

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

MSCI-Derivate: Einführung von weiteren Produkten und Anpassungen in Liquidity Provider-Programmen

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 07.11.2022 in Kraft.

Die Änderungen können 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:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN,

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN.

[...]

Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

[...]

Teilabschnitt 1.3 Kontraktsspezifikationen für Index-Futures-Kontrakte

[...]

1.3.1 Kontraktgegenstand

[...]

(2) An der Eurex Deutschland stehen Futures-Kontrakte auf folgende Aktienindizes, wobei die Veröffentlichung der anbei genannten Institutionen für die Zusammensetzung, Gewichtung und Berechnung gelten, zur Verfügung:

- [...]
- Die folgenden MSCI Indizes (zusammen mit den MSCI EM Sector Indizes, den MSCI World Sector Indizes und den MSCI Europe Sector Indizes, wie in Abs. 2a, 2b und 2c definiert, für die Zwecke der Index-Futures-Kontrakte die „MSCI Indizes“):

[...]

- MSCI Chile (MSCI Inc.)
- MSCI China (NTR, USD) (MSCI Inc.)
- ~~MSCI China Free (MSCI Inc.)~~

[...]

- MSCI World Enhanced Value (USD, NTR) (MSCI Inc.)
- MSCI World Growth Target (USD, NTR) (MSCI Inc.)
- MSCI World Momentum (USD, NTR) (MSCI Inc.)
- MSCI World Equal Weighted (USD, NTR) (MSCI Inc.)
- MSCI World Quality (USD, NTR) (MSCI Inc.)
- MSCI World High Dividend Yield (USD, NTR) (MSCI Inc.)
- MSCI World Minimum Volatility (USD, NTR) (MSCI Inc.)

[...]

(6) [...]

- USD 10 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den EURO STOXX 50® Index (Produkt ID: FESQ; das Produkt FESQ ist ein Quanto-Future, d.h. die Produktwährung (USD) unterscheidet sich von der Währung des Index (EURO STOXX 50® Index, berechnet in EUR)), MSCI AC ASEAN (NTR, USD), MSCI Australia Index, MSCI Canada (GTR, USD), MSCI China Tech 100 Index, MSCI Colombia Index, MSCI EAFE (NTR, USD), MSCI Emerging Markets Asia ex China, MSCI Emerging Markets Asia ex Korea (NTR, USD), MSCI Emerging Markets ESG Enhanced Focus CTB, MSCI Emerging Markets Latin America ex Brazil (USD, NTR), MSCI Europe Index (NTR, USD), MSCI Indonesia, MSCI Japan ESG Enhanced Focus CTB, MSCI Japan Index (NTR, USD), MSCI Kokusai Index (NTR), MSCI Kuwait Index, MSCI North America (GTR, USD), MSCI North America (NTR, USD), MSCI North America SMID (NTR, USD), MSCI Pacific Index (NTR), MSCI Pacific ex Japan, MSCI Peru Index, MSCI Qatar, MSCI Saudi Arabia (USD, NTR) (Futures auf MSCI Saudi Arabia können im Orderbuch nur in Vielfachen von 5 Kontrakten gehandelt werden), MSCI Thailand Index, MSCI United Kingdom (NTR, USD), MSCI USA ESG Enhanced Focus CTB, MSCI USA (GTR, USD), MSCI USA (NTR, USD) Index, MSCI USA Equal Weighted Index, MSCI USA Momentum Index, MSCI USA Quality Index, MSCI USA Value Weighted Index, MSCI World ESG Enhanced Focus CTB, MSCI World Growth (NTR, USD), MSCI World Value (NTR, USD), MSCI World Enhanced Value (NTR, USD), MSCI World Growth Target (NTR, USD), MSCI World Momentum (NTR, USD), MSCI World Equal Weighted (NTR, USD), MSCI World Quality (NTR, USD), MSCI World High Dividend Yield (NTR, USD), MSCI World Minimum Volatility (NTR, USD), den MSCI World Index (NTR & Price, USD), den MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened Index, den MSCI USA ESG Screened Index, den MSCI World ESG Screened Index, den MSCI EM ESG Screened Index, den MSCI EAFE ESG Screened Index und den MSCI Japan ESG Screened Index, STOXX Global Thematic Indizes
- USD 50 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf MSCI ACWI (Price, USD), MSCI Chile Index, MSCI China Index, ~~MSCI China Free Index~~, MSCI China Hong Kong Listed Large Cap Index, MSCI Czech Republic Index, MSCI EAFE (Price, USD), MSCI Egypt Index, MSCI Emerging Market Index (Price, USD), MSCI Emerging Markets EMEA ex Turkey (USD, NTR), die MSCI Emerging Market Sector Indizes, MSCI GCC Countries Index (NTR, USD), MSCI Hong Kong Listed Large Cap Index, MSCI Mexico Index, MSCI Philippines Index, MSCI United Arab Emirates Index und den MSCI World Midcap Index

[...]

1.3.5 Preisabstufungen

1.3.5.1 Generelle Preisabstufungen für Index-Futures-Kontrakte

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

[...]

- 0,1 Punkte bei

[...]

- MSCI ACWI (Price, USD), MSCI Chile, MSCI China, ~~MSCI China Free~~, MSCI Czech Republic, MSCI EAFE (Price, USD), MSCI Emerging Markets (Price, USD), MSCI Emerging Markets Sectors, MSCI Mexico, MSCI Philippines, und MSCI United Arab Emirates, dies entspricht einem Wert von USD 5

[...]

- 1 Punkt bei

[...]

- MSCI AC ASEAN (NTR, USD), MSCI Australia, MSCI Canada (GTR, USD), MSCI Colombia, MSCI EAFE (NTR, USD), MSCI EM Asia ex China, MSCI Europe (NTR, USD), MSCI Japan (NTR), MSCI North America (GTR, USD), MSCI North America (NTR, USD), MSCI United Kingdom (NTR, USD), MSCI Kokusai (NTR), MSCI Pacific (NTR & GTR), MSCI Pacific ex Japan, MSCI USA (GTR, USD), MSCI USA (NTR, USD), MSCI USA Equal Weighted, MSCI USA Momentum, MSCI USA Quality, MSCI USA Value Weighted, MSCI World Growth (NTR, USD), MSCI World Value (NTR, USD), MSCI World Enhanced Value (NTR, USD), MSCI World Growth Target (NTR, USD), MSCI World Momentum (NTR, USD), MSCI World Equal Weighted (NTR, USD), MSCI World Quality (NTR, USD), MSCI World High Dividend Yield (NTR, USD), MSCI World Minimum Volatility (NTR, USD) und MSCI World (NTR, USD), dies entspricht einem Wert von USD 10

[...]

Abschnitt 2 Kontraktsspezifikationen für Optionskontrakte

[...]

Teilabschnitt 2.4 Kontraktsspezifikationen für Indexoptionen

[...]

2.4.1 Kontraktgegenstand

[...]

- (2) An der Eurex Deutschland stehen Optionskontrakte auf folgende Aktienindizes zur Verfügung:

[...]

- MSCI Emerging Markets (Price, USD)
- ~~MSCI Emerging Markets ESG Screened~~
- MSCI Emerging Markets Asia
- MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened
- MSCI Emerging Markets EMEA
- MSCI Emerging Markets Latin America
- MSCI Europe Growth Index
- MSCI Europe Index (NTR, EUR)
- MSCI Europe Index (Price, EUR)
- MSCI Europe Value Index

- MSCI China (NTR, USD)
 - ~~MSCI China Free (NTR, USD)~~
 - MSCI China Hong Kong Listed Large Cap (Price, USD)
 - MSCI Hong Kong Listed Large Cap (Price, USD)
 - MSCI Japan (NTR, USD)
 - MSCI Saudi Arabia Index (NTR, USD)
 - MSCI USA ESG Screened
 - MSCI World Index (NTR, EUR)
 - MSCI World Index (NTR, GBP)
 - MSCI World Index (NTR, USD)
 - ~~MSCI World Index (Price, USD)~~
 - MSCI World ESG Screened
 - OMXH25
- [...]

(5) Der Wert eines Optionskontrakts beträgt:

- [...]
- USD 10 pro Indexpunkt bei Optionskontrakten auf den MSCI EAFE (NTR, USD), MSCI Japan (NTR, USD), MSCI Saudi Arabia (NTR, USD) und MSCI World (NTR & Price, USD), MSCI Emerging Markets ESG Screened, MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened, MSCI USA ESG Screened, MSCI World ESG Screened
 - USD 50 pro Indexpunkt bei Optionskontrakten auf den MSCI ACWI (Price, USD), MSCI EAFE (Price, USD), MSCI Emerging Market Index (Price, USD), MSCI China (NTR, USD), ~~MSCI China Free (NTR, USD)~~, MSCI China Hong Kong Listed Large Cap und den MSCI Hong Kong Listed Large Cap
- [...]

2.4.9 Preisabstufungen

Der Preis eines Optionskontrakts wird in Punkten ermittelt. Die kleinste Preisveränderung (Tick) beträgt 0,01 Punkte bei den DivDAX®, MSCI Europe (NTR & Price, EUR), MSCI Europe Growth, MSCI Europe Value, STOXX Europe Select 50, STOXX Europe ESG Leaders Select 30, STOXX® Europe 600 ESG-X und EURO STOXX 50® ESG Index-Optionskontrakten, 0,05 Punkte bei den EURO STOXX® Banks und STOXX® Europe 600 Banks Sector Index-Optionskontrakten, 1 Punkt bei MSCI World (NTR, GBP)-Optionskontrakten, 0,5 Punkte bei den FTSE® 100 Index Optionskontrakten und 0,1 Punkte bei allen anderen Index-Optionskontrakten. Dies entspricht einem Wert von

- [...]
- USD 1 bei MSCI EAFE (NTR, USD), MSCI Japan (NTR, USD), MSCI Saudi Arabia ~~und~~, MSCI World (NTR & Price, USD), MSCI Emerging Markets ESG Screened, MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened, MSCI USA ESG Screened, MSCI World ESG Screened-Optionskontrakten
 - USD 5 bei MSCI ACWI (Price, USD), MSCI China, ~~MSCI China Free (NTR, USD)~~, MSCI China Hong Kong Listed Large Cap, MSCI EAFE (Price, USD), MSCI Emerging Markets (Price, USD) und MSCI Hong Kong Listed Large Cap-Optionskontrakten

[...]

Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

3.2.1 Blockgeschäfte

[...]

Produkt	Zusätzliche Kontraktvarianten J/N	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte	
		TES	Eurex EnLight und von QTPIP getätigte Eingaben *
Aktienindexoptionen			
[...]			
Optionskontrakte auf den MSCI Emerging Markets Asia Index (OMEA)	J	50	
Optionskontrakte auf den MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened Index (OMSS)	J	1	
[...]			
Optionskontrakte auf den MSCI Emerging Markets Index (Price, USD) (OMEF)	J	100	
Optionskontrakte auf den MSCI Emerging Markets ESG Screened Index (OMSM)	J	1	
[...]			
Optionskontrakte auf den MSCI China Index (NTR, USD) (OMCH)	J	1	
Optionskontrakte auf den MSCI China Free Index (USD, NTR) (OMCN)	J	1	
[...]			
Optionskontrakte auf den MSCI Saudi Arabia (NTR, USD) Index (OMSA)	J	5	
Optionskontrakte auf den MSCI USA ESG Screened Index (OMSU)	J	1	
[...]			
Optionskontrakte auf den MSCI World Index (Price, USD) (OMWP)	J	150	
Optionskontrakte auf den MSCI World ESG Screened Index (OMSW)	J	1	
[...]			
Aktienindex-Futures			
[...]			
Futures-Kontrakte auf den MSCI China Index (FMCH)	J	20	
Futures-Kontrakte auf den MSCI China Free Index (FMCN)	J	20	
[...]			

Produkt	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte		
	Zusätzliche Kontraktvarianten J/N	TES	Eurex EnLight und von QTPIP getätigte Eingaben *
Futures-Kontrakte auf den MSCI World Value Index (USD, NTR) (FMOV)	J		1
Futures-Kontrakte auf den MSCI World Enhanced Value Index (FMGV)	J		1
Futures-Kontrakte auf den MSCI World Growth Target Index (FMGT)	J		1
Futures-Kontrakte auf den MSCI World Momentum Index (FMGM)	J		1
Futures-Kontrakte auf den MSCI World Equal Weighted Index (FMGE)	J		1
Futures-Kontrakte auf den MSCI World Quality Index (FMGQ)	J		1
Futures-Kontrakte auf den MSCI World High Dividend Yield Index (FMGD)	J		1
Futures-Kontrakte auf den MSCI World Minimum Volatility Index (FMGO)	J		1
[...]			

* Als von QTPIP getätigte Eingaben gelten Eingaben gemäß Ziffer 4.6 (3) der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland. Für Eingaben von STPIP gemäß Ziffer 4.6 (2) gelten die Bestimmungen für die Eingabe von TES Geschäften.

[...]

3.2.5 Vola-Geschäft

Folgende Kontrakte sind zugelassen:

Optionskontrakt	Futures-Kontrakt
[...]	
Optionskontrakte auf den MSCI China Index (USD, NTR) (OMCH)	Futures-Kontrakte auf den MSCI China Index (USD, NTR) (FMCH)
Optionskontrakte auf den MSCI China Free Index (USD, NTR) (OMCN)	Futures-Kontrakte auf den MSCI China Free Index (USD, NTR) (FMCN)
[...]	
Optionskontrakte auf den MSCI Emerging Markets Asia Index (OMEA)	Futures-Kontrakte auf den MSCI Emerging Markets Asia Index (FMEA)
Optionskontrakte auf den MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened Index (OMSS)	Futures-Kontrakte auf den MSCI Emerging Markets Asia ESG Screened Index (FMSS)
[...]	
Optionskontrakte auf den MSCI Emerging Markets Index (Price, USD) (OMEF)	Futures-Kontrakte auf den MSCI Emerging Markets Index (Price, USD) (FMEF)
Optionskontrakte auf den MSCI Emerging Markets ESG Screened Index (OMSM)	Futures-Kontrakte auf den MSCI Emerging Markets Index ESG Screened Index (FMSS)
[...]	
Optionskontrakte auf den MSCI Saudi Arabia Index (NTR, USD) (OMSA)	Futures-Kontrakte auf den MSCI Saudi Arabia Index (NTR, USD) (FMSA)
Optionskontrakte auf den MSCI USA ESG Screened Index (OMSU)	Futures-Kontrakte auf den MSCI USA ESG Screened Index (FMSU)
[...]	

Optionskontrakt	Futures-Kontrakt
Optionskontrakte auf den MSCI World Index (Price, USD) (OMWP)	Futures-Kontrakte auf den MSCI World Index (Price, USD) (FMWP)
<u>Optionskontrakte auf den MSCI World ESG Screened Index (OMSW)</u>	<u>Futures-Kontrakte auf den MSCI World ESG Screened Index (FMSW)</u>
[...]	

[...]

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 07.11.2022 in Kraft.

Frankfurt am Main, 17.10.2022

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters