

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

Erweiterung der Eurex TES-Basket Trades-Funktion für Equity Bespoke Baskets (EBB)

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 26.07.2021 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 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

3.2.7 **Basket-Geschäfte ~~in Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten und~~ Substitutionsgeschäfte**

Basket-Geschäfte und Substitutionsgeschäfte sind gemäß Ziffer 4.3 (7) der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland für den Off-Book-Handel zugelassen.

3.2.7.1 Basket-Geschäfte

Folgende Kontrakte können in einem Basket-Geschäft gehandelt werden sind zugelassen:

Produkt	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte	Gruppenkennung	Handelsmodalitäten <u>Kontrakte, die Gegenstand eines Basket Geschäfts sein können („Zulässige Kontrakte“)</u>
<u>Aktien-Futures</u>	<u>Gemäß Annex A</u>		Alle Kontrakte mit der Gruppenkennungen CH01, AT01, BE01, DE01, ES01, FI01, FR01, IE01, IT01, NL01, PT01 oder GB01 gemäß Annex A
<u>Aktien-Dividenden-Futures</u>	<u>Gemäß Annex D</u>		Alle Kontrakte mit der Gruppenkennungen CH21, CH22, BE21, DE21, ES21, FI21, FR21, FR22, GB21, GB22, GB23, IE21, IT21, NL21, US21, FR22, gemäß Annex D
<u>Stock Tracking Futures</u>	<u>Gemäß Annex H</u>		Alle Kontrakte mit der Gruppenkennungen BE31, DE31, ES31, FI31, FR31, IE31, IT31, NL31 gemäß Annex H
Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte	Gemäß Annex G	<u>Gemäß Annex G</u>	Alle Kontrakte, die Zulässigen Buckets gemäß Annex G zugewiesen sind Trade at Close (TAC) Trade at Market (TAM)

Bei der Eröffnung eines Basket-Geschäfts generiert und vergibt das Handelssystem der Eurex Deutschland eine Kennung für jeden im Rahmen dieses Basket-Geschäfts gehandelten Kontrakt („Basket-ID“).

Aktien Futures, Aktien Dividenden Futures und Stock Tracking Futures können gemeinsam in einem Basket Geschäft unter einer Basket ID gehandelt werden.

Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte müssen in einem separaten Basket Geschäft unter einer eigenen Basket ID gehandelt werden und können nicht mit Aktien Futures, Aktien Dividenden Futures und Stock Tracking Futures kombiniert werden.

Eröffnung eines Basket-Geschäfts

Bei Die Eröffnung eines ~~Eingabe eines~~ Basket-Geschäfts erfolgt durch Eingabe eines oder mehrerer ~~Geschäfte in Zulässigen Kontrakten als Basket Geschäft. mit Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten muss der Börsenteilnehmer Folgendes eingeben:~~

~~(i) einen oder mehrere der in Annex G aufgeführten Buckets und~~

~~(ii) einen oder mehrere Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die einem der ausgewählten Buckets zugewiesen sind und~~

~~(iii) Bei der Eröffnung eines Basket-Geschäfts mit Aktien-Total-Return-Futures Kontrakten muss zusätzlich ein ~~den~~ ausgewählten Buckets entsprechendes Profil gemäß, wie in Annex G aufgeführt, eingeben werden.~~

~~Bei der Ausführung eines Basket-Geschäfts mit Total-Return-Futures-Kontrakten generiert das Eurex-Handelssystem zusätzlich eine eindeutige Kennung für jeden in dem betreffenden Basket gehandelten Total-Return-Futures-Kontrakt („Basket-ID“).~~

Folgegeschäfte unter einem Basket-Geschäft

Soweit zusätzliche Geschäfte unter einem bestehenden Basket Geschäft abgeschlossen werden sollen, ist Folgendes in das System der Eurex Deutschland einzugeben:

(i) eine gültige Basket-ID und

(ii) Zulässige Kontrakte, die eröffnet oder geschlossen werden.

3.2.7.2 Substitutionsgeschäfte

Substitutionsgeschäfte sind gemäß Ziffer 1.26.12 nur für Aktien-Total-Return-Futures möglich.

Bei Eingabe eines Substitutionsgeschäfts ~~gemäß Ziffer 1.26.12 Absatz 5 muss der Börsenteilnehmer ist Folgendes einzugeben:~~

(i) eine gültige Basket-ID und

(ii) ~~gültig~~ die Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte, die gemäß Ziffer 1.26.12 ~~Absätze (2) bis (5) eröffnet und geschlossen bzw. glattgestellt werden sollen, eingeben.~~

[...]

Annex A zu Ziffer 1.6 der Kontraktsspezifikationen:

[...]

<u>Gruppenkennung</u>	<u>Bucket / Bucket-ID</u>	<u>Gruppenbeschreibung (ausschließlich zu Informationszwecken)</u>
CH01	SSF_CHF	Aktien-Futures CHF
AT01, BE01, DE01, ES01, FI01, FR01, IE01, IT01, NL01, PT01	SSF_EUR	Aktien-Futures EUR
GB01	SSF_GBX	Aktien-Futures GBX

[...]

Annex D zu Ziffer 1.13 der Kontraktsspezifikationen:

[...]

<u>Gruppenkennung</u>	<u>Bucket / Bucket-ID</u>	<u>Gruppenbeschreibung (ausschließlich zu Informationszwecken)</u>
CH21	SSDF_CH	Aktien-Dividenden-Futures CH
BE21, DE21, DE22, ES21, FI21, FR21, FR22, GB23, IE21, IT21, NL21	SSDF_EU	Aktien-Dividenden-Futures EU
GB21, GB22, GB23	SSDF_GB	Aktien-Dividenden-Futures UK
US21	SSDF_US	Aktien-Dividenden-Futures US

[...]

Annex H zu Ziffer 1.27 der Kontraktsspezifikationen:

[...]

*** 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.

<u>Kassamarkt-ID</u>	<u>Maßgeblicher Kassamarkt</u>
XBRU	Elektronisches Handelssystem der Euronext Brussels
XETR	Elektronisches Handelssystem der Frankfurter Wertpapierbörse
XMAD	Elektronisches Handelssystem der Bolsa de Madrid
XHEL	Elektronisches Handelssystem der Nasdaq OMX Helsinki
XPAR	Elektronisches Handelssystem der Euronext Paris
XMMS	Elektronisches Handelssystem der Euronext Dublin
XMIL	Elektronisches Handelssystem der Borsa Italiana
XAMS	Elektronisches Handelssystem der Euronext Amsterdam

[...]

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 26.07.2021 in Kraft.

Frankfurt am Main, 05.07.2021

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters