



eurex rundschriften 246/14

Datum: 19. November 2014
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Mehtap Dinc

 **Hohe Priorität**

Euro-Fixed-Income-Futures: Festlegung von Reporting- und Positionslimiten für Dezember 2014

Verweis auf Eurex-Rundschriften: 226/06, 039/14, 101/14, 188/14

Kontakt: Lorena Dishnica, T +44 207 8 62-72 42, lorena.dishnica@eurexexchange.com

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- Revision/Security Coordination

Anhänge:

keine

Die Reporting- und die Positionslimite in den Euro-Fixed-Income-Futures für die **Dezember 2014-Kontrakte** werden wie folgt festgesetzt:

- | | |
|--------------------------------------|------------------|
| • Euro-Buxl-Futures (FGBX) | 30.000 Kontrakte |
| • Euro-Bund-Futures (FGBL) | 60.000 Kontrakte |
| • Euro-Bobl-Futures (FGBM) | 60.000 Kontrakte |
| • Euro-Schatz-Futures (FGBS) | 45.000 Kontrakte |
| • Long-Term Euro-BTP-Futures (FBTP) | 60.000 Kontrakte |
| • Short-Term Euro-BTP-Futures (FBTS) | 30.000 Kontrakte |
| • Euro-OAT-Futures (FOAT) | 60.000 Kontrakte |
| • Mid-Term-Euro-OAT-Futures (FOAM) | 30.000 Kontrakte |

Die Limite beziehen sich ausschließlich auf Long-Positionen in den Front Month-Kontrakten der betroffenen Produkte. Reporting-Limite gelten in der Zeit vom **28. November 2014 nach Handelsschluss bis 3. Dezember 2014 nach Handelsschluss**. Eine Überschreitung der Reporting-Limite löst ein Auskunftersuchen seitens der Eurex-Börsen gegenüber dem Börsenteilnehmer aus. Positionslimite gelten in der Zeit vom **4. Dezember 2014 Handelsbeginn** bis zum Verfall des Dezember-Kontrakts am **8. Dezember 2014**. Dementsprechend müssen zu Handelsbeginn am 4. Dezember 2014 die Long-Positionen in den Dezember 2014-Kontrakten innerhalb der vorgegebenen Limite sein.

Die Limite werden von Eurex Market Supervision und der Handelsüberwachungsstelle während des Börsentages ständig überwacht. Zur unverzüglichen Positionsbereinigung ist vorzugsweise das Instrument des **Trade Adjustment** (Open/Close Adjustment) an Stelle des **Position Close-Out** zu verwenden, um die beim Position Close-Out gegebenenfalls anfallende Late Closing Fee zu vermeiden.

Im Falle einer Überschreitung der Positionslimite werden die entsprechenden Teilnehmer durch die Eurex Deutschland oder durch die Eurex Zürich aufgefordert, jeweils eine Eurex-Benutzerkennung zu benennen, die zur Rückführung der Positionslimit-Überschreitung durch die Eurex-Börsen genutzt werden kann.

