:00 Uhr MEZ.
- (6) Maßgebend für die Dow Jones Italy Titans 30<sup>SM</sup> Index Options-Kontrakte ist der Wert des Index auf der Grundlage der im elektronischen Handelssystem der Borsa Italiana im Rahmen der Eröffnungsauktion für die im Dow Jones Italy Titans 30<sup>SM</sup> Index enthaltenen Wertpapiere und Wertrechte ermittelten Preise.
- (7) Sollten außergewöhnliche Umstände vorliegen, insbesondere wenn aufgrund technischer Probleme der Handel aussetzt oder wenn es aus sonstigen Gründen nicht zu einer Preisfeststellung in einem oder mehreren Wertpapieren kommt, kann von der Eurex Clearing AG der Schlussabrechnungspreis in einem anderen Verfahren festgelegt werden.

#### 3.4.4 Sicherheitsleistung

[...]