X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 087/17*

Datum: 14. August 2017
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Michael Peters

⚠ **Hohe Priorität**

Euro-Fixed-Income-Futures: Festlegung von Reporting- und Positionslimiten für September 2017

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 226/06, 113/16, 013/17, 078/17

Kontakt: Maesa Beany, Product R&D Fixed Income, T +44-207 8 62-72 35,
maesa.beany@eurexchange.com;
Jutta Frey-Hartenberger, Product R&D Fixed Income, T +49-69-211-1 49 88,
jutta.frey-hartenberger@eurexchange.com

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ Front Office/Handel ➲ Middle + Backoffice ➲ Revision/Security Coordination	keine

Zusammenfassung:

Die Reporting- und die Positionslimite in den Euro-Fixed-Income-Futures für die **September 2017-Kontrakte** wurden wie folgt festgesetzt:

- **Euro-Buxl®-Futures (FGBX) 30.000 Kontrakte**
- **Euro-Bund-Futures (FGBL) 60.000 Kontrakte**
- **Euro-Bobl-Futures (FGBM) 55.000 Kontrakte**
- **Euro-Schatz-Futures (FGBS) 45.000 Kontrakte**
- **Long-Term Euro-BTP-Futures (FBTP) 60.000 Kontrakte**
- **Short-Term Euro-BTP-Futures (FBTS) 40.000 Kontrakte**
- **Euro-OAT-Futures (FOAT) 60.000 Kontrakte**
- **Mid-Term-Euro-OAT-Futures (FOAM) 30.000 Kontrakte**
- **Euro-Bono-Futures (FBON) 30.000 Kontrakte**

Weitere Informationen zu den neuen Reporting- und Positionslimiten sind diesem Rundschreiben zu entnehmen.

Euro-Fixed-Income-Futures: Festlegung von Reporting- und Positionslimiten für September 2017

Die Reporting- und die Positionslimite in den Euro-Fixed-Income-Futures für die September 2017-Kontrakte wurden wie folgt festgesetzt:

- **Euro-Buxl®-Futures (FGBX) 30.000 Kontrakte**
- **Euro-Bund-Futures (FGBL) 60.000 Kontrakte**
- **Euro-Bobl-Futures (FGBM) 55.000 Kontrakte**
- **Euro-Schatz-Futures (FGBS) 45.000 Kontrakte**
- **Long-Term Euro-BTP-Futures (FBTP) 60.000 Kontrakte**
- **Short-Term Euro-BTP-Futures (FBTS) 40.000 Kontrakte**
- **Euro-OAT-Futures (FOAT) 60.000 Kontrakte**
- **Mid-Term-Euro-OAT-Futures (FOAM) 30.000 Kontrakte**
- **Euro-Bono-Futures (FBON) 30.000 Kontrakte**

Die Positionslimite beziehen sich ausschließlich auf Long-Positionen in den Front Month-Kontrakten der betroffenen Produkte. Reporting-Limite gelten in der Zeit vom **31. August 2017 nach Handelsschluss bis 4. September 2017 nach Handelsschluss.**

Positionslimite gelten in der Zeit vom **5. September 2017, Handelsbeginn, bis zum Verfall des September-Kontrakts am 7. September 2017**. Dementsprechend müssen zu Handelsbeginn am 5. September 2017 die Long-Positionen in den September 2017-Kontrakten innerhalb der vorgegebenen Limite sein.

Die getroffene Maßnahme der Eurex Deutschland und Eurex Zürich (zusammen: die Eurex-Börsen) basiert auf § 14 Abs. 1 der Börsenordnung der Eurex Deutschland und Eurex Zürich (Eurex-BörsO). Die Limite werden von der Handelsüberwachungsstelle der Eurex Deutschland während des Börsentages ständig überwacht. Bei Überschreitung der Positionslimite müssen die Börsenteilnehmer gemäß § 14 Abs. 5 der Eurex-BörsO eine Aufstellung aller Long-Positionen im Eurex C7 Clearing GUI inklusive der Kunden-Klarnamen an surveillance@eurexchange.com senden. Zur unverzüglichen Positionsbereinigung ist vorzugsweise das Instrument des „Trade Adjustment“ (Open/Close Adjustment) an Stelle des „Position Close-Out“ zu verwenden, um die beim „Position Close-Out“ gegebenenfalls anfallende „Late Closing Fee“ zu vermeiden.

Im Falle einer Überschreitung der Positionslimite werden die entsprechenden Teilnehmer durch die Eurex Deutschland oder durch die Eurex Zürich aufgefordert, jeweils eine Eurex-Benutzerkennung zu benennen, die zur Rückführung der Positionslimit-Überschreitung durch die Eurex-Börsen genutzt werden kann.

Sollten Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Maesa Beany unter Tel. +44-207 8 62-72 35 oder per E-Mail maesa.beany@eurexchange.com, oder an Jutta Frey-Hartenberger unter Tel. +49-69-211-1 49 88 oder per E-Mail jutta.frey-hartenberger@eurexchange.com.

14. August 2017