



eurex rundschriften 026/10

Datum: Frankfurt, 19. Februar 2010
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendors
Autorisiert von: Peter Reitz

U Hohe Priorität

Euro-Fixed-Income-Futures: Festlegung von Reporting- und Positionslimiten für März 2010

Verweis auf Eurex-Rundschriften: 226/06, 153/09, 214/09

Kontakt: Joachim Heinz, Tel. +49-69-211-1 59 55, E-Mail: joachim.heinz@eurexchange.com

Zielgruppe:

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

Anhänge:

keine

Die Reporting- und die Positionslimiten in den Euro-Fixed-Income-Futures für die **März 2010-Kontrakte** werden wie folgt festgesetzt:

- **Euro-Buxl-Future (FGBX)** **30.000 Kontrakte**
- **Euro-Bund-Future (FGBL)** **70.000 Kontrakte**
- **Euro-Bobl-Future (FGBM)** **60.000 Kontrakte**
- **Euro-Schatz-Future (FGBS)** **50.000 Kontrakte**
- **Euro-BTP-Future (FBTP)** **25.000 Kontrakte**

Die Limite beziehen sich ausschließlich auf Long-Positionen in den Front Month-Kontrakten der betroffenen Produkte. Reporting-Limite gelten in der Zeit vom **26. Februar 2010 nach Handelsschluss bis 3. März 2010 nach Handelsschluss**. Eine Überschreitung der Reporting-Limite löst ein Auskunftersuchen seitens der Eurex-Börsen gegenüber dem Börsenteilnehmer aus. Positionslimiten gelten in der Zeit vom **4. März 2010 Handelsbeginn** bis zum Verfall des März-Kontraktes am **8. März 2010**. Dementsprechend müssen zu Handelsbeginn am 4. März 2010 die Long-Positionen in den März 2010-Kontrakten innerhalb der vorgegebenen Limite sein.

Die Limite werden von Eurex Market Supervision und der Handelsüberwachungsstelle während des Börsentages ständig überwacht. Zur unverzüglichen Positionsberichtigung 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.

