

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

**Fixed Income-Derivate: Einführung von Bloomberg Emerging Market USD
Sovereign & Sovereign Owned Index-Futures und Sterling Liquid Corporate
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 05.02.2024 in Kraft.

Die Änderungssatzung kann 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:

EINFÜHUNGEN SIND UNTERSTRICHEN;

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

[...]

Teilabschnitt 1.23 Kontraktsspezifikationen 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 Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (Total Return, EUR) (Bloomberg);
- Bloomberg Emerging Market USD Sovereign & Sovereign Owned Index (Total Return, USD) (Bloomberg);
- Bloomberg Sterling Liquid Corporate Index (Total Return, GBP) (Bloomberg).

(3) Der Wert eines Kontrakts beträgt:

- [...]
- EUR 200 pro Indexpunkt bei Futures Kontrakten auf den Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index;
- EUR 200 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den Bloomberg Emerging Market USD Sovereign & Sovereign Owned Index;
- EUR 200 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den Bloomberg Sterling Liquid Corporate Index.

[...]

[...]

1.23.5 Preisabstufungen

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

[...]

- Bloomberg Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index Futures Kontrakten beträgt 0,02 Punkte, dies entspricht einem Wert von 4 Euro.
- Bloomberg Emerging Market USD Sovereign & Sovereign Owned Index Futures-Kontrakten beträgt 0,01 Punkte, dies entspricht einem Wert von 2 Euro.
- Bloomberg Sterling Liquid Corporate Index Futures-Kontrakten beträgt 0,01 Punkte, dies entspricht einem Wert von 2 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 Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (FEHY)	J		100
<u>Futures-Kontrakte auf den Bloomberg Emerging Market USD Sovereign & Sovereign Owned Index (FUEM)</u>	<u>J</u>		<u>100</u>
<u>Futures-Kontrakte auf den Bloomberg Sterling Liquid Corporate Index (FGBC)</u>	<u>J</u>		<u>100</u>
[...]			

* 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 Liquidity Screened Euro High Yield Bond Index (FEHY)
- Futures-Kontrakte auf den Bloomberg Emerging Market USD Sovereign & Sovereign Owned Index (FUEM)
- Futures-Kontrakte auf den Bloomberg Sterling Liquid Corporate Index (FGBC)
- [...]

[...]

[...]

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 05.02.2024 in Kraft.

Frankfurt am Main, 21.12.2023

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters