

X-pand into the Future



eurex *Bekanntmachung*

EURO STOXX® Index Total Return Futures (TESX):

Laufzeitenverlängerung und Änderung der Enhanced-Designated Market-Making-Obligationen

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 10.07.2017 in Kraft.

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

**1. Abschnitt:
Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte**

[...]

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

[...]

[...]

1.22.2 Verpflichtung zur Erfüllung

Nach Handelsschluss in dem Kontrakt ist der Verkäufer eines Index-Total-Return-Futures-Kontrakts dazu verpflichtet, die Differenz zwischen dem vereinbarten Preis und dem höheren Schlussabrechnungspreis (Kapitel II, Abschnitt 2, Ziffer 2.22~~3~~.3 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG) in bar auszugleichen. Der Käufer ist verpflichtet, die Differenz zwischen dem vereinbarten Preis und dem niedrigeren Schlussabrechnungspreis in bar auszugleichen.

1.22.3 Laufzeit

Für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50® (Produkt-ID: TESX) stehen an den Eurex-Börsen Laufzeiten bis maximal 9 Jahre und 11 Monaten zur Verfügung, jeweils bis zum Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.23.4 Absatz 2) der nächsten einundzwanzig Quartalsmonate (März, Juni, September, Dezember) sowie der nächsten fünf aufeinanderfolgenden Jahresverfälle (Dezember) zur Verfügung.

[...]

1.22.8.4 Täglicher Abrechnungspreis

Der tägliche Abrechnungspreis für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte wird unter Verwendung der oben in Ziffer 1.23.8.1 und Ziffer 1.23.8.3 für Trade at Index Close

(TAIC) beschriebenen Methodologie berechnet. Anstelle des gehandelten TRF-Spreads wird ein Täglicher-Abrechnungs-TRF-Spread für die tägliche Abrechnung ermittelt und zusammen mit dem anwendbaren Indexstand und der Zeit bis zur Fälligkeit zur Berechnung einer Abrechnungsbasis (wie in Kapitel II Abschnitt 2 Ziffer 2.2322.2 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG definiert) in Indexpunkten verwendet. Die Abrechnungsbasis wird in Verbindung mit den Accrued Distributions und des Accrued Fundings zur Berechnung des täglichen Abrechnungspreises in Indexpunkten verwendet.

[...]

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 10.07.2017 in Kraft.

Frankfurt am Main, 03.07.2017

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Mehtap Dinc

Michael Peters