

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

## **Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte**

[...]

### **Teilabschnitt 1.26 Kontraktsspezifikationen für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte**

Der folgende Teilabschnitt enthält die Kontraktgestaltung für Total-Return-Futures-Kontrakte auf bestimmte Aktien („Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte“).

[...]

#### **1.26.9 Marktstörung**

##### **1.26.9.1 Eintritt einer Marktstörung**

[...]

- (3) Bei Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakten wird der Eintritt einer Marktstörung in Form einer Störung des Börsenhandels in gelisteten Derivaten insbesondere in folgenden Fällen angenommen:

[...]

(c) Für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte ist eine ordnungsgemäße Preis- oder Spreadermittlung aufgrund des Delistings der zugrundeliegenden Referenzaktie nicht gewährleistet.

[...]

##### **1.26.9.2 Berechnung von Input-Parametern einer Marktstörung**

- (1) Störungen der für die Preisberechnung notwendigen Parameter können – wie in Ziffer 4.22.9.4/1.26.9.1 dargelegt – zu einer Marktstörung führen. Die folgende Methodologie für die Berechnung der Input-Parameter findet dabei Anwendung:

[...]

[...]

(3) Im Falle einer Störung der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte aufgrund des Delistings einer zugrundeliegenden Referenzaktie gilt Folgendes:

Kündigt der in Annex G aufgeführte primäre Kassamarkt an, dass die zugrundeliegende Referenzaktie gemäß den Regularien des maßgeblichen Kassamarktes nicht mehr an diesem Kassamarkt gelistet oder gehandelt wird („Delisting“) oder kündigt die Gesellschaft, auf die sich der Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakt bezieht, ein Delisting an, kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland

- den Ausschluss der Lieferung am letzten Handelstag der betroffenen Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte und
- die Einstellung des Handels und die vorzeitige Beendigung in Bezug auf die betroffenen Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte am letzten Handelstag der zugrundeliegenden Referenzaktie anordnen.

Die Geschäftsführung legt in diesem Fall den für die Barabwicklung maßgebenden Preis der zugrundeliegenden Referenzaktie fest. Die Abrechnung der Kontrakte soll anhand einer von der Geschäftsführung der Eurex Deutschland festgelegten Fair Value-Methode erfolgen.

Ist über die Gesellschaft, die die zugrundeliegende Referenzaktie ausgegeben hat, ein Liquidations-, Insolvenz- oder vergleichbares Verfahren eröffnet worden, soll die Abrechnung auf Basis des Schlusskurses der zugrundeliegenden Referenzaktie am letzten Handelstag vor dem Delisting erfolgen.

[...]

## **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 European Property Yield UCITS ETF (Euronext Amsterdam-London Stock Exchange LSE)
- [...]
- iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF (London Stock Exchange LSE)

EXTF-Optionen beziehen sich grundsätzlich auf 100 Fondsanteile des zugrundeliegenden börsengehandelten Indexfonds. Optionskontrakte auf den iShares Core FTSE 100 UCITS ETF (Dist), iShares S&P 500 Financials Sector UCITS ETF (London Stock Exchange LSE), iShares S&P 500 Health Care Sector UCITS ETF (London Stock Exchange LSE), iShares S&P 500 Information Technology Sector UCITS ETF (London Stock Exchange LSE), iShares S&P 500 Energy Sector UCITS ETF (London Stock Exchange LSE), iShares S&P 500 Utilities Sector UCITS ETF (London Stock Exchange LSE) beziehen sich auf 1.000 Fondsanteile. Optionskontrakte auf den iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF (London Stock Exchange LSE) beziehen sich auf 2.000 Fondsanteile.

[...]

#### **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 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:**

<b>Produkt</b>	<b>Produkt ID</b>
[...]	
iShares USD High Yield Corporate Bond ETF-Optionskontrakte	OHYU
<u>iShares USD High Yield Corporate Bond ETF Options Contract (European Exercise)</u>	<u>EHYU</u>
iShares J.P. Morgan USD Emerging Market Bond ETF-Optionskontrakte	OEMB
<u>iShares J.P. Morgan USD Emerging Market Bond ETF-Optionskontrakte</u>	<u>EEMB</u>
iShares USD Corporate Bond ETF-Optionskontrakte	OQDE
<u>iShares USD Corporate Bond ETF Options Contract (European Exercise)</u>	<u>ELQD</u>
iShares Core EUR Corporate Bond ETF	OEAC
iShares EUR High Yield Corporate Bond ETF	OHYG
<u>iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF</u>	<u>ODTL</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 USD High Yield Corporate Bond ETF	0,50	0,5	1,00
iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	<u>0,50</u>	<u>0,50</u>	<u>n/a</u>
[...]			

[...]

[...]

## 2.5.11 Ausübung

[...]

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

[...]

[...]

## 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
[...]			
Exchange Traded Funds-Optionen (ETF-Optionen)			
[...]			
Optionskontrakte auf börsengehandelte Indexfondsanteile: [...] <u>iShares USD High Yield Corporate Bond ETF (European exercise).</u> <u>iShares J.P. Morgan USD Emerging Market Bond ETF (European exercise).</u> <u>iShares USD Corporate Bond ETF (European exercise).</u> <u>iShares USD Treasury Bond 20+yr UCITS ETF.</u> iShares Core EUR Corporate Bond ETF und iShares EUR High Yield Corporate Bond ETF	J	100	N / A
[...]			

[...]

**Annex B zu Ziffer 2.6 der Kontraktsspezifikationen:**

Optionen auf Aktien der	Produkt-ID	Gruppenkennung*	Kassamarkt-ID*	Kontraktgröße	Maximale Laufzeit (Monate)	Minimale Preisveränderung	Währung**	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte (TES)	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte (Eurex EnLight)
[...]									
Cosmo Pharmaceuticals N.V.	CPH	<del>NLCH</del> 12	<del>XAMS</del> <del>XSWX</del>	100	24	0,01	CHF	50	25
[...]									
Swisscom AG - N.	SCME	CH14	XSWX	<del>100</del> 10	60	0,01	CHF	300	250
[...]									

\* Die Gruppenkennung sowie die Kassamarkt-ID werden von der Eurex Deutschland entsprechend der nachfolgenden Tabelle vergeben und dienen unter anderem der Festlegung eines Handelsplatzes für den Preis der dem Kontrakt zugrundeliegenden Aktie. Bei einem Wechsel des Referenzmarkts der zugrundeliegenden Aktie im Elektronischen Handelssystem innerhalb der Euronext-Börsen Euronext Brussels, Euronext Paris und Euronext Amsterdam kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland für einen Kontrakt die Kassamarkt-ID ändern und damit einen anderen als den bei der Einführung des Kontrakts festgelegten maßgeblichen Kassamarkt bestimmen.

\*\* GBX: Pence Sterling

**Aktienoptionen mit Prämienschwelle (Ziffer 2.6.11)**

Optionen auf Aktien der	Produkt-ID	Gruppenkennung	Minimale Preisänderung unterhalb der Schwelle	Prämienschwelle	Minimale Preisänderung oberhalb der Schwelle
[...]					
Cosmo Pharmaceuticals N.V.	CPH	<del>NLCH</del> 12	0,01	0,5	0,05
[...]					

[...]

**Annex C zu den Kontraktsspezifikationen:**

[...]

**Handelszeiten Optionskontrakte**

[...]

**Indexoptionskontrakte**

Produkt	Produkt-ID	Pre-Trading-Periode	Fortlaufender Handel	Post-Trading Periode bis	Off-book Trading Periode	Off-book Post-Trading Periode bis	Letzter Handelstag	
							Handel bis	Aus-übung bis
[...]								
iShares USD High Yield Corporate Bond ETF Options Contract	OHYU	07:30-08:51	08:51-17:30	20:00	09:00-19:00	19:15	17:30	20:00
iShares J.P. Morgan USD Emerging Market Bond ETF Options Contract	OEMB	07:30-08:51	08:51-17:30	20:00	09:00-19:00	19:15	17:30	20:00
iShares USD Corporate Bond ETF Options Contract	OQDE	07:30-08:51	08:51-17:30	20:00	09:00-19:00	19:15	17:30	20:00
iShares Core EUR Corporate Bond ETF	OEAC	07:30-08:51	08:51-17:30	20:00	09:00-19:00	19:15	17:30	20:00
iShares EUR High Yield Corporate Bond ETF	OHYG	07:30-08:51	08:51-17:30	20:00	09:00-19:00	19:15	17:30	20:00
iShares EURO STOXX Banks 30-15 (DE) Optionskontrakte	EXX1	07:30-08:51	08:51-17:30	20:00	09:00-19:00	19:15	17:30	20:00
iShares STOXX Europe 600 (DE) Optionskontrakte	EXSA	07:30-08:51	08:51-17:30	20:00	09:00-19:00	19:15	17:30	20:00
iShares MSCI Europe (Dist) Optionskontrakte	IQQY	07:30-08:51	08:51-17:30	20:00	09:00-19:00	19:15	17:30	20:00
iShares Core MSCI World Optionskontrakte	IWDA	07:30-08:51	08:51-17:20	20:00	09:00-18:30	18:45	17:20	20:00
iShares MSCI Emerging Markets (Dist) Optionskontrakte	IDEM	07:30-08:51	08:51-17:20	20:00	09:00-18:30	18:45	17:20	20:00
iShares Core FTSE 100 (Dist) Optionskontrakte	ISF	07:30-08:51	08:51-17:20	20:00	09:00-18:30	18:45	17:20	20:00
iShares Core S&P 500 Optionskontrakte	GSPX	07:30-08:51	08:51-17:20	20:00	09:00-18:30	18:45	17:20	20:00
[...]								

[...]

\*\*\*\*\*