

*X-pand into the Future*



# **eurex** *Bekanntmachung*

**FX-Futures-Kontrakte und FX-Optionskontrakte:  
Änderung des letzten Handelstages und des Schlussabrechnungstages**

**Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der  
Eurex Deutschland und der Eurex Zürich (eurex14)**

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

Sie tritt mit Wirkung zum 20.11.2017 in Kraft.

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

## **1.18 Teilabschnitt: Kontraktsspezifikationen für FX-Futures-Kontrakte**

Dieser Teilabschnitt enthält die Kontraktausgestaltung für Futures-Kontrakte auf Währungen (Foreign Exchange), welche nachfolgend als „FX-Futures-Kontrakte“ bezeichnet werden.

[...]

### **1.18.2 Verpflichtung zur Erfüllung**

- (1) Nach Handelsschluss ist der Verkäufer eines FX-Futures-Kontraktes verpflichtet, einen Betrag in der Basiswährung in Höhe des Nennwerts des FX-Futures-Kontraktes zu zahlen.
- (2) Der Käufer eines FX-Futures-Kontraktes ist verpflichtet, einen Betrag in der Quotierungswährung in Höhe (i) des Nennwerts des FX-Futures-Kontraktes multipliziert mit (ii) dem Schlussabrechnungspreis (Kapitel II [Abschnitt 2](#) Ziffer 2.189.2 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG) zu zahlen.

### **1.18.3 Laufzeit**

- (1) Für FX-Futures-Kontrakte stehen an den Eurex-Börsen Laufzeiten bis zum Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.189.4 Absatz 1) der jeweils nächsten drei Monate, der darauffolgenden drei Quartalsmonate (März, Juni, September, Dezember) sowie der darauffolgenden vier Halbjahresmonate (Juni, Dezember) zur Verfügung.
- (2) Nach Ablauf von FX-Futures-Kontrakten gemäß Absatz 1 werden nachfolgende Kontrakte am zweiten Börsentag nach dem letzten Handelstag des entsprechenden Verfallmonats eingeführt.

#### 1.18.4 Letzter Handelstag, Schlussabrechnungstag, Handelsschluss

(1) Letzter Handelstag und Schlussabrechnungstag der FX-Futures-Kontrakte ist der zweite Börsentag, der dem dritten Mittwoch des jeweiligen Monats unmittelbar vorausgeht, in dem die Laufzeit des FX-Futures-Kontraktes endet.

~~(2) Fällt der letzte Handelstag auf einen Feiertag, so ist der dem Feiertag vorausgehende Börsentag der letzte Handelstag.~~

~~(3)~~(2) Handelsschluss der FX-Futures-Kontrakte am letzten Handelstag ist 15:00 Uhr MEZ.

[...]

#### 2.12 Teilabschnitt: Kontraktsspezifikationen für FX-Optionskontrakte

Dieser Teilabschnitt enthält die Kontraktsgestaltung für Optionskontrakte auf Währungen (Foreign Exchange), welche nachfolgend als „FX-Optionskontrakte“ bezeichnet werden.

[...]

#### 2.12.4 Laufzeit

Für FX-Optionskontrakte stehen an den Eurex-Börsen Laufzeiten bis zum Schlussabrechnungstag (wie in Ziffer 2.12.3.5 Absatz 1 definiert) der jeweils nächsten drei Monate, der darauffolgenden drei Quartalsmonate (März, Juni, September, Dezember) sowie der darauffolgenden vier Halbjahresmonate (Juni, Dezember) zur Verfügung.

#### 2.12.5 Letzter Handelstag, Schlussabrechnungstag, Handelsschluss

(1) Letzter Handelstag und Schlussabrechnungstag bei den FX-Optionskontrakten ist der zweite Börsentag, der dem dritten Mittwoch des jeweiligen Monats unmittelbar vorausgeht, in dem die Laufzeit des FX-Optionskontraktes endet.

~~(2) Fällt der letzte Handelstag auf einen Feiertag, so ist der dem Feiertag vorausgehende Börsentag der letzte Handelstag.~~

(3) Handelsschluss der FX-Optionskontrakte am letzten Handelstag ist 15.00 Uhr MEZ.

[...]

**Annex C zu den Kontraktsspezifikationen:**

**Handelszeiten Futures-Kontrakte**

[...]

**FX-Futures-Kontrakte**

Produkt	Produkt-ID	Pre-Trading-Periode	Fortlaufender Handel	Post-Trading-Periode bis	Off-book Trading Periode <sup>1</sup>	Off-book Post-Trading Periode bis	Letzter Handelstag	
							Handel bis	
Britisches Pfund-Schweizer Franken Futures	FCPF	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
Britisches Pfund-U.S. Dollar Futures	FCPU	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
Euro-Britisches Pfund Futures	FCEP	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
Euro-Schweizer Franken Futures	FCEF	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
Euro-U.S. Dollar Futures	FCEU	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
U.S. Dollar-Schweizer Franken Futures	FCUF	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
Australischer Dollar – U.S. Dollar Futures	FCAU	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
Australischer Dollar - Japanischer Yen Futures	FCAY	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
Euro - Australischer Dollar Futures	FCEA	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
Euro - Japanischer Yen Futures	FCEY	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
U.S. Dollar - Japanischer Yen Futures	FCUY	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	
Neuseeland Dollar - U.S. Dollar Futures	FCNU	23:55–00:00	00:00–23:00	23:05	00:00-23:00	23:05	15:00	

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 MEZ**

[...]

<sup>1</sup> Am ersten Handelstag nach einem Wochenende oder einem Feiertag startet die Off-Book-Nutzungszeit um 00:30 MEZ

**Handelszeiten Optionskontrakte**

[...]

**FX-Optionskontrakte**

Produkt	Produkt- kürzel	Pre-Trading- Periode	Fortlaufende r Handel	Post-Trading Periode bis	Off-book Trading Periode	Off-book Post-Trading Periode bis	Letzter Handelstag	
							Handel bis	Aus- übung bis
Britisches Pfund- Schweizer Franken Optionen	OCPF	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
Britisches Pfund-U.S. Dollar Optionen	OCPU	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
Euro-Britisches Pfund Optionen	OCEP	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
Euro-Schweizer Franken Optionen	OCEF	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
Euro-U.S. Dollar Optionen	OCEU	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
U.S. Dollar-Schweizer Franken Optionen	OCUF	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
Australischer Dollar – U.S. Dollar Optionen	OCAU	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
Australischer Dollar - Japanischer Yen Optionen	OCAJ	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
Euro - Australischer Dollar Optionen	OCEA	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
Euro - Japanischer Yen Optionen	OCEY	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
U.S. Dollar - Japanischer Yen Optionen	OCUY	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00
Neuseeland Dollar - U.S. Dollar Optionen	OCNU	07:30-08:00	08:00-19:30	20:30	08:00-20:00	20:15	15:00	16:00

An dem Verfallstag 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 MEZ

[...]

\*\*\*\*\*

Die vorstehende Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich wird hiermit ausgefertigt. Die Änderung tritt dem Beschluss der Geschäftsführung der Eurex Deutschland entsprechend am 20.11.2017 in Kraft.

Frankfurt am Main, 27.10.2017  
Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Mehtap Dinc

Dr. Randolph Roh