



e u r e x r u n d s c h r e i b e n 204/08

Datum: Frankfurt, 22. August 2008
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann



Euro-Fixed-Income-Futures: Festlegung von Reporting- und Positionslimiten für September 2008

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 229/07, 033/08, 122/08

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:

keine

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen haben in ihrer Sitzung am Mittwoch, den 20. August 2008, beschlossen, die Reporting- und die Positionslimite in den Euro-Fixed-Income-Futures für die **September 2008-Kontrakte** wie folgt festzusetzen:

- **Euro-Buxl[®]-Future (FGBX)** **30.000 Kontrakte**
- **Euro-Bund-Future (FGBL)** **65.000 Kontrakte**
- **Euro-Bobl-Future (FGBM)** **50.000 Kontrakte**
- **Euro-Schatz-Future (FGBS)** **45.000 Kontrakte**

Die Limite beziehen sich ausschließlich auf Long-Positionen in den Front Month-Kontrakten der betroffenen Produkte. Reporting-Limite gelten in der Zeit vom **1. September 2008 bis 3. September 2008 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. September 2008 Handelsbeginn** bis zum Verfall des September-Kontrakts am **8. September 2008**. Dementsprechend müssen zu Handelsbeginn am 4. September 2008 die Long-Positionen in den September 2008-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.

