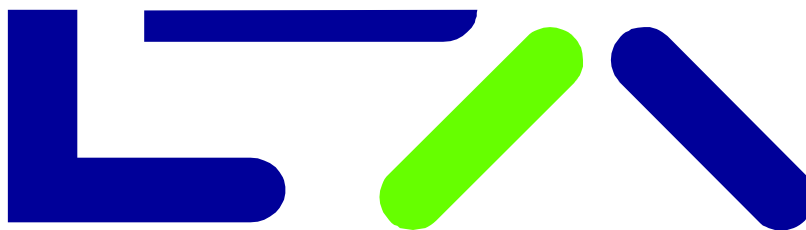


X-pand into the Future



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

Neue Verfalls- und Schlussabrechnungsdaten für EONIA-Futures (FEO1)

Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland (eurex14)

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland hat die Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland beschlossen.

Sie tritt mit Wirkung zum 01.10.2019 in Kraft.

Die Änderungen können im „Präsenzordner Regelwerke“ der Eurex am Empfang, Börsenplatz 4, eingesehen und im Internet auf der Internetseite der Eurex (<http://www.eurexchange.com>) abgerufen werden.

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

Teilabschnitt 1.1 Kontraktsspezifikationen für Geldmarkt-Futures-Kontrakte

Der folgende Teilabschnitt enthält die Kontraktgestaltung für Futures-Kontrakte auf den Zinssatz für Dreimonats-Termingeld in Euro (Dreimonats-EURIBOR-Futures) und Futures-Kontrakte auf den Dreimonatsdurchschnitt der effektiven Zinssätze für Tagesgeld bei Repo-Transaktionen in Schweizer Franken im Interbankengeschäft - SARON® (Dreimonats-SARON®-Futures) und Futures-Kontrakte auf den MonatsD Durchschnitt der effektiven Zinssätze für Tagesgeld im Interbankengeschäft - €STR + fester Spread EONIA (-EONIA-Futures) und Futures-Kontrakte auf den Durchschnitt der effektiven STOXX GC Pooling EUR Deferred Funding Rate (EUR Secured Funding-Futures) während einer von der Eurex Deutschland bestimmten Periode, welche nachfolgend gemeinsam als „Geldmarkt-Futures-Kontrakte“ bezeichnet werden.

1.1.1 Kontraktgegenstand

[...]

- (3) Ein EONIA-Futures ist ein Terminkontrakt auf den Durchschnitt aller während der Laufzeit einer von der Eurex Deutschland bestimmten Periode ermittelten effektiven Zinssätze für Tagesgeld in Euro (EONIA = €STR + Spread) unter Berücksichtigung des Zinseszins effekts. Der Wert eines Kontrakts beträgt EUR 1.000.000.

[...]

[...]

1.1.3 Laufzeit

[...]

- (4) Für EUR Secured Funding-Futures-Kontrakte stehen an der Eurex Deutschland maximal Laufzeiten bis zum Schlussabrechnungstag (Ziffer 1.1.4 Abs. 4) der laufenden von der Eurex Deutschland bestimmten Periode und der folgenden vier

von der Eurex Deutschland bestimmten Perioden zur Verfügung, wie in Ziffer 1.1.3 Abs. ~~65~~ aufgelistet.

- (5) Von der Eurex Deutschland bestimmte Perioden für ~~EUR Secured Funding Futures~~ und EONIA-Futures (es können Perioden aufgeführt sein, welche nach Ziffer 1.1.3 Abs. 3 und Absatz 4 noch nicht oder nicht mehr zur Verfügung stehen):

Erster Referenzraten- beobachtungstag	Futures Verfallstag <u>Letzter Handelstag, Letzter Referenzraten- beobachtungstag</u>	Futures Verfallstag	Periodenlänge (Tage)	Verfallsmonat im Eurex System
31. Okt 18	18. Dez 18	18. Dez 18	49	Dez 18
19. Dez 18	29. Jan 19	29. Jan 19	42	Jan 19
30. Jan 19	12. Mrz 19	12. Mrz 19	42	Mrz 19
13. Mrz 19	16. Apr 19	16. Apr 19	35	Apr 19
17. Apr 19	11. Jun 19	11. Jun 19	56	Jun 19
12. Jun 19	30. Jul 19	30. Jul 19	49	Jul 19
31. Jul 19	17. Sep 19	17. Sep 19	42	Okt 19
18. Sep 19	29. Okt 19	30. Okt 19	42	Okt 19
30. Okt 19	17. Dez 19	18. Dez 19	49	Dez 19
18. Dez 19	28. Jan 19	29. Jan 19	42	Jan 20

- (6) Von der Eurex Deutschland bestimmte Perioden für EUR Secured Funding Futures (es können Perioden aufgeführt sein, welche nach Ziffer 1.1.3 Abs. 3 und Abs. 4 noch nicht oder nicht mehr zur Verfügung stehen):

<u>Erster Referenzraten- beobachtungstag</u>	<u>Futures Verfallstag, Letzter Referenzraten- beobachtungstag</u>	<u>Periodenlänge (Tage)</u>	<u>Verfallsmonat im Eurex System</u>
<u>31. Okt 18</u>	<u>18. Dez 18</u>	<u>49</u>	<u>Dez 18</u>
<u>19. Dez 18</u>	<u>29. Jan 19</u>	<u>42</u>	<u>Jan 19</u>
<u>30. Jan 19</u>	<u>12. Mrz 19</u>	<u>42</u>	<u>Mrz 19</u>
<u>13. Mrz 19</u>	<u>16. Apr 19</u>	<u>35</u>	<u>Apr 19</u>
<u>17. Apr 19</u>	<u>11. Jun 19</u>	<u>56</u>	<u>Jun 19</u>
<u>12. Jun 19</u>	<u>30. Jul 19</u>	<u>49</u>	<u>Jul 19</u>
<u>31. Jul 19</u>	<u>17. Sep 19</u>	<u>49</u>	<u>Sep 19</u>
<u>18. Sep 19</u>	<u>29. Okt 19</u>	<u>42</u>	<u>Okt 19</u>
<u>30. Okt 19</u>	<u>17. Dez 19</u>	<u>49</u>	<u>Dez 19</u>
<u>18. Dez 19</u>	<u>28. Jan 20</u>	<u>42</u>	<u>Jan 20</u>

1.1.4 Letzter Handelstag, Schlussabrechnungstag, Handelsschluss

[...]

- (3) Letzter Handelstag ~~und Schlussabrechnungstag~~ des EONIA-Futures-Kontrakts ist der letzte Börsentag der jeweiligen von der Eurex Deutschland bestimmten Periode

(gemäß Ziffer 1.1.3 Abs. 3 und Abs. 5). Der Schlussabrechnungstag der EONIA-Futures-Kontrakte ist der dem letzten Handelstag unmittelbar nachfolgende Börsentag – soweit von dem European Money Markets Institute an diesem Tag der für Tagesgeld im Interbankengeschäft maßgebliche Referenz-Zinssatz EONIA festgestellt wird, ansonsten der davorliegende Börsentag – ~~der jeweiligen von der Eurex Deutschland bestimmten Periode (gemäß Ziffer 1.1.3 Abs. 3 und Absatz 5).~~

Handelsschluss der EONIA-Futures-Kontrakte an dem letzten Handelstag ist 18:00 Uhr MEZ.

- (4) Letzter Handelstag und Schlussabrechnungstag des EUR Secured Funding-Futures-Kontrakts ist der letzte Börsentag – soweit von STOXX an diesem Tag der STOXX GC Pooling EUR Deferred Funding Rate festgestellt wird, ansonsten der davorliegende Börsentag – der jeweiligen von der Eurex Deutschland bestimmten Periode (gemäß Ziffer 1.1.3 Abs. 4 und Absatz 65).

Handelsschluss der EUR Secured Funding-Futures-Kontrakte an dem letzten Handelstag ist 18:00 Uhr MEZ.

[...]

3.2.1 Blockgeschäfte

[...]

Produkt		Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte	
Standard	Zusätzliche Kontraktvarianten J/N	TES	Eurex EnLight
[...]			
Geldmarkt-Futures			
[...]			
Futures-Kontrakte auf den Durchschnitt aller während der Laufzeit einer von der Eurex Deutschland bestimmten Periode ermittelten effektiven Zinssätze für Tagesgeld im Interbankengeschäft <u>- €STR + fester Spread</u> , EONIA (EONIA-Futures) (FEO1)	N	300	N / A
[...]			

[...]

3.2.2 Exchange for Physicals for Financials („EFP-F“)

Folgende Zins-Futures-Kontrakte sind zugelassen:

Produkt	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte
[...]	
Futures-Kontrakte auf den Durchschnitt aller während der Laufzeit einer von der Eurex Deutschland bestimmten Periode ermittelten effektiven Zinssätze für Tagesgeld im Interbankengeschäft - €STR + fester Spread , EONIA („FEO1-Future“)	10
[...]	

[...]

[...]

3.2.4 Exchange for Swaps („EFS“)

Folgende Kontrakte sind zugelassen:

[...]

- Futures-Kontrakte auf den Durchschnitt aller während der Laufzeit einer von der Eurex Deutschland bestimmten Periode ermittelten effektiven Zinssätze für Tagesgeld im Interbankengeschäft - **€STR + fester Spread**, EONIA („FEO1-Future“)

[...]

[...]

Die vorstehende Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland wird hiermit ausgefertigt. Die Änderung tritt dem Beschluss der Geschäftsführung der Eurex Deutschland entsprechend am 01.10.2019 in Kraft.

Frankfurt am Main, 23.08.2019

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters