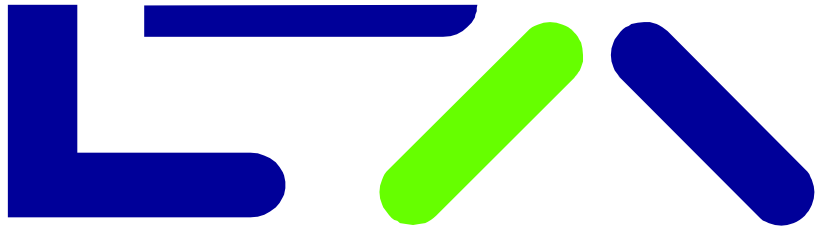


*X-pand into the Future*



## **eurex** *Bekanntmachung*

**Geldmarktderivate: Einführung von neuen Verfallsdaten für den EONIA-Future (FEO1) und den EUR Secured Funding-Future (FLIC)**

**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 12.10.2020 in Kraft.

---

Die Änderungen können auf der Internetseite der Eurex Deutschland (<http://www.eurexchange.com>) abgerufen und im „Präsenzordner Regelwerke“ der Eurex Deutschland am Empfang des Handelssaals, Börsenplatz 4, 60313 Frankfurt am Main, Deutschland, während der allgemeinen Öffnungszeiten eingesehen 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

[...]

#### 1.1.3 Laufzeit

[...]

- (5) Von der Eurex Deutschland bestimmte Perioden für 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):

Beginn der Erfüllungsperiode	Letzter Handelstag, Ende der Erfüllungsperiode	Futures Verfallstag, Veröffentlichung der Letzten Referenzrate	Periodenlänge (Tage)	Verfallsmonat im Eurex System
<del>30. Okt 19</del>	<del>17. Dez 19</del>	<del>18. Dez 19</del>	49	<del>Dez 19</del>
<del>18. Dez 19</del>	<del>28. Jan 20</del>	<del>29. Jan 20</del>	42	<del>Jan 20</del>
<del>29. Jan 20</del>	<del>17. Mrz 20</del>	<del>18. Mrz 20</del>	49	<del>Mrz 20</del>
<del>18. Mrz 20</del>	<del>05. Mai 20</del>	<del>06. Mai 20</del>	49	<del>Mai 20</del>
<del>06. Mai 20</del>	<del>09. Jun 20</del>	<del>10. Jun 20</del>	35	<del>Jun 20</del>
<del>10. Jun 20</del>	<del>21. Jul 20</del>	<del>22. Jul 20</del>	42	<del>Jul 20</del>
<del>22. Jul 20</del>	<del>15. Sep 20</del>	<del>16. Sep 20</del>	56	<del>Sep 20</del>
[...]				
04. Nov 20	15. Dez 20	16. Dez 20	42	Dez 20
16. Dez 20	<u>26. Jan 21</u> <del>02. Feb 21</del>	<u>27. Jan 21</u> <del>03. Feb 21</del>	<u>42</u>	<u>Jan 21</u> <del>Feb 21</del>
<u>27. Jan 21</u>	<u>16. Mrz 21</u>	<u>17. Mrz 21</u>	<u>49</u>	<u>Mar 21</u>
<u>17. Mrz 21</u>	<u>27. Apr 21</u>	<u>28. Apr 21</u>	<u>42</u>	<u>Apr 21</u>
<u>28. Apr 21</u>	<u>15. Jun 21</u>	<u>16. Jun 21</u>	<u>49</u>	<u>Jun 21</u>

Beginn der Erfüllungsperiode	Letzter Handelstag, Ende der Erfüllungsperiode	Futures Verfalltag, Veröffentlichung der Letzten Referenzrate	Periodenlänge (Tage)	Verfallsmonat im Eurex System
<u>16. Jun 21</u>	<u>27. Jul 21</u>	<u>28. Jul 21</u>	<u>42</u>	<u>Jul 21</u>
<u>28. Jul 21</u>	<u>14. Sep 21</u>	<u>15. Sep 21</u>	<u>49</u>	<u>Sep 21</u>
<u>15. Sep 21</u>	<u>02. Nov 21</u>	<u>03. Nov 21</u>	<u>49</u>	<u>Nov 21</u>
<u>03. Nov 21</u>	<u>21. Dez 21</u>	<u>22. Dez 21</u>	<u>49</u>	<u>Dez 21</u>

- (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):

Beginn der Erfüllungsperiode	Futures Verfalltag, Ende der Erfüllungsperiode	Periodenlänge (Tage)	Verfallsmonat im Eurex System
<del>30. Okt 19</del>	<del>17. Dez 19</del>	49	<del>Dez 19</del>
<del>18. Dez 19</del>	<del>28. Jan 20</del>	42	<del>Jan 20</del>
<del>29. Jan 20</del>	<del>17. Mrz 20</del>	49	<del>Mrz 20</del>
<del>18. Mrz 20</del>	<del>05. Mai 20</del>	49	<del>May 20</del>
<del>06. Mai 20</del>	<del>09. Jun 20</del>	35	<del>Jun 20</del>
<del>10. Jun 20</del>	<del>21. Jul 20</del>	42	<del>Jul 20</del>
<del>22. Jul 20</del>	<del>15. Sep 20</del>	56	<del>Sep 20</del>
[...]			
04. Nov 20	15. Dez 20	42	Dez 20
16. Dez 20	<u>26. Jan 21</u> <del>02-Feb 21</del>	<u>49</u>	<u>Jan 21</u> <del>Feb 21</del>
<u>27. Jan 21</u>	<u>16. Mrz 21</u>	<u>49</u>	<u>Mrz 21</u>
<u>17. Mrz 21</u>	<u>27. Apr 21</u>	<u>42</u>	<u>Apr 21</u>
<u>28. Apr 21</u>	<u>15. Jun 21</u>	<u>49</u>	<u>Jun 21</u>
<u>16. Jun 21</u>	<u>27. Jul 21</u>	<u>42</u>	<u>Jul 21</u>
<u>28. Jul 21</u>	<u>14. Sep 21</u>	<u>49</u>	<u>Sep 21</u>
<u>15. Sep 21</u>	<u>02. Nov 21</u>	<u>49</u>	<u>Nov 21</u>
<u>03. Nov 21</u>	<u>21. Dez 21</u>	<u>49</u>	<u>Dez 21</u>

[...]

\*\*\*\*\*

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 12.10.2020 in Kraft.

Frankfurt am Main, 08.10.2020

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters