Eurex-Rundschreiben 069/18

Geldmarktderivate: Änderung der Kontraktspezifikationen für den EONIA-Future (FEO1) und den EUR Secured Funding-Future (FLIC)

Zusammenfassung

Die Europäische Zentralbank (EZB) hat den aktualisierten indikativen Kalender für die EZB-Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2019 veröffentlicht. Vor diesem Hintergrund hat die Geschäftsführung der Eurex Deutschland beschlossen, mit Wirkung zum **31. Oktober 2018,** Ziffer 1.1.3 Absatz (4) der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland (Kontraktspezifikationen) zu ändern, um den Handelsteilnehmern zusätzliche Futures-Kontrakte in EONIA-Futures (FEO1) und EUR Secured Funding-Futures (FLIC) vorbehaltlich der Bestimmungen unter Ziffer 1.1.3 Absätze (2) und (3) der Kontraktspezifikationen zum Handel zur Verfügung zu stellen.

Dieses Rundschreiben enthält die zusätzlichen Kontrakte, die vorbehaltlich der Bestimmungen der Kontraktspezifikationen eingeführt werden.

Bitte entnehmen Sie die geänderten Abschnitte der Kontraktspezifikationen dem Anhang.

Anhang:

- Geänderte Abschnitte der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland

Datum: 20. September 2018

Empfänger:
Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Vendoren

Autorisiert von:
Michael Peters

Zielgruppen:

- Front Office/Trading
- Middle + Back Office
- IT/System Administration

Kontakt:
Jenny Ivleva,
Product R&D Fixed Income,
T +44 207 8 62-70 98,
Jenny.Ivleva@deutsche-boerse.com

Geldmarktderivate: Änderung der Kontraktspezifikationen für den EONIA-Future (FEO1) und den EUR Secured Funding-Future (FLIC)

Die Europäische Zentralbank (EZB) hat den aktualisierten indikativen Kalender für die EZB-Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2019 veröffentlicht. Vor diesem Hintergrund hat die Geschäftsführung der Eurex Deutschland beschlossen, mit Wirkung zum 31. Oktober 2018 Ziffer 1.1.3 Absatz (4) der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland (Kontraktspezifikationen) zu ändern, um den Handelsteilnehmern zusätzliche Futures-Kontrakte in EONIA-Futures (FEO1) und EUR Secured Funding-Futures (FLIC) vorbehaltlich der Bestimmungen unter Ziffer 1.1.3 Absätze (2) und (3) der Kontraktspezifikationen zum Handel zur Verfügung zu stellen.

In der nachstehenden Tabelle sind die zusätzlichen Kontrakte aufgeführt, die an der Eurex Deutschland eingeführt werden:

Erster Referenzraten-beobachtungstag	Futures-Verfallstag, Letzter Referenzraten-beobachtungstag	Periodenlänge (Tage)	Verfallsmonat im Eurex-System
30-Jan-19	12-Mär-19	42	Mär-19
13-Mär-19	16-Apr-19	35	Apr-19
17-Apr-19	11-Jun-19	56	Jun-19
12-Jun-19	30-Jul-19	49	Jul-19
31-Jul-19	17-Sep-19	49	Sep-19
18-Sep-19	29-Okt-19	42	Okt-19
30-Okt-19	17-Dez-19	49	Dez-19
18-Dez-19	28-Jan-20	42	Jan-20

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte Jenny Ivleva unter Tel. +44 207 8 62-70 98 oder per E-Mail an: Jenny.Ivleva@deutsche-boerse.com.

20. September 2018

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

Abschnitt 1 Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte

[…]

Teilabschnitt 1.1 Kontraktspezifikationen für Geldmarkt-Futures-Kontrakte

[…]

1.1.3 Laufzeit

[…]

(4) Von der Eurex Deutschland bestimmte Perioden für EUR Secured Funding-Futures und EONIA-Futures (es können Perioden aufgeführt sein, welche nach Ziffer 1.1.3 Abs. 3 und Absatz 2 noch nicht oder nicht mehr zur Verfügung stehen):

Erster Referenzraten-beobachtungstag	Futures Verfallstag, Letzter Referenzraten-beobachtungstag	Periodenlänge (Tage)	Verfallsmonat im Eurex System
~~10. Dez 14~~	~~27. Jan 15~~	~~49~~	~~Jan 15~~
~~28. Jan 15~~	~~10. Mrz 15~~	~~42~~	~~Mrz 15~~
~~11. Mrz 15~~	~~21. Apr 15~~	~~42~~	~~Apr 15~~
~~22. Apr 15~~	~~09. Jun 15~~	~~49~~	~~Jun 15~~
~~10. Jun 15~~	~~21. Jul 15~~	~~42~~	~~Jul 15~~
~~22. Jul 15~~	~~08. Sep 15~~	~~49~~	~~Sep 15~~
~~09. Sep 15~~	~~27. Okt 15~~	~~49~~	~~Okt 15~~
~~28. Okt 15~~	~~08. Dez 15~~	~~42~~	~~Dez 15~~
~~09. Dez 15~~	~~26. Jan 16~~	~~49~~	~~Jan 16~~
~~27. Jan 16~~	~~15. Mrz 16~~	~~49~~	~~Mrz 16~~
~~16. Mrz 16~~	~~26. Apr 16~~	~~42~~	~~Apr 16~~
~~27. Apr 16~~	~~07. Jun 16~~	~~42~~	~~Jun 16~~
~~08. Jun 16~~	~~26. Jul 16~~	~~49~~	~~Jul 16~~
~~27. Jul 16~~	~~13. Sep 16~~	~~49~~	~~Sep 16~~

Erster Referenzraten-beobachtungstag	Futures Verfallstag, Letzter Referenzraten-beobachtungstag	Periodenlänge (Tage)	Verfallsmonat im Eurex System
~~14. Sep 16~~	~~25. Okt 16~~	~~42~~	~~Okt 16~~
~~26. Okt 16~~	~~13. Dez 16~~	~~49~~	~~Dez 16~~
~~14. Dez 16~~	~~24. Jan 17~~	~~42~~	~~Jan 17~~
~~25. Jan 17~~	~~14. Mrz 17~~	~~49~~	~~Mrz 17~~
~~15. Mrz 17~~	~~02. Mai 17~~	~~49~~	~~Mai 17~~
~~03. Mai 17~~	~~13. Jun 17~~	~~42~~	~~Jun 17~~
~~14. Jun 17~~	~~25. Jul 17~~	~~42~~	~~Jul 17~~
~~26. Jul 17~~	~~12. Sep 17~~	~~49~~	~~Sep 17~~
~~13. Sep 17~~	~~31. Okt 17~~	~~49~~	~~Okt 17~~
~~01. Nov 17~~	~~19. Dez 17~~	~~49~~	~~Dez 17~~
~~20. Dez 17~~	~~30. Jan 18~~	~~42~~	~~Jan 18~~
~~31. Jan 18~~	~~13. Mrz 18~~	~~42~~	~~Mrz 18~~
~~14. Mrz 18~~	~~02. Mai 18~~	~~50~~	~~Mai 18~~
~~03. Mai 18~~	~~19. Jun 18~~	~~48~~	~~Jun 18~~
~~20. Jun 18~~	~~31. Jul 18~~	~~42~~	~~Jul 18~~
~~01. Aug 18~~	~~18. Sep 18~~	~~49~~	~~Sep 18~~
~~19. Sep 18~~	~~30. Okt 18~~	~~42~~	~~Okt 18~~
31. Okt 18	18. Dez 18	49	Dez 18
19. Dez 18	29. Jan 19	42	Jan 19
30. Jan 19	12. Mrz 19	42	Mrz 19
13. Mrz 19	16. Apr 19	35	Apr 19
17. Apr 19	11. Jun 19	56	Jun 19
12. Jun 19	30. Jul 19	49	Jul 19
31. Jul 19	17. Sep 19	42	Okt 19
18. Sep 19	29. Okt 19	42	Okt 19
30. Okt 19	17. Dez 19	49	Dez 19
18. Dez 19	28. Jan 19	42	Jan 20

[…]

****