

*X-pand into the Future*



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

**Geldmarktderivate: Änderung der Kontraktsspezifikationen für den EONIA-Future (FEO1) und den EUR Secured Funding-Future (FLIC)**

**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 21.07.2015 in Kraft.

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

## 1. Abschnitt: Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

### 1.1 Teilabschnitt: Kontraktsspezifikationen für Geldmarkt-Futures-Kontrakte

[...]

#### 1.1.3 Laufzeit

- (1) Für Dreimonats-EURIBOR-Futures-Kontrakte stehen an den Eurex-Börsen Laufzeiten bis zum Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.1.4 Absatz 1) der nächsten zwanzig Quartalsmonate (März, Juni, September, Dezember) zur Verfügung.
- (2) Für EONIA-Futures-Kontrakte stehen an den Eurex-Börsen maximal Laufzeiten bis zum Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.1.4 Absatz 2) der laufenden von den Eurex-Börsen bestimmten Periode und der folgenden vier von den Eurex-Börsen bestimmten Perioden zur Verfügung, wie in Ziffer 1.1.3 Absatz 4 aufgelistet.
- (3) Für EUR Secured Funding-Futures-Kontrakte stehen an den Eurex-Börsen maximal Laufzeiten bis zum Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.1.4 Absatz 3) der laufenden von den Eurex-Börsen bestimmten Periode und der folgenden vier von den Eurex-Börsen bestimmten Perioden zur Verfügung, wie in Ziffer 1.1.3 Absatz 4 aufgelistet.
- (4) Von den Eurex-Börsen bestimmte Perioden für EUR Secured Funding-Futures und EONIA-Futures (es können Perioden aufgeführt sein, welche nach Ziffer 1.1.3 Absatz 3 und Absatz 2 noch nicht oder nicht mehr zur Verfügung stehen):

Erster Referenz- ratenbeobachtungs- tag	Futures Verfalltag, Letzter Referenzraten- beobachtungstag	Periodenlänge (Tagen)	Verfallsmonat im Eurex System
10-Deze-14	27-Jan-15	49	Jan-15
28-Jan-15	10-Mär-15	42	Mär-15

Erster Referenz- ratenbeobachtungs- tag	Futures Verfalltag, Letzter Referenzraten- beobachtungstag	Periodenlänge (Tagen)	Verfallsmonat im Eurex System
11-Mär-15	21-Apr-15	42	Apr-15
22-Apr-15	09-Jun-15	49	Jun-15
10-Jun-15	21-Jul-15	42	Jul-15
22-Jul-15	08-Sep-15	49	Sep-15
09-Sep-15	27-Okt-15	49	Oct-15
28-Okt-15	08-Deze-15	42	Dec-15
09-Deze-15	26-Jan-16	49	Jan-16
<u>27-Jan-16</u>	<u>15-Mär-16</u>	<u>49</u>	<u>Mär-16</u>
<u>16-Mär-16</u>	<u>26-Apr-16</u>	<u>42</u>	<u>Apr-16</u>
<u>27-Apr-16</u>	<u>07-Jun-16</u>	<u>42</u>	<u>Jun-16</u>
<u>08-Jun-16</u>	<u>26-Jul-16</u>	<u>49</u>	<u>Jul-16</u>
<u>27-Jul-16</u>	<u>13-Sep-16</u>	<u>49</u>	<u>Sep-16</u>
<u>14-Sep-16</u>	<u>25-Okt-16</u>	<u>42</u>	<u>Okt-16</u>
<u>26-Okt-16</u>	<u>13-Dez-16</u>	<u>49</u>	<u>Dez-16</u>
<u>14-Dez-16</u>	<u>24-Jan-17</u>	<u>42</u>	<u>Jan-17</u>

[...]

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 21.07.2015 in Kraft.

Frankfurt am Main, 06.07.2015

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Mehtap Dinc

Michael Peters