

Finanzderivate und Optionen, Übung 11

HENRY HAUSTEIN

Aufgabe 1

Falsch, EMIR setzt sich für Stärkung von Transparenz im OTC-Handel ein (zentrale Gegenparteien, Transaktionsregister)

Aufgabe 2

Richtig, es geht z.B. darum wie Firewalls bei Banken eingerichtet werden oder wie Gelder von Anlegern getrennt werden müssen. Weitere Punkte: Tick-Größe, Positions-Größen, HFT

Aufgabe 3

PRA und FCA

Aufgabe 4

Falsch

Aufgabe 5

Pro-Rata Methode

Aufgabe 6

Zeit-Pro-Rata Methode

Aufgabe 7

Es wird die Order 30 @ 3125 (für 3125) und die Order 30 @ 3124 (für 3124) ausgeführt. Auf der Ask-Seite verbleibt der Rest 40 @ 3124.

Aufgabe 8

Da bisher nichts auf der Bid-Seite steht, wird solange gewartet, bis dort eine weitere Order reinkommt, damit man weiß, wie die Market-Order-Matching-Range beginnt und endet.

Aufgabe 9

Matching mit der Market-Order 20 @ 3.16.

Aufgabe 10

Order	Quantity	Anteil	zugeteilt	noch offen
1	20	$\frac{20}{90} \cdot 25 = 5.55$	6	14
2	20	$\frac{20}{70} \cdot 19 = 5.42$	5	15
3	50	$\frac{50}{50} \cdot 14 = 14$	14	36