

eurex rundschriften

An: Die Mitglieder der Eurex Deutschland
Datum: Frankfurt, 03. Juli 1998
Referenz: SB

Änderung des Duration Hedge Parameters in der Basis Trade Facility

Rundschriften 36/98

Sehr geehrte Damen und Herren,

Im Zusammenhang mit der Einführung des JUMBO-Pfandbrieffutures am 6. Juli 1998 wird der Duration Hedge Parameter der Basis Trade Facility für alle Zinsfutures von bisher 20% auf 30% angehoben. Damit ist bei Auswahl der Duration Hedge Methode (DUR) zukünftig eine Abweichung des Nominalwertes des Futures-Geschäftes vom Nominalwert des dem Basis Trade zugrundeliegenden Kassa-Geschäftes von maximal 30 Prozent zulässig.

Für Rückfragen steht Ihnen Herr Stefan Brendgen unter 069-2101-5743 gerne zur Verfügung.

Mit freundlichen Grüßen

Dr. Jörg Franke

Christian Klapproth