

## *Bekanntmachung der Eurex Deutschland*

**Total Return Futures: Änderung der Verfallszyklen für Aktien- und Basket-  
Total Return Futures, Anpassung der Kontraktsspezifikationen für Index-Total  
Return 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 28.02.2022 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:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

## Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

[...]

### Teilabschnitt 1.22 Kontraktsspezifikationen für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte

[...]

#### 1.22.6 Handelskoventionen

[...]

##### 1.22.6.3 Funding Rate

Die auf Index-Total-Return-Futures-Kontrakte anwendbare Funding Rate ist der Benchmark-Zinssatz für Overnight-Geschäfte, über die der TRF-Spread ermittelt und gehandelt wird („Funding Rate“).

- ~~Die Funding Rate für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50<sup>®</sup> (SX5E) ist die von der Europäischen Zentralbank (EZB) (als prozentualer Wert) veröffentlichte Euro Short-Term Rate (€STR). Im Hinblick auf die Tage bis zum €STR-Übergangsdatum, jedoch nicht am €STR-Übergangsdatum, werden die von der Europäischen Zentralbank (EZB) bereitgestellten Spreads zwischen €STR und Eonia<sup>®</sup> (als prozentualer Wert) zum €STR addiert und sind Bestandteil der jeweiligen Funding Rate.~~
- Die Funding Rate für Index-Total-Return-Futures-Kontrakte auf den EURO STOXX 50<sup>®</sup> (SX5E), EURO STOXX 50<sup>®</sup> Banks (SX7E) und EURO STOXX<sup>®</sup> Select Dividend 30 (SD3E) ist die von der Europäischen Zentralbank (EZB) (als prozentualer Wert) veröffentlichte Euro Short-Term Rate (€STR)
- [...]

~~Das „€STR-Übergangsdatum“ ist der 18.10.2021. Zur Sicherstellung ordnungsgemäßer Handelsbedingungen kann die Geschäftsführung der Eurex Deutschland den Termin verschieben; eine solche Verschiebung wird durch Bekanntmachung veröffentlicht.~~

[...]

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

[...]

### 1.26.3 Laufzeit

~~Für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte stehen an der Eurex Deutschland Laufzeiten von bis zu 24 Monaten bis zu den Schlussabrechnungstagen (Ziffer 1.26.4 Absatz 4) des nächsten, übernächsten und drittnächsten Monats, den drei darauffolgenden Quartalsmonaten (März, Juni, September, Dezember) und zwei darauffolgenden Halbjahresverfalltagen (Juni und Dezember) für den Handel zur Verfügung.~~

Für Aktien-Total-Return-Futures-Kontrakte stehen an der Eurex Deutschland Laufzeiten von bis zu 24 Monaten bis zu den Schlussabrechnungstagen (Ziffer 1.26.4 Absatz 2) der folgenden nächstmöglichen Verfalltermine für den Handel zur Verfügung:

- vier halbjährlichen Verfallstermine (Juni, Dezember)
- fünf vierteljährliche Verfallstermine (März, Juni, September, Dezember),
- drei monatliche Verfallstermine.

In Fällen, in denen sich die Verfälle nach dem vorherigen Satz überschneiden würden, ist nur ein einziger Verfall möglich.

[...]

\*\*\*\*\*

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 28.02.2022 in Kraft.

Frankfurt am Main, 25.02.2022

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters