

## *Bekanntmachung der Eurex Deutschland*

### **ETF-Derivate: Einführung von Optionen auf kurz- und mittelfristige US Treasury Bond UCITS ETFs**

### **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 04.09.2023 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:

EINFÜGUNGEN SIND UNTERSTRICHEN;

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

## **Abschnitt 2 Kontraktsspezifikationen für Optionskontrakte**

[...]

### **Teilabschnitt 2.5 Kontraktsspezifikationen für Optionskontrakte und Low Exercise Price Options auf börsengehandelte Indexfondsanteile**

[...]

#### **2.5.1 Kontraktgegenstand**

An der Eurex Deutschland stehen Optionskontrakte auf folgende börsengehandelte Indexfondsanteile zur Verfügung. Der Referenzmarkt ist dabei jeweils das elektronische Handelssystem der Frankfurter Wertpapierbörse, sofern nicht anderweitig genannt:

[...]

- iShares USD High Yield Corporate Bond ETF (London Stock Exchange LSE)
- iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF (London Stock Exchange LSE)
- iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF (London Stock Exchange LSE)

[...]

[...]

#### **2.5.4 Laufzeit**

[...]

An der Eurex Deutschland stehen grundsätzlich Fixed Income ETF-Optionen mit Laufzeiten der nächsten 13 aufeinanderfolgenden Monate zur Verfügung. Die Verfälle im Januar und Dezember für die nächsten zwei Jahre stehen ebenfalls zur Verfügung, sofern diese nicht bereits in dem Zyklus der nächsten 13 aufeinanderfolgenden Monate enthalten sind. Wenn der August-Kontrakt verfällt, steht der Verfall im Januar für ein viertes Jahr zur Verfügung. Wenn der September-Kontrakt verfällt, steht der Verfall

im Dezember für ein viertes Jahr zur Verfügung. Für OHYG und OEAC stehen Laufzeiten bis einschließlich zu den drei nächsten Kalenderverfalltagen sowie bis einschließlich zu den drei danach liegenden Quartalsverfalltagen (März, Juni, September, Dezember) zur Verfügung. Für EHYU, EEMB, ELQD, ODBT, ODTM und ODTL stehen Laufzeiten bis einschließlich zu den sechs nächsten Kalenderverfalltagen sowie bis einschließlich zu den zwei danach liegenden Quartalsverfalltagen (März, Juni, September, Dezember) zur Verfügung.

**Fixed Income ETF-Optionen:**

Produkt	Produkt-ID
[...]	
iShares EUR High Yield Corporate Bond ETF	OHYG
<u>iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF</u>	<u>ODBT</u>
<u>iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF</u>	<u>ODTM</u>
[...]	

[...]

[...]

**2.5.7 Ausübungspreise**

- (1) Optionsserien von Optionskontrakten auf folgende Indexfondsanteile können folgende Ausübungspreise haben:

Indexfondsanteile	Ausübungspreisintervalle in EUR bzw. CHF für Laufzeiten ...		
	bis zu drei Monaten	von vier bis 12 Monaten	von mehr als 12 Monaten
[...]			
iShares EUR High Yield Corporate Bond ETF	0,50	0,50	n/a
<u>iShares USD Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF</u>	<u>0,50</u>	<u>0,50</u>	<u>n/a</u>
<u>iShares USD Treasury Bond 7-10yr UCITS ETF</u>	<u>0,50</u>	<u>0,50</u>	<u>n/a</u>
[...]			

[...]

[...]

### 2.5.11 Ausübung

[...]

- (2) Der Inhaber einer ETF Option OHYG, OEAC, EHYU, EEMB, ELQD, ODBT, ODTM oder ODTL darf nur am letzten Handelstag dieser Optionsserie bis zum Ende der Post-Trading Full-Periode ausüben (European-style).

[...]

[...]

\*\*\*\*\*

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 04.09.2023 in Kraft.

Frankfurt am Main, 10.08.2023

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters