

# *Bekanntmachung der Eurex Deutschland*

**Fixed Income-Derivate: Einführung von Bloomberg US Corporate Index-Futures und Bloomberg US High Yield Very Liquid 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 23.09.2024 in Kraft.

---

Die Änderungen können auf der Internetseite der Eurex Deutschland (<https://www.eurex.com/ex-de/>) abgerufen werden. Eine Ausfertigung liegt zusätzlich am Empfang des Handelssaals, Börsenplatz 4, 60313 Frankfurt am Main, Deutschland, während der allgemeinen Öffnungszeiten öffentlich zur Einsicht aus.

6497-24\_af

Public

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

EINFÜGUNGEN SIND UNTERTRICHEN;

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 Sterling Liquid Corporate Index (Total Return, GBP) (Bloomberg);
- Bloomberg US Corporate Index (Total Return, USD) (Bloomberg);
- Bloomberg US High Yield Very Liquid Index (Total Return, USD) (Bloomberg).

- (3) Der Wert eines Kontrakts beträgt:

[...]

- GBP 200 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den Bloomberg Sterling Liquid Corporate Index;
- USD 25 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den Bloomberg US Corporate Index;
- USD 100 pro Indexpunkt bei Futures-Kontrakten auf den Bloomberg US High Yield Very Liquid Index.

[...]

#### 1.23.4 Letzter Handelstag, Schlussabrechnungstag, Handelsschluss

[...]

- (3) Handelsschluss an dem letzten Handelstag

[...]

- für

- Bloomberg Emerging Market USD Sovereign & Sovereign Owned Index
- Bloomberg US Corporate Index
- Bloomberg US High Yield Very Liquid Index

Futures Kontrakte ist 22:00 Uhr MEZ.

### 1.23.5 Preisabstufungen

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

[...]

- Bloomberg Sterling Liquid Corporate Index Futures-Kontrakten beträgt 0,01 Punkte, dies entspricht einem Wert von GBP 2.
- Bloomberg US Corporate Index Futures-Kontrakten beträgt 0,1 Punkte, dies entspricht einem Wert von USD 2,5.
- Bloomberg US High Yield Very Liquid Index Futures-Kontrakten beträgt 0,01 Punkte, dies entspricht einem Wert von USD 1.

[...]

## 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 Sterling Liquid Corporate Index (FGBC)	J		100

Produkt		Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte	
Standard	Zusätzliche Kontraktvarianten J/N	TES	Eurex EnLight und von QTPIP getätigte Eingaben *
<u>Futures-Kontrakte auf den Bloomberg US Corporate Index (FUIG)</u>	↓		60
<u>Futures-Kontrakte auf den Bloomberg US High Yield Very Liquid Index (FUHY)</u>	↓		80
[...]			

\* 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) der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland 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 Sterling Liquid Corporate Index (FGBC)
- Futures-Kontrakte auf den Bloomberg US Corporate Index (FUIG)
- Futures-Kontrakte auf den Bloomberg US High Yield Very Liquid Index (FUHY)

[...]

[...]

\*\*\*\*\*

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 23.09.2024 in Kraft.

Frankfurt am Main, 02.08.2024

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Robbert Boij