

X-pand into the Future



eurex *Bekanntmachung*

Fixed Income-Futures: Änderung der ursprünglichen Laufzeit der Schuldverschreibungen für Futures-Kontrakte auf fiktive Schuldverschreibungen des Königreichs Spanien (Euro-Bono-Futures)

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 08.12.2017 in Kraft.

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Teilabschnitt 2.1 Kontraktsspezifikationen für Fixed Income Futures-Kontrakte

Der folgende Teilabschnitt enthält die Kontraktgestaltung für Futures-Kontrakte auf fiktive Schuldverschreibungen der Bundesrepublik Deutschland mit unterschiedlichen Laufzeiten (Euro-Schatz-Futures, Euro-Bobl-Futures, Euro-Bund-Futures und Euro-Buxl®-Futures), Futures-Kontrakte auf fiktive Schuldverschreibungen der Republik Italien (Buoni del Tesoro Poliennali) mit unterschiedlichen Laufzeiten (Short-term Euro-BTP-Futures, Mid-term Euro-BTP-Futures, Euro-BTP-Futures), Futures-Kontrakte auf fiktive Schuldverschreibungen der Republik Frankreich mit unterschiedlichen Laufzeiten (Euro-OAT-Futures und Mid-Term-Euro-OAT-Futures; OAT: Obligations Assimilables du Trésor) sowie Futures-Kontrakte auf fiktive langfristige Schuldverschreibungen des Königreichs Spanien (Euro-Bono-Futures; Bono: Obligaciones del Estado), welche nachfolgend gemeinsam als „Euro-Fixed Income Futures“ bezeichnet werden und Futures-Kontrakte auf eine fiktive langfristige Anleihe der Schweizerischen Eidgenossenschaft (CONF-Futures).

2.1.1 Kontraktgegenstand

- (1) Ein Euro-Fixed Income Futures ist ein Terminkontrakt auf eine fiktive Schuldverschreibung der Bundesrepublik Deutschland
 - mit 1,75- bis 2,25-jähriger Laufzeit und einer ursprünglichen Laufzeit von nicht länger als elf Jahren sowie einem Kupon von 6 Prozent (Euro-Schatz-Futures),
 - mit 4,5- bis 5,5-jähriger Laufzeit und einer ursprünglichen Laufzeit von nicht länger als elf Jahren sowie einem Kupon von 6 Prozent (Euro-Bobl-Futures),
 - mit 8,5- bis 10,5-jähriger Laufzeit und einer ursprünglichen Laufzeit von nicht länger als elf Jahren sowie einem Kupon von 6 Prozent (Euro-Bund-Futures),
 - mit 24- bis 35-jähriger Laufzeit und einem Kupon von 4 Prozent (Euro-Buxl®-Futures)

oder ein Terminkontrakt auf eine fiktive Schuldverschreibung der Republik Italien

- mit 8,5 bis 11-jähriger Laufzeit und einer ursprünglichen Laufzeit von nicht länger als 16 Jahren sowie einem Kupon von 6 Prozent (Euro-BTP-Futures),

- mit 4,5 bis 6-jähriger Laufzeit und einer ursprünglichen Laufzeit von nicht länger als 16 Jahren sowie einem Kupon von 6 Prozent (Mid-term Euro-BTP-Futures),
- mit 2 bis 3,25-jähriger Laufzeit und einem Kupon von 6 Prozent (Short-term Euro-BTP-Futures),

oder ein Terminkontrakt auf eine fiktive Schuldverschreibung der Republik Frankreich

- mit 8,5 bis 10,5-jähriger Laufzeit und einer ursprünglichen Laufzeit von nicht länger als 17 Jahren sowie einem Kupon von 6 Prozent (Euro-OAT-Futures),
- mit 4,5 bis 5,5-jähriger Laufzeit und einer ursprünglichen Laufzeit von nicht länger als 17 Jahren sowie einem Kupon von 6 Prozent (Mid-Term-Euro-OAT-Futures).

oder ein Terminkontrakt auf eine fiktive Schuldverschreibung des Königreichs Spanien

- mit 8,5 bis 10,5-jähriger Laufzeit und einem Kupon von 6 Prozent. Die ~~und einer~~ ursprüngliche~~n~~ Laufzeit ~~beträgt von~~ nicht länger als 20 Jahren ~~für alle Kontrakte, die vor September 2018 verfallen. Bei allen Kontrakten, die ab September 2018 (einschließlich) verfallen, beträgt die ursprüngliche Laufzeit nicht länger als 15 Jahre sowie einem Kupon von 6 Prozent (Euro-Bono-Futures) (Euro-Bono-Futures).~~

Der Nominalwert eines Kontrakts beträgt EUR 100.000.

- (2) Ein CONF-Futures ist ein Terminkontrakt auf eine fiktive Anleihe der Schweizerischen Eidgenossenschaft mit acht- bis 13-jähriger Restlaufzeit und einem Zinssatz von 6 Prozent. Der Nominalwert eines Kontrakts beträgt CHF 100.000.

[...]

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 08.12.2017 in Kraft.

Frankfurt am Main, 14.11.2017

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Mehtap Dinc

Michael Peters