

Anhang 1 zu Eurex-Rundschreiben 067/2019

Das initiale Produktangebot in IPS umfasst Inter-Produkt Spread-Strategien bestehend aus den Leg-Instrumenten FGBL-FGBX, FBTP-FGBL und FGBS-FBTS:

IPS in Fixed-Income-Futures ab 16. September 2019			
Inter-Product Spread-Strategie	Produkt-Pool-Name	DV01-neutrales Leg-Ratio	IPS-Ratio der Leg-Instrumente
Bund-Buxl Spread	IPLX	2,58	5 : 2
Long-term BTP-Bund Spread	IPPL	1,47	3 : 2
Schatz-Short-term BTP Spread	IPS2	1,11	11 : 10