



Eurex® Realtime Analytics

Eurex Datenfeeds jetzt mit analytischen Kennzahlen

Die Deutsche Börse erweitert ihre Eurex-Informationsprodukte mit analytischen Kennzahlen für die liquidesten und wichtigsten Eurex Futures. Die Informationen sind relevant für Market Maker, Algo Trader, Investoren, Smart Order Routing Applikationen, Analysten und Risikomanager und dienen dazu, aktuelle Marktbedingungen und -trends zu erkennen.

Produktumfang

Die analytischen Kennzahlen werden für die folgenden Eurex Futures berechnet:

- DAX® Futures (FDAX)
- EURO STOXX 50® Index Futures (FESX)
- EURO STOXX 50 Index Dividend Futures (FEXD)
- EURO STOXX® Banks Futures (FESB)
- SMI® Futures (FSMI)
- VSTOXX® Futures (FVS)
- Euro-Schatz Futures (FGBS)
- Euro-Bobl Futures (FGBM)
- Euro-Bund Futures (FGBL)
- Euro-Buxl® Futures (FGBX)
- Mid-Term Euro-OAT Futures (FOAM)
- Euro-OAT Futures (FOAT)
- Long-Term Euro-BTP Futures (FBTP)

Berechnung der Kennzahlen

- On-exchange Trades sowie Orders/Quotes, die im Orderbuch sichtbar sind, werden in die Kalkulation einbezogen
- Die Aktualisierung erfolgt in unterschiedlichen Zeitintervallen (in Echtzeit, pro Sekunde und alle 60 Sekunden)
- Die Informationen werden aus den Eurex-Orderbuchdaten und Trade-Historien abgeleitet
- Die Kalkulation erfolgt nur während Continuous Trading-Phasen

- Die Order- und Handelsinformationen sind anonymisiert und aggregiert

Technische Informationen

- Die Daten werden über die Informationsprodukte Eurex und Eurex ultra zur Verfügung gestellt
- Eurex wird über CEF® Core und Vendoren verteilt
- Eurex ultra erhalten Sie über den Daten-Feed CEF ultra+ Eurex und Vendoren

Beispiele für analytische Kennzahlen

Zu Beginn werden mehr als 25 analytische Kennzahlen auf Instrumentenebene berechnet. Die nachfolgende Liste veranschaulicht die Bandbreite:

- Anzahl der eingegangenen Orders innerhalb der letzten 30 Sekunden
- Volumen der eingegangenen Orders innerhalb der letzten 30 Sekunden
- Gleitender volumengewichteter Durchschnittskurs (VWAP) für ein 600-Sekunden-Intervall für alle buy-triggered Trades
- Volatilität des eingegangenen Ordervolumens (Kauf und Verkauf) für die letzten 300 Sekunden
- Verhältnis der aggressiven Kauforders zur Summe aller aggressiven Kauf- und Verkauforders (Buyer-Seller-Ratio)

Eine vollständige Liste aller berechneten Eurex Realtime Analytics Kennzahlen mit Formeln und Beispielen wird auf Anfrage zur Verfügung gestellt.

Kontakt

Market Data + Services/Content
+49-(0) 69-2 11-1 34 40 (Frankfurt)
mds.frontoffice@deutsche-boerse.com
www.deutsche-boerse.com/mds