X-pand into the Future

eurex rundschreiben 042/11

Datum: 16. Februar 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz

Hohe Priorität

Euro-Fixed-Income-Futures: Festlegung von Reporting- und Positionslimiten für März 2011

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 226/06, 088/10, 160/10, 228/10

Kontakt: Joachim Heinz: Tel. +49-69-211-1 59 55, E-Mail: joachim.heinz@eurexchange.com

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

Die Reporting- und die Positionslimite in den Euro-Fixed-Income-Futures für die **März 2011-Kontrakte** werden wie folgt festgesetzt:

- **Euro-Buxl-Future (FGBX) 30.000 Kontrakte**
- **Euro-Bund-Future (FGBL) 70.000 Kontrakte**
- **Euro-Bobl-Future (FGBM) 65.000 Kontrakte**
- **Euro-Schatz-Future (FGBS) 50.000 Kontrakte**
- **Long-Term Euro-BTP-Futures (FBTP) 30.000 Kontrakte**
- **Short-Term Euro BTP Futures (FBTS) 30.000 Kontrakte**

Die Limite beziehen sich ausschließlich auf Long-Positionen in den Front Month-Kontrakten der betroffenen Produkte. Reporting-Limite gelten in der Zeit vom **28. Februar 2011 nach Handelsschluss bis 3. März 2011 nach Handelsschluss**. Eine Überschreitung der Reporting-Limite löst ein Auskunftsersuchen seitens der Eurex-Börsen gegenüber dem Börsenteilnehmer aus. Positionslimite gelten in der Zeit vom **4. März 2011 Handelsbeginn** bis zum Verfall des März-Kontraktes am **8. März 2011**. Dementsprechend müssen zu Handelsbeginn am 4. März 2011 die Long-Positionen in den März 2011-Kontrakten innerhalb der vorgegebenen Limite sein.

Die Limite werden von Eurex Market Supervision und der Handelsüberwachungsstelle während des Börsentages ständig überwacht. 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.