

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

Aktienindexderivate: Aufhebung der Zulassung zum Handel von Futures-Kontrakten auf iSTOXX® Europe Factor-Indizes

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 26.06.2023 in Kraft.

Die Änderungen können 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 1.3 Kontraktsspezifikationen für Index-Futures-Kontrakte

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

1.3.1 Kontraktgegenstand

[...]

- (2) An der Eurex Deutschland stehen Futures-Kontrakte auf folgende Aktienindizes, wobei die Veröffentlichung der anbei genannten Institutionen für die Zusammensetzung, Gewichtung und Berechnung gelten, zur Verfügung:

[...]

- FTSE® 100 Index (FTSE International Limited)
- ~~Die folgenden iSTOXX®-Europe Indizes (für die Zwecke der Index-Futures-Kontrakte „iSTOXX®-Europe Indizes“):~~
 - ~~— iSTOXX®-Europe Low Risk Factor (Net Return, EUR) (STOXX Limited)~~
 - ~~— iSTOXX®-Europe Momentum Factor (Net Return, EUR) (STOXX Limited)~~
 - ~~— iSTOXX®-Europe Quality Factor (Net Return, EUR) (STOXX Limited)~~
 - ~~— iSTOXX®-Europe Size Factor (Net Return, EUR) (STOXX Limited)~~
 - ~~— iSTOXX®-Europe Value Factor (Net Return, EUR) (STOXX Limited)~~
 - ~~— iSTOXX®-Europe Carry Factor (Net Return, EUR) (STOXX Limited)~~

[...]

- (6) Der Wert eines Kontrakts beträgt:

[...]

- EUR 50 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf die EURO STOXX® Sector Indizes, STOXX® Europe 600 Sector Indizes, STOXX® Europe 600 Index,

~~STOXX® Europe Large 200 Index , STOXX® Europe Mid 200 Index , STOXX® Europe Small 200 Index , EURO STOXX® Index, EURO STOXX® Large Index, EURO STOXX® Mid Index, EURO STOXX® Small Index, iSTOXX® Europe Low Risk Factor (Net Return, EUR), iSTOXX® Europe Momentum Factor (Net Return, EUR), iSTOXX® Europe Quality Factor (Net Return, EUR), iSTOXX® Europe Size Factor (Net Return, EUR), iSTOXX® Europe Value Factor (Net Return, EUR), iSTOXX® Europe Carry Factor (Net Return, EUR)~~

[...]

1.3.4 Letzter Handelstag, Schlussabrechnungstag, Handelsschluss

[...]

(3) Handelsschluss an dem letzten Handelstag

[...]

- der

[...]

- EURO STOXX® Select Dividend 30 Index
- ~~iSTOXX® Europe Low Risk Factor (Net Return, EUR)~~
- ~~iSTOXX® Europe Momentum Factor (Net Return, EUR)~~
- ~~iSTOXX® Europe Quality Factor (Net Return, EUR)~~
- ~~iSTOXX® Europe Size Factor (Net Return, EUR)~~
- ~~iSTOXX® Europe Value Factor (Net Return, EUR)~~
- ~~iSTOXX® Europe Carry Factor (Net Return, EUR)~~

[...]

1.3.5 Preisabstufungen

1.3.5.1 Generelle Preisabstufungen für Index-Futures-Kontrakte

Der Preis eines Index-Futures-Kontrakts wird in Punkten ermittelt. Die kleinste Preisveränderung (Tick) beträgt

[...]

- 0,1 Punkte bei

[...]

- ~~iSTOXX® Europe Low Risk Factor (Net Return, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR 5~~
- ~~iSTOXX® Europe Momentum Factor (Net Return, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR 5~~
- ~~iSTOXX® Europe Quality Factor (Net Return, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR 5~~
- ~~iSTOXX® Europe Size Factor (Net Return, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR 5~~

- ~~— iSTOXX® Europe Value Factor (Net Return, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR-5~~
- ~~— iSTOXX® Europe Carry Factor (Net Return, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR-5~~
- [...]

Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

3.2.1 Blockgeschäfte

[...]

Produkt		Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte	
Standard	Zusätzliche Kontraktvarianten J/N	TES	Eurex EnLight und von QTPIP getätigte Eingaben *
[...]			
Aktienindex-Futures			
[...]			
Futures-Kontrakte auf den FTSE® 100 Index (FTUK)	J		500
Futures-Kontrakte auf die iSTOXX® Europe Low Risk, Momentum, Quality, Size, Value und Carry Factor Index	J		10
[...]			

* 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) gelten die Bestimmungen für die Eingabe von TES Geschäften.

[...]

3.2.3 Exchange for Physicals for Index-Futures/FX-Futures („EFP-I“)

Folgende Kontrakte sind zugelassen:

[...]

- Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® Select Dividend 30 Index (FEDV)
- ~~■ Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Low Risk Factor Index (FXFR)~~
- ~~■ Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Momentum Factor Index (FXFM)~~
- ~~■ Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Quality Factor Index (FXFQ)~~
- ~~■ Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Size Factor Index (FXFS)~~
- ~~■ Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Value Factor Index (FXFV)~~
- ~~■ Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Carry Factor Index (FXFC)~~

[...]

3.2.4 Exchange for Swaps („EFS“)

Folgende Kontrakte sind zugelassen:

[...]

- Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® Select Dividend 30 Index (FEDV)
- ~~Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Low Risk Factor Index (FXFR)~~
- ~~Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Momentum Factor Index (FXFM)~~
- ~~Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Quality Factor Index (FXFQ)~~
- ~~Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Size Factor Index (FXFS)~~
- ~~Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Value Factor Index (FXFV)~~
- ~~Futures-Kontrakte auf den iSTOXX® Europe Carry Factor Index (FXFC)~~

[...]

[...]

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 26.06.2023 in Kraft.

Frankfurt am Main, 23.05.2023

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters