

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

Aktienindexderivate: Anpassung der EFP-I-Funktionalität für FTSE Index-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 01.03.2024 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 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.3 Für den Off-Book-Handel zulässige Referenzgeschäfte

[...]

3.3.3 Referenzgeschäfte im Rahmen des EFP-I-Trade-Service

[...]

3.3.3.1 Aktienindex-Futures-Kontrakte

Bei Aktienindex-Futures-Kontrakten gibt es zwei Arten von Geschäften, EFP-I-Geschäfte und TAIC-Geschäfte, deren Anforderungen voneinander unabhängig sind.

a) EFP-I-Geschäfte

Folgende Kombinationen von Referenzinstrument des Referenzgeschäfts und EFP-I-Geschäften sind zulässig:

| | Referenzinstrumente des Referenzgeschäfts | EFP-I-Geschäft |
|--------|---|--|
| [...] | | |
| Fall 4 | <u>Nicht-Eurex* Index-Futures auf FTSE® Indizes</u> | <u>Futures-Kontrakte auf FTSE® Indizes</u> |

* Nicht-Eurex Index-Futures sind in diesem Kontext alle außerhalb der Eurex Deutschland gehandelten Index-Futures-Geschäfte.

[...]

dd) Fall 4: Referenzinstrument des Referenzgeschäfts: Nicht-Eurex Index-Futures
auf FTSE® Indizes

Es bestehen folgende kumulative Bedingungen:

- Dem EFP-I-Geschäft muss ein Referenzgeschäft auf ein entsprechendes Referenzinstrument (wie aus der Tabelle oben ersichtlich) zugrundeliegen.
- Der zugrundeliegende Index und der zugrundeliegende Index des entsprechenden Eurex Index-Futures müssen identisch sein.
- Die Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte entspricht der Mindestanzahl in dem Nicht-Eurex Index-Futures-Geschäft bzw, sofern mehrere erfolgen, den Nicht-Eurex Index-Futures-Geschäften, gegebenenfalls bereinigt um etwaige Unterschiede im Nominalwert dieser Kontrakte.

Im Falle eines EFP-I-Geschäfts in Nicht-Eurex Index-Futures-Kontrakten sind folgende Eingaben erforderlich:

Es muss eine Referenznummer oder eine ID des Referenzgeschäfts verwendet werden, aus der auf Anfrage die folgenden Informationen für das entsprechende Geschäft bzw. die entsprechenden Geschäfte (sofern mehrere erfolgen) hervorgehen:

- Bezeichnung
- Anzahl der Kontrakte bzw. gegebenenfalls der Nominalbetrag
- Preis (Nicht-Eurex Transaction Level)
- Handelsdatum und -zeitpunkt
- Fälligkeit bzw. Verfalltermin

[...]

[...]

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 01.03.2024 in Kraft.

Frankfurt am Main, 20.02.2024

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters