
ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:
EINFÜGUNGEN SIND UNTERSTRICHEN;
LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

3.2.8 Delta Neutral Trade-at-Market-Geschäfte („Delta TAM“)

Delta TAM-Geschäfte bestehen aus einem Total-Return-Futures-Kontrakt, der in Verbindung mit einem Index-Futures-Kontrakt auf denselben zugrunde liegenden Referenzindex oder dasselbe zugrunde liegende Instrument gehandelt wird, so dass es sich um gegenläufige Geschäfte handelt. Die Total-Return-Futures-Kontrakte und die Index-Futures-Kontrakte werden paarweise zugelassen, so dass der Total-Return-Futures-Kontrakt nur mit dem entsprechenden Index-Futures-Kontrakt und mit dem jeweils geltenden Mindestordervolumen gehandelt werden kann.

Folgende Kontraktpaare sind zugelassen:

Produkte		Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte
Index-Total-Return-Futures („TRF“)	Index-Futures-Kontrakte	
<u>Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® 50 Index (TESX)</u>	<u>Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50® Index (FESX)</u>	<u>100</u>
<u>EURO STOXX® Banks Index (TESB)</u>	<u>Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® Banks Index (FESB)</u>	<u>100</u>
<u>Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® Select Dividend 30 Index (TEDV)</u>	<u>Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX® Select Dividend 30 Index (FEDV)</u>	<u>10</u>
<u>Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den FTSE® 100 (TTUK)</u>	<u>Futures-Kontrakte auf den FTSE® 100 (FTUK)</u>	<u>50</u>

Bei Eingabe eines Delta TAM-Geschäfts ist die Eingabe einer gültigen Kombination dazugehöriger Instrumente durch den an dem Geschäft beteiligten Börsenteilnehmer erforderlich und es gelten folgende Handelsmodalitäten:

- Die Anzahl in jedem Instrument der gehandelten Kontrakte darf die festgelegte Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte nicht unterschreiten
- TRF-Spread für den Index-Total-Return-Futures-Kontrakt
- Preis in Indexpunkten für den Index-Futures-Kontrakt
- Custom Index Level für den Index-Total-Return-Futures-Kontrakt
- Basis in Indexpunkten, wie in folgender Formel definiert:

Basis in Indexpunkten = Preis des Index-Futures-Kontrakts – Custom Index Level des Index-Total-Return-Futures-Kontrakts

[...]
