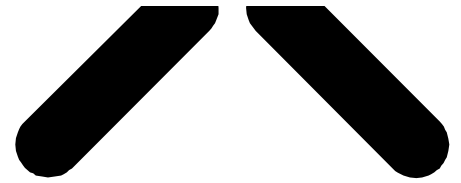


X-pand into the Future



eurex *Bekanntmachung*

**Aktienindexderivate: Einführung von Futures auf
iSTOXX® Europe Factor-Indizes**

**Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der
Eurex Deutschland und der Eurex Zürich (eurex14)**

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland hat die nachfolgende Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich beschlossen.

Sie tritt mit Wirkung zum 03.05.2017 in Kraft.

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

1. Abschnitt: Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

[...]

1.3 Teilabschnitt: Kontraktsspezifikationen für Index-Futures-Kontrakte

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

1.3.1 Kontraktgegenstand

- (1) Ein Index-Futures-Kontrakt ist ein Terminkontrakt auf einen bestimmten Aktienindex.
- (2) An den Eurex-Börsen stehen Futures-Kontrakte auf folgende Aktienindizes, wobei die Veröffentlichung der anbei genannten Institutionen für die Zusammensetzung, Gewichtung und Berechnung gelten, zur Verfügung:

[...]

§ EURO STOXX 50[®] ex Financials Index (STOXX Limited)

§ EURO STOXX 50[®] Index (STOXX Limited)

§ EURO STOXX[®] Index (STOXX Limited)

§ EURO STOXX[®] Large Index (STOXX Limited)

§ EURO STOXX[®] Mid Index (STOXX Limited)

§ EURO STOXX[®] Select Dividend 30 Index (STOXX Limited)

§ EURO STOXX[®] Small Index (STOXX Limited)

§ [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 \(Net Return, EUR\) \(STOXX Limited\)](#)

§ MDAX® (Deutsche Börse AG)

[...]

[...]

(5) 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 (~~Produkt ID: FXXP~~), STOXX® Europe Large 200 Index (~~Produkt ID: FLCF~~), STOXX® Europe Mid 200 Index (~~Produkt ID: FMCF~~), STOXX® Europe Small 200 Index (~~Produkt ID: FSCF~~), 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

[...]

(4) Handelsschluss an dem letzten Handelstag

§ der DAX®, Mini-DAX®, MDAX®, TecDAX®- und DivDAX®-Futures-Kontrakte ist der Beginn der Aufrufphase der von den Geschäftsführungen der Eurex-Börsen bestimmten untertägigen Auktionen im elektronischen Handelssystem der Frankfurter Wertpapierbörse

§ der OMXH25-Futures-Kontrakte ist der Handelsschluss des fortlaufenden elektronischen Handels an der Helsinki Stock Exchange

§ der SMI®-Futures-Kontrakte, der SLI®-Futures-Kontrakte und der SMIM® - Futures-Kontrakte 9:00 Uhr MEZ

§ der

- EURO STOXX 50® ex Financials Index
- EURO STOXX 50® Index (Produkt ID: FESX)
- EURO STOXX 50® Index (Produkt ID: FESQ)
- EURO STOXX® Index
- EURO STOXX® Large Index
- EURO STOXX® Mid Index
- EURO STOXX® Small Index
- EURO STOXX® Sector Index
- 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)
 - STOXX® Europe 50 Index
 - STOXX® Europe Large 200 Index (Produkt ID: FLCP)
 - STOXX® Europe Mid 200 Index (Produkt ID: FMCP)
 - STOXX® Europe Small 200 Index (Produkt ID: FSCP)
 - STOXX® Europe 600 Index (Produkt ID: FXXP)
 - STOXX® Europe 600 Sector Index
- Futures-Kontrakte ist 12:00 Uhr MEZ
- [...]

1.3.5 Preisabstufungen

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

- § 0,05 Punkte bei
- DivDAX®, dies entspricht einem Wert von 10 EUR
 - MSCI ACWI Index (NTR, EUR), MSCI EMU Index (GTR, EUR), MSCI EMU (NTR, EUR), MSCI Europe (GTR, EUR), MSCI Europe (NTR & Price, EUR), MSCI Europe ex Switzerland, MSCI Europe Growth und MSCI Europe Value, MSCI France (GTR, EUR), MSCI France (NTR, EUR), MSCI World Index (GTR, EUR), dies entspricht einem Wert von 5 EUR
 - MSCI ACWI (NTR, USD) und MSCI ACWI ex USA, dies entspricht einem Wert von 5 USD
- § 0,1 Punkte bei
- OMXH25, dies entspricht einem Wert von EUR 1
 - EURO STOXX® Sectors, dies entspricht einem Wert von EUR 5
 - STOXX® Europe 600 Sectors, dies entspricht einem Wert von EUR 5
 - STOXX® Europe 600 (~~Produkt ID: FXXP~~), dies entspricht einem Wert von EUR 5
 - STOXX® Europe Large 200 (~~Produkt ID: FLCP~~), dies entspricht einem Wert von EUR 5
 - STOXX® Europe Mid 200 (~~Produkt ID: FMCP~~), dies entspricht einem Wert von EUR 5
 - STOXX® Europe Small 200 (~~Produkt ID: FSCP~~), dies entspricht einem Wert von EUR 5
 - EURO STOXX®, dies entspricht einem Wert von EUR 5
 - EURO STOXX® Large, dies entspricht einem Wert von EUR 5
 - EURO STOXX® Mid, dies entspricht einem Wert von EUR 5
 - EURO STOXX® Small, dies entspricht einem Wert von EUR 5
 - 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

- SLI®, dies entspricht einem Wert von CHF 1

- MSCI Emerging Markets (NTR, EUR) und MSCI World (NTR, EUR), dies entspricht einem Wert von EUR 10

[...]

[...]

Annex C zu den Kontraktsspezifikationen:

Handelszeiten Futures-Kontrakte

Index-Futures-Kontrakte

| Produkt | Produkt-ID | Pre-Trading-Periode | Fortlaufender Handel | Post-Trading Full-Periode | TES Block Trading | Letzter Handelstag | |
|---|-------------|---------------------|----------------------|---------------------------|--------------------|--------------------|--|
| | | | | | | Handel bis | |
| [...] | | | | | | | |
| <u>iSTOXX® Europe Low Risk Factor Index Futures</u> | <u>FXFR</u> | <u>07:30-07:50</u> | <u>07:50-22:00</u> | <u>22:00-22:30</u> | <u>08:00-22:00</u> | <u>12:00</u> | |
| <u>iSTOXX® Europe Momentum Factor Index Futures</u> | <u>FXFM</u> | <u>07:30-07:50</u> | <u>07:50-22:00</u> | <u>22:00-22:30</u> | <u>08:00-22:00</u> | <u>12:00</u> | |
| <u>iSTOXX® Europe Quality Factor Index Futures</u> | <u>FXFQ</u> | <u>07:30-07:50</u> | <u>07:50-22:00</u> | <u>22:00-22:30</u> | <u>08:00-22:00</u> | <u>12:00</u> | |
| <u>iSTOXX® Europe Size Factor Index Futures</u> | <u>FXFS</u> | <u>07:30-07:50</u> | <u>07:50-22:00</u> | <u>22:00-22:30</u> | <u>08:00-22:00</u> | <u>12:00</u> | |
| <u>iSTOXX® Europe Value Factor Index Futures</u> | <u>FXFV</u> | <u>07:30-07:50</u> | <u>07:50-22:00</u> | <u>22:00-22:30</u> | <u>08:00-22:00</u> | <u>12:00</u> | |
| <u>iSTOXX® Europe Carry Factor Index Futures</u> | <u>FXFC</u> | <u>07:30-07:50</u> | <u>07:50-22:00</u> | <u>22:00-22:30</u> | <u>08:00-22:00</u> | <u>12:00</u> | |
| [...] | | | | | | | |

[...]

Die vorstehende Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich wird hiermit ausgefertigt. Die Änderung tritt dem Beschluss der Geschäftsführung der Eurex Deutschland entsprechend am 03.05.2017 in Kraft.

Frankfurt am Main, 07.04.2017

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Mehtap Dinc

Michael Peters