X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 100/10*

Datum: Frankfurt, 26. Mai 2010
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG
Autorisiert von: Peter Reitz

Optionen auf Euro Fixed Income Futures: Anpassung der Mistrade-Parameter

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 183/04

Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Zielgruppe:

- Ü Front Office/Handel
- Ü Middle + Backoffice
- Ü Revision/Security Coordination

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen haben beschlossen, mit Wirkung zum **1. Juni 2010** die Mistrade-Parameter in Optionen auf Fixed Income Futures anzupassen.

Eurex Deutschland
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
customer.support@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Thomas Book, Michael Peters,
Andreas Preuß, Peter Reitz,
Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

Optionen auf Euro Fixed Income Futures: Anpassung der Mistrade-Parameter

Zum 1. Juni 2010 werden die Mistrade-Parameter in Optionen auf Euro Fixed Income Futures an die für Market Maker gültigen Quote Spreads gekoppelt und wie folgt angepasst:

Derzeitige Mistrade-Parameter:

Referenzpreis (Punkte)	Mistrade Range (Punke)
0 - 0,29	0,03
0,30 - 1,0	10 % des Referenzpreises
> 1,00	0,10

Neue Mistrade-Parameter:

Referenz-preis (Punkte)	Mistrade Range (Punkte) Kontraktmonat 1	Mistrade Range (Punkte) Kontraktmonat ≥ 2	Mistrade Range (Punkte) 5 Handelstage vor Verfall
0 - 0,09	0,03	0,06	0,06
0,1 - 0,29	0,04	0,08	0,06
0,30 - 1,00	0,06	0,12	0,08
> 1,00	0,08	0,16	0,08

Im Fast Market verdoppeln sich die Maximum Market Maker Spreads nach Definition und Bekanntgabe dieser Handelsphase durch Eurex. Die Mistrade-Parameter entsprechen im Fast Market den erweiterten Quote Spreads der Optionen auf Euro Fixed Income Futures.

Frankfurt, 26. Mai 2010