

## *Bekanntmachung der Eurex Deutschland*

**Fixed Income-Derivate: A. Einführung von Euro High Yield Index-Futures;  
B. Redaktionelle Änderungen in den Kontraktsspezifikationen für bestehende  
Bond-Index-Futures**

**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 17.10.2022 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 1.23 Kontrakt-Spezifikationen für Bond Index-Futures-Kontrakte

[...]

#### 1.23.1 Kontraktgegenstand

[...]

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

- Bloomberg ~~Barclays~~-MSCI Euro Corporate SRI Index (Total Return, EUR)  
(Bloomberg ~~Barclays~~);
- Bloomberg ~~Barclays~~-MSCI Global Green Bond Index (Total Return, EUR)  
(Bloomberg ~~Barclays~~);
- Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (Total Return, EUR)  
(Bloomberg).

- (3) Der Wert eines Kontrakts beträgt:

- EUR 1000 pro Indexpunkt bei Futures Kontrakten auf den Bloomberg ~~Barclays~~ MSCI Euro Corporate SRI Index;
- EUR 1000 pro Indexpunkt bei Futures Kontrakten auf den Bloomberg ~~Barclays~~ MSCI Global Green Bond Index;
- EUR 200 pro Indexpunkt bei Futures Kontrakten auf den Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index.

- (4) Bei Änderungen in der Berechnung eines Index oder seiner Zusammensetzung ~~und bzw. Gewichtung~~, die das Konzept des Index nicht mehr vergleichbar erscheinen lassen mit dem bei Zulassung des Futures-Kontrakts maßgeblichen Konzept oder ~~bei Wegfall des Benchmarks~~ wenn der Index nicht mehr zur Verfügung gestellt wird bzw. die entsprechende Index-Lizenz der Eurex Frankfurt AG entzogen wurde kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland anordnen, dass der Handel in den bestehenden Kontrakten am letzten Börsentag vor Änderung des jeweiligen Index endet. Offene Positionen werden nach Ende des Handels bar ausgeglichen. Maßgebend ist der jeweilige Schlussabrechnungspreis (Kapitel II Abschnitt 2 Ziffer 2.23.2 der Clearing Conditions der Eurex Clearing AG).

[...]

[...]

### 1.23.5 Preisabstufungen

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

- ~~Bloomberg Barclays~~ MSCI Euro Corporate SRI Index Futures Kontrakten beträgt 0,01 °Punkte, dies entspricht einem Wert von 10 Euro;
- ~~Bloomberg Barclays~~ MSCI Global Green Bond Index Futures Kontakten beträgt 0,01 °Punkte, dies entspricht einem Wert von 10 Euro;
- Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index Futures Kontrakten beträgt 0,02 Punkte, dies entspricht einem Wert von 4 Euro.

[...]

## Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

### Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

#### 3.2.1 Blockgeschäfte

[...]

| Produkt   |                                   | Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte |   |
|---|-----------------------------------|---|---|
| Standard  | Zusätzliche Kontraktvarianten J/N | TES                                       | Eurex EnLight und von QTPIP getätigte Eingaben* |
| [...]   |                                   |   |   |
| Bond Index Futures  |                                   |   |   |
| Futures-Kontrakte auf den Bloomberg <del>Barclays</del> -MSCI Euro Corporate SRI Index (FECX) | J                                 | 30  |   |
| Futures-Kontrakte auf den Bloomberg <del>Barclays</del> -MSCI Global Green Bond Index (FGGI)  | J                                 | 40  |   |
| Futures-Kontrakte auf den Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (FEHY)      | J                                 | 100                                       |   |
| [...]   |                                   |   |   |

\* 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.

[...]

[...]

### 3.2.3 Exchange for Physicals for Index Futures/FX Futures (“EFP-I”)

Folgende Kontrakte sind zugelassen:

- [...]
- Futures-Kontrakte auf den Bloomberg ~~Barclays~~-MSCI Euro Corporate SRI Index (FECX)
- Futures-Kontrakte auf den Bloomberg ~~Barclays~~-MSCI Global Green Bond Index (FGGI)
- Futures-Kontrakte auf den Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (FEHY)
- [...]

[...]

\*\*\*\*\*

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 17.10.2022 in Kraft.

Frankfurt am Main, 08.09.2022

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters