



eurex rundschriften 277/08

Datum: Frankfurt, 12. November 2008
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendors
Autorisiert von: Peter Reitz

 **Hohe Priorität**

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

Verweis auf Eurex-Rundschriften: 226/06, 122/08, 204/08

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:

keine

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen haben in ihrer Sitzung am Montag, den 10. November 2008, beschlossen, die Reporting- und die Positionslimite in den Euro-Fixed-Income-Futures für die **Dezember 2008-Kontrakte** wie folgt festzusetzen:

- **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**

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

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

