

Bekanntmachung der Eurex Deutschland

Währungsderivate: Einführung von neuen FX-Futures auf skandinavische Währungspaare

Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland hat die Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland beschlossen.

Sie tritt mit Wirkung zum 06.09.2021 in Kraft.

Die Änderungen können auf der Internetseite der Eurex Deutschland (<http://www.eurexchange.com>) abgerufen und im „Präsenzordner Regelwerke“ der Eurex Deutschland am Empfang des Handelssaals, Börsenplatz 4, 60313 Frankfurt am Main, Deutschland, während der allgemeinen Öffnungszeiten eingesehen werden.

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

[...]

Teilabschnitt 1.18 Kontraktsspezifikationen für FX-Futures-Kontrakte

[...]

1.18.1 Kontraktgegenstand

[...]

(2) An der Eurex Deutschland stehen FX-Futures-Kontrakte mit den folgenden Kombinationen aus Basis- und Quotierungswährung zur Verfügung:

- [...]
- Euro-U.S. Dollar
- Euro – Dänische Krone
- Euro – Norwegische Krone
- Euro – Schwedische Krone
- U.S. Dollar-Schweizer Franken
- U.S. Dollar - Dänische Krone
- U.S. Dollar – Norwegische Krone
- U.S. Dollar - Schwedische Krone
- [...]
- Neuseeland Dollar - U.S. Dollar
- Norwegische Krone – Schwedische Krone

[...]

(3) Der Nennwert eines FX-Futures-Kontraktes beträgt 100.000 Einheiten (1.000.000 Einheiten für Norwegische Krone – Schwedische Krone Future) der Basiswährung.

[...]

1.18.5 Preisabstufungen

Der Preis eines FX-Futures-Kontraktes wird als Dezimalzahl mit fünf Nachkommastellen ermittelt. Die kleinste Preisveränderung (Tick) beträgt 0,00001, dies entspricht einem Wert je FX-Futures-Kontrakt von 1 Einheit (10 Einheiten für Norwegische Krone – Schwedische Krone Future Kontrakt) der Quotierungswährung.

[...]

[...]

Abschnitt 3 Kontrakte Off-Book

[...]

Teilabschnitt 3.2 Für den Off-Book-Handel zugelassene Kontrakte

[...]

3.2.1 Blockgeschäfte

[...]

Produkt	Zusätzliche Kontraktvarianten J/N	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte	
		TES	Eurex EnLight und von QTPIP getätigte Eingaben *
[...]			
Währungsderivate-Futures			
[...]			
Neuseeland Dollar – U.S. Dollar Futures (FCNU)	N	1	1
<u>Euro - Schwedische Krone (FCSK)</u>	<u>N</u>	<u>1</u>	<u>1</u>
<u>Euro – Dänische Krone (FCDK)</u>	<u>N</u>	<u>1</u>	<u>1</u>
<u>Euro – Norwegische Krone (FCNK)</u>	<u>N</u>	<u>1</u>	<u>1</u>
<u>U.S. Dollar – Dänische Krone (FCUD)</u>	<u>N</u>	<u>1</u>	<u>1</u>
<u>U.S. Dollar – Norwegische Krone (FCUN)</u>	<u>N</u>	<u>1</u>	<u>1</u>
<u>U.S. Dollar – Schwedische Krone (FCUS)</u>	<u>N</u>	<u>1</u>	<u>1</u>
<u>Norwegische Krone – Schwedische Krone (FCNS)</u>	<u>N</u>	<u>1</u>	<u>1</u>
[...]			

* Als von QTPIP getätigte Eingaben gelten Eingaben gemäß Ziffer 4.6 (3) der Bedingungen für den Handel an der Eurex Deutschland. Für Eingaben von STPIP gemäß Ziffer 4.6 (2) gelten die Bestimmungen für die Eingabe von TES Geschäften.

[...]

[...]

Teilabschnitt 3.3 Für den Off-Book-Handel zulässige Referenzgeschäfte

[...]

3.3.3 Referenzgeschäfte im Rahmen des EFP-I-Trade-Service

[...]

3.3.3.3 FX-Futures-Kontrakte

[...]

Referenzinstrumente	Eurex Kontrakt
[...]	
Nicht-Eurex* Neuseeland Dollar-U.S. Dollar Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions	Neuseeland Dollar - U.S. Dollar Futures
<u>Nicht-Eurex* Euro – Dänische Krone Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Eurex Euro – Dänische Krone Futures</u>
<u>Nicht-Eurex* Euro- Norwegische Krone Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Eurex Euro – Norwegische Krone Futures</u>
<u>Nicht-Eurex* Euro - Schwedische Krone Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Eurex Euro – Schwedische Krone Futures</u>
<u>Nicht-Eurex* U.S. Dollar – Dänische Krone Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Eurex U.S. Dollar – Dänische Krone Futures</u>
<u>Nicht-Eurex* U.S. Dollar – Norwegische Krone Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Eurex U.S. Dollar – Norwegische Krone Futures</u>
<u>Nicht-Eurex* U.S. Dollar – Schwedische Krone Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Eurex U.S. Dollar – Schwedische Krone Futures</u>
<u>Nicht-Eurex* Norwegische Krone – Schwedische Krone Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Eurex Norwegische Krone – Schwedische Krone Futures</u>

* Nicht-Eurex FX-Futures in diesem Sinne sind alle außerhalb der Eurex Deutschland gehandelten FX-Futures Geschäfte.

[...]

[...]

Annex C zu den Kontraktsspezifikationen:

[...]

FX-Futures-Kontrakte

Produkt	Produkt-ID	Pre-Trading - Periode	Fortlaufender Handel	Post-Trading Full Periode	Off-book Trading Periode	Off-book Post-Trading Full Periode	Letzter Handelstag
							Handel bis
[...]							
Neuseeland Dollar - U.S. Dollar Futures	FCNU	00:55 – 01:00 MEZ	01:00 MEZ – 17:00 ET	17:00 ET – 17:05 ET	01:00 MEZ – 17:00 ET	17:00 ET – 17:05 ET	15:00 MEZ
<u>Euro – Dänische Krone Futures</u>	<u>FCDK</u>	<u>00:55 – 01:00 MEZ</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>15:00 MEZ</u>
<u>Euro - Norwegische Krone Futures</u>	<u>FCNK</u>	<u>00:55 – 01:00 MEZ</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>15:00 MEZ</u>
<u>Euro – Schwedische Krone Futures</u>	<u>FCSK</u>	<u>00:55 – 01:00 MEZ</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>15:00 MEZ</u>
<u>U.S. Dollar – Dänische Krone Futures</u>	<u>FCUD</u>	<u>00:55 – 01:00 MEZ</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>15:00 MEZ</u>
<u>U.S. Dollar – Norwegische Krone Futures</u>	<u>FCUN</u>	<u>00:55 – 01:00 MEZ</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>15:00 MEZ</u>
<u>U.S. Dollar – Schwedische Krone Futures</u>	<u>FCUS</u>	<u>00:55 – 01:00 MEZ</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>15:00 MEZ</u>
<u>Norwegische Krone- Schwedische Krone Futures</u>	<u>FCNS</u>	<u>00:55 – 01:00 MEZ</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>01:00 MEZ – 17:00 ET</u>	<u>17:00 ET – 17:05 ET</u>	<u>15:00 MEZ</u>

An dem Verfalltag einer Serie (der dem dritten Mittwoch des Verfallsmonats unmittelbar vorausgehende zweite Börsentag) endet der fortlaufende und der Off-Book Handel für den verfallenden Kontrakt um 15:00 Uhr.

Alle Zeiten in MEZ, sofern nichts anderes angegeben ist:

ET bezeichnet die Ortszeit New York, USA (d.h. Eastern Standard Time, Eastern Daylight Savings Time)

[...]

Die vorstehende Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland wird hiermit ausgefertigt. Die Änderung tritt dem Beschluss der Geschäftsführung der Eurex Deutschland entsprechend am 06.09.2021 in Kraft.

Frankfurt am Main, 02.08.2021

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters