



Eurex[®] IOC Liquiditätsindikator für Optionen

Einblick in die Liquidität der wichtigsten Eurex-Optionen

Der Eurex IOC Liquiditätsindikator für Optionen bietet Einblick in die Liquidität von mehr als 70 Eurex-Optionsprodukten. Der Indikator basiert auf proprietären Orderinformationen, die nicht öffentlich zugänglich sind und unterstützt Algo Trader, Banken, Hedge-Fonds und andere Marktteilnehmer bei der Einschätzung der Liquidität und des fairen Werts eines Optionskontrakts.

Berechnung der Kennzahlen

- IOC (Immediate-or-Cancel) Orders werden direkt bei Ordereingang verarbeitet; sie werden entweder vollständig oder teilweise ausgeführt oder nicht ausgeführt und sofort gelöscht
- Der Indikator berechnet das aggregierte Volumen von gelöschten IOC Orders innerhalb eines Zeitraums von 10 Millisekunden gemessen vom Zeitstempel des Geschäfts, welches von einer IOC Order ausgelöst wurde
- Die Daten beinhalten die Volumenindikation und Angaben zum Geschäft wie z.B. Preis, Menge, Ausführungs-ID und Angabe der Seite, die das Geschäft ausgelöst hat
- Das Volumen wird auf Teilnehmerebene berechnet

Folgende Instrumente sind enthalten

Der Indikator wird für mehr als 70 Eurex-Optionen berechnet. Unter anderem für:

- Optionen auf Euro-Bobl-Futures (OGBM)
- Optionen auf Euro-Bund-Futures (OGBL)
- Optionen auf Euro-Schatz-Futures (OGBS)
- DAX[®] Optionen (ODAX)

- EURO STOXX 50[®] Index Optionen (OESX)
- EURO STOXX 50 Index Dividendenoptionen (OEXD)
- EURO STOXX Banks Optionen (OESB)
- KOSPI 200 (OKS2)
- SMI[®] Optionen (OSMI)
- VSTOXX[®] Optionen (OVS)
- DAX Aktienoptionen
- Andere Aktienoptionen

Eine vollständige Liste der Optionen, für die der Indikator berechnet wird, ist auf Anfrage erhältlich.

Datenverfügbarkeit

Die Übermittlung der Daten erfolgt über (a) den Eurex MIC (Multi-Interface-Channel), (b) die 10 GB Eurex Marktdatenverbindung und (c) die Deutsche Börse Datenfeeds CEF[®] Core und CEF ultra+ Eurex.

Technische Informationen

Die benötigte Bandbreite für dieses Informationsprodukt beträgt ~ 172 kbps. Am Tag werden zwischen 20.000 und 80.000 Nachrichten übermittelt.

Kontakt

Market Data + Services/Information
+49-69-2 11-1 24 42 (Frankfurt)
mds.frontoffice@deutsche-boerse.com
www.mds.deutsche-boerse.com