



eurex rundschriften 120/15

Datum: 3. Juli 2015
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendors
Autorisiert von: Mehtap Dinc



Hohe Priorität

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

Kontakt: Maesa Beany, Global Product R&D, T +44-207-86-2 72 35, maesa.beany@eurexexchange.com
Frank Odendall, Global Product R&D, T +65-65-97-30 63, frank.odendall@eurexexchange.com

Zielgruppe:

☞ Alle Abteilungen

Anhang:

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

Zusammenfassung:

Am 22. Juni 2015 hat die Europäische Zentralbank (EZB) einen aktualisierten indikativen Kalender für die EZB-Mindestreserve-Erfüllungsperioden für das Jahr 2016 veröffentlicht.

Vor diesem Hintergrund haben die Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG beschlossen, mit Wirkung zum **21. Juli 2015** Ziffer 1.1.3 Absatz 4 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich (Kontraktsspezifikationen) 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 Absatz 2 und Absatz 3 der Kontraktsspezifikationen zum Handel zur Verfügung zu stellen.

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

Bitte entnehmen Sie die geänderten Abschnitte der Kontraktsspezifikationen dem Anhang.



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

Am 22. Juni 2015 hat die Europäische Zentralbank (EZB) einen aktualisierten indikativen Kalender für die EZB-Mindestreserve-Erfüllungsperioden für das Jahr 2016 veröffentlicht.

Vor diesem Hintergrund haben die Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG beschlossen, mit Wirkung zum 21. Juli 2015 Ziffer 1.1.3 Absatz 4 der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich (Kontraktsspezifikationen) 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 Absatz 2 und Absatz 3 der Kontraktsspezifikationen zum Handel zur Verfügung zu stellen.

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

Erster Referenzratenbeobachtungstag	Futures Verfalltag, Letzter Referenzratenbeobachtungstag	Periodenlänge (Tagen)	Verfallsmonat im Eurex-System
27-Jan-16	15-Mär-16	49	Mär-16
16-Mär-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
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

Die aktualisierten Kontraktsspezifikationen werden zum 21. Juli 2015 auf der Eurex-Website www.eurexchange.com eingestellt unter dem Link:

Ressourcen > Regelwerke > Kontraktsspezifikationen

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, nehmen Sie bitte Kontakt auf mit Maesa Beany, Global Product R&D, Tel. +44-207-86-2 72 35, E-Mail maesa.beany@eurexchange.com oder Frank Odendall, Global Product R&D, Tel. +65-65-97-30 63, E-Mail frank.odendall@eurexchange.com.

3. Juli 2015

**Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte
und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland
und der Eurex Zürich**

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

**1. Abschnitt:
Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte**

**1.1 Teilabschnitt:
Kontraktsspezifikationen für Geldmarkt-Futures-Kontrakte**

[...]

1.1.3 Laufzeit

- (1) Für Dreimonats-EURIBOR-Futures-Kontrakte stehen an den Eurex-Börsen Laufzeiten bis zum Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.1.4 Absatz 1) der nächsten zwanzig Quartalsmonate (März, Juni, September, Dezember) zur Verfügung.
- (2) Für EONIA-Futures-Kontrakte stehen an den Eurex-Börsen maximal Laufzeiten bis zum Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.1.4 Absatz 2) der laufenden von den Eurex-Börsen bestimmten Periode und der folgenden vier von den Eurex-Börsen bestimmten Perioden zur Verfügung, wie in Ziffer 1.1.3 Absatz 4 aufgelistet.
- (3) Für EUR Secured Funding-Futures-Kontrakte stehen an den Eurex-Börsen maximal Laufzeiten bis zum Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.1.4 Absatz 3) der laufenden von den Eurex-Börsen bestimmten Periode und der folgenden vier von den Eurex-Börsen bestimmten Perioden zur Verfügung, wie in Ziffer 1.1.3 Absatz 4 aufgelistet.
- (4) Von den Eurex-Börsen bestimmte Perioden für EUR Secured Funding-Futures und EONIA-Futures (es können Perioden aufgeführt sein, welche nach Ziffer 1.1.3 Absatz 3 und Absatz 2 noch nicht oder nicht mehr zur Verfügung stehen):

Erster Referenz- ratenbeobachtungs- tag	Futures Verfallstag, Letzter Referenzraten- beobachtungstag	Periodenlänge (Tagen)	Verfallsmonat im Eurex System
10-Deze-14	27-Jan-15	49	Jan-15

**Kontraktpezifikationen für Futures-Kontrakte
und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland
und der Eurex Zürich**

Erster Referenz- ratenbeobachtungs- tag	Futures Verfalltag, Letzter Referenzraten- beobachtungstag	Periodenlänge (Tagen)	Verfallsmonat im Eurex System
28-Jan-15	10-M är -15	42	M är -15
11-M är -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-O kt -15	49	Oct-15
28-O kt -15	08-De z -15	42	Dec-15
09-De z -15	26-Jan-16	49	Jan-16
<u>27-Jan-16</u>	<u>15-Mär-16</u>	<u>49</u>	<u>Mär-16</u>
<u>16-Mär-16</u>	<u>26-Apr-16</u>	<u>42</u>	<u>Apr-16</u>
<u>27-Apr-16</u>	<u>07-Jun-16</u>	<u>42</u>	<u>Jun-16</u>
<u>08-Jun-16</u>	<u>26-Jul-16</u>	<u>49</u>	<u>Jul-16</u>
<u>27-Jul-16</u>	<u>13-Sep-16</u>	<u>49</u>	<u>Sep-16</u>
<u>14-Sep-16</u>	<u>25-Okt-16</u>	<u>42</u>	<u>Okt-16</u>
<u>26-Okt-16</u>	<u>13-Dez-16</u>	<u>49</u>	<u>Dez-16</u>
<u>14-Dez-16</u>	<u>24-Jan-17</u>	<u>42</u>	<u>Jan-17</u>

[...]
