

X-pand into the Future



e u r e x *B e k a n n t m a c h u n g*

Optionen auf Dreimonats-EURIBOR Futures: Einführung eines Freitags-Verfallszyklus für EURIBOR-Optionen und für ein- bis vierjährige EURIBOR-Mid-Curve-Optionen

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 31.08.2015 in Kraft.

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

**1. Abschnitt:
Kontraktsspezifikationen für Futureskontrakte**

[...]

1.1.4 Letzter Handelstag, Schlussabrechnungstag, Handelsschluss

- (1) Letzter Handelstag und Schlussabrechnungstag des Dreimonats-EURIBOR-Futures-Kontrakts ist der zweite Börsentag – soweit von dem ~~European Money Markets Institute (EMMI) Banking Federation (FBE) und Financial Market Association (ACI)~~ European Money Markets Institute (EMMI) Banking Federation (FBE) und Financial Market Association (ACI) an diesem Tag der für Dreimonats-Termingelder maßgebliche Referenz-Zinssatz EURIBOR festgestellt wird, ansonsten der davor liegende Börsentag – vor dem dritten Mittwoch des jeweiligen Erfüllungsmonats (Quartalsmonat gemäß Ziffer 1.1.3 Absatz 1).

Handelsschluss der Dreimonats-EURIBOR-Futures-Kontrakte an dem letzten Handelstag ist 11:00 Uhr MEZ.

- (2) [...]

**2. Abschnitt:
Kontraktsspezifikationen für Optionskontrakte**

[...]

**2.2 Teilabschnitt:
Kontraktsspezifikationen für Optionskontrakte auf Geldmarkt-Futures-Kontrakte**

[...]

2.2.6 Letzter Handelstag, Handelsschluss

Der letzte Handelstag einer Optionsserie ist der Tag, an dem diese Optionsserie den Börsenteilnehmern im System der Eurex Börsen letztmalig zum Handel und zum Clearing zur Verfügung steht.

(1) Für

§ Optionsserien in EURIBOR Optionen (OEU3) die mit dem zugrundeliegenden Futures-Kontrakt (FEU3) in einem identischen Quartalsmonat des Zyklus März, Juni, September und Dezember gemäss Ziffer 1.1.3 Absatz 1 verfallen

§ die Optionsserien September 2015 und Dezember 2015 in ein- bis vierjährigen EURIBOR Mid-Curve Optionen (OEM1-4)

§ die Serien OEM1 Jun16 und OEM2 Mar16

gilt Folgendes:

Letzter Handelstag ~~Dies~~ ist der zweite Börsentag - soweit von dem ~~er~~ European Money Markets Institute (EMMI) ~~Banking Federation (FBE) und Financial Market Association (ACI)~~ an diesem Tag der für Dreimonats-Termingelder maßgebliche Referenz-Zinssatz EURIBOR festgestellt wird, ansonsten der davor liegende Börsentag - vor dem dritten Mittwoch des jeweiligen Erfüllungsmonats (Quartalsmonat gemäß Ziffer 1.1.3 Absatz 1).

Handelsschluss an dem letzten Handelstag ist 11:00 Uhr MEZ.

(2) Für

§ Optionsserien in ein- bis vierjährigen EURIBOR Mid-Curve Optionen (OEM1-4), die nach dem 31. August 2015 eingeführt werden

§ Optionsserien in EURIBOR Optionen (OEU3), die nach dem 31. August 2015 eingeführt werden und die gemäss Ziffer 1.1.3 Absatz 1 nicht in dem Quartalsmonat des Zyklus März, Juni, September und Dezember verfallen

§ alle bereits eingeführten Serien Oktober 2015, November 2015, Januar 2016 und Februar 2016 in EURIBOR Optionen (OEU3) und ein- bis vierjährigen EURIBOR Mid-Curve Optionen (OEM1-4) sowie für die Serien OEM1 Mar16, OEM2 Jun16, OEM3 Mar16 und Jun16 und OEM4 Mar16 und Jun16

gilt Folgendes:

Letzter Handelstag ist der Freitag – soweit von dem European Money Markets Institute (EMMI) an diesem Tag der für Dreimonats-Termingelder maßgebliche Referenz-Zinssatz EURIBOR festgestellt wird, ansonsten der davor liegende Börsentag – vor dem dritten Mittwoch des jeweiligen Erfüllungsmonats.

Handelsschluss an dem letzten Handelstag ist 17:15 Uhr MEZ.

2.2.7 Ausübungspreise

[...]

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 31.08.2015 in Kraft.

Frankfurt am Main, 31.08.2015

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Mehtap Dinc

Michael Peters