

X-pand into the Future



eurex *Bekanntmachung*

**Optionskontrakte auf Euro Fixed Income Futures:
Klärung der Definition des letzten Handelstages**

**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 28.11.2016 in Kraft.

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

2. Abschnitt: Kontraktsspezifikationen für Optionskontrakte

[...]

2.3 Teilabschnitt: Kontraktsspezifikationen für Optionskontrakte auf Fixed Income Futures-Kontrakte

[...]

2.3.6 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.

Bei den wöchentlichen Optionsverfällen ist dies jeweils der Freitag der jeweiligen Verfallwoche der wöchentlichen Option. Ist dieser Freitag kein Börsentag, ist der unmittelbar vor dem Freitag liegende Börsentag der letzte Handelstag. Fällt der unmittelbar vorhergehende Börsentag nicht in denselben Kalendermonat wie der Freitag der Verfallwoche, so ist der letzte Handelstag der auf den Freitag der Verfallwoche unmittelbar folgende Börsentag. Für nach Satz 2 bestimmte Tage, die zwischen Weihnachten und Silvester liegen, wird keine wöchentliche Option zur Verfügung stehen.

~~Bei den monatlichen Verfällen~~ Der letzte Handelstag einer monatlich verfallenden Option ist diesgrundsätzlich der letzte Freitag vor dem ersten Kalendertag des Verfallmonats, ~~sofern diesem dem~~ noch mindestens zwei Börsentage vor dem ersten Kalendertag des Verfallmonats folgen. Sofern nicht mindestens 2 Börsentage zwischen dem letzten Freitag eines Monats und dem ersten Kalendertag des Verfallmonats liegen, ist der letzte Handelstag der dem letzten Freitag eines Monats vorhergehende Freitag. Ist dieser so bestimmte Freitag jedoch kein Börsentag, ~~oder ein Freitag, der zwar ein Börsentag ist, dem jedoch nur ein Börsentag vor dem ersten Kalendertag des Verfallmonats folgt,~~ ist der unmittelbar vor ~~dem diesem~~ Freitag liegende Börsentag der letzte Handelstag.

Liegt der ~~nach Satz 2 bestimmte Tag~~nach den Sätzen 6 und 7 beschriebene letzte Handelstag zwischen Weihnachten und Silvester, so ist der letzte Freitag vor dem so bestimmten Tag der letzte Handelstag. Ist dieser Freitag kein Börsentag, ist der unmittelbar vor diesem Freitag liegende Börsentag der letzte Handelstag.

Börsentag im Sinne dieses Abschnitts ist ein Tag, der sowohl ein Börsentag an den Eurex-Börsen als auch ein US-amerikanischer Geschäftstag ist. Zur Klarstellung: Der 24. und 31. Dezember sind keine Börsentage.

Handelsschluss an dem letzten Handelstag ist 17:15 Uhr 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 28.11.2016 in Kraft.

Frankfurt am Main, 16.11.2016

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Mehtap Dinc

Michael Peters