



eurex rundschreiben 214/09

Datum: Frankfurt, 18. November 2009
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz



Euro-Fixed-Income-Futures: Festlegung von Reporting- und Positionslimiten für Dezember 2009

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 226/06, 92/09, 153/09

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 Reporting- und die Positionslimite in den Euro-Fixed-Income-Futures für die **Dezember 2009-Kontrakte** werden wie folgt festgesetzt:

- **Euro-Buxl[®]-Future (FGBX)** **30.000 Kontrakte**
- **Euro-Bund-Future (FGBL)** **65.000 Kontrakte**
- **Euro-Bobl-Future (FGBM)** **65.000 Kontrakte**
- **Euro-Schatz-Future (FGBS)** **45.000 Kontrakte**
- **Euro-BTP-Futures (FBTP)** **10.000 Kontrakte**

Die Limite beziehen sich ausschließlich auf Long-Positionen in den Front Month-Kontrakten der betroffenen Produkte. Reporting-Limite gelten in der Zeit vom 30. November 2009 nach Handelsschluss bis 3. Dezember 2009 nach Handelsschluss. Eine Überschreitung der Reporting-Limite löst ein Auskunftsersuchen seitens der Eurex-Börsen gegenüber dem Börsenteilnehmer aus. Positionslimite gelten in der Zeit vom 4. Dezember 2009 Handelsbeginn bis zum Verfall des Dezember-Kontraktes am 8. Dezember 2009. Dementsprechend müssen zu Handelsbeginn am 4. Dezember 2009 die Long-Positionen in den Dezember 2009-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.

