

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

EURO STOXX 50® Index Total Return Futures (TESX): Übergang des Referenz-Refinanzierungssatzes von €STR plus 0,085 Prozent auf €STR (flat)

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 18.10.2021 in Kraft.

Die Änderungen können auf der Internetseite der Eurex Deutschland (<http://www.eurexchange.com>) 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:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

[...]

Teilabschnitt 1.22 Kontraktsspezifikationen für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte

[...]

1.22.6. Handelskonventionen

[...]

1.22.6.3 Funding Rate

Die auf Index-Total-Return-Futures-Kontrakte anwendbare Funding Rate ist der Benchmark-Zinssatz für Overnight-Geschäfte, über die der TRF-Spread ermittelt und gehandelt wird („Funding Rate“).

- Die Funding Rate für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50[®] (SX5E) ist die von der Europäischen Zentralbank (EZB) (als prozentualer Wert) veröffentlichte Euro Short-Term Rate (€STR). Im Hinblick auf die Tage bis zum €STR-Übergangsdatum, jedoch nicht am €STR-Übergangsdatum, zuzüglich des werden die von der Europäischen Zentralbank (EZB) bereitgestellten Spreads zwischen €STR und Eonia[®] (als prozentualer Wert) zum €STR addiert und sind Bestandteil der jeweiligen Funding Rate.
- Die Funding Rate für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50[®] Banks (SX7E) und EURO STOXX[®] Select Dividend 30 (SD3E) ist die von der Europäischen Zentralbank (EZB) (als prozentualer Wert) veröffentlichte Euro Short-Term Rate (€STR)
- Die Funding Rate für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf iStoxx Europe Collateral Indizes ist die von der Europäischen Zentralbank (EZB) (als prozentualer Wert) veröffentlichte Euro Short-Term Rate (€STR)

- Die Funding Rate für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den FTSE® 100 ist der von der Bank of England (als prozentualer Wert) veröffentlichte Sterling Overnight Index Average (SONIA)

Das „€STR-Übergangsdatum“ ist der 18.10.2021. Zur Sicherstellung ordnungsgemäßer Handelsbedingungen kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland den Termin verschieben; eine solche Verschiebung wird durch Bekanntmachung veröffentlicht.

[...]

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 18.10.2021 in Kraft.

Frankfurt am Main, 17.09.2021

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters