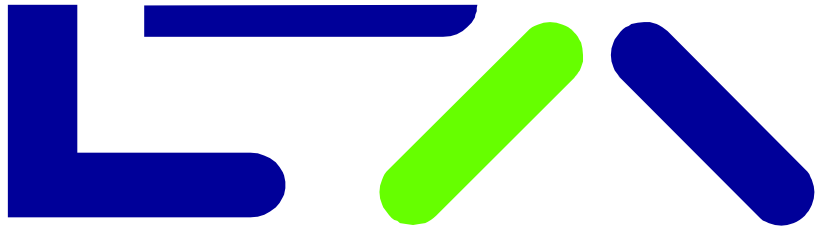


*X-pand into the Future*



## **e u r e x** *B e k a n n t m a c h u n g*

**Geldmarktderivate: Einführung von neuen Verfallsdaten für den EONIA-Future (FEO1) und den EUR Secured Funding-Future (FLIC)**

**Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland (eurex14)**

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland hat die Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland beschlossen.

Sie tritt mit Wirkung zum 30.10.2019 in Kraft.

Die Änderungen können im „Präsenzordner Regelwerke“ der Eurex am Empfang, Börsenplatz 4, eingesehen und im Internet auf der Internetseite der Eurex (<http://www.eurexchange.com>) abgerufen werden.

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

## Abschnitt 1 Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte

### Teilabschnitt 1.1 Kontraktsspezifikationen für Geldmarkt-Futures-Kontrakte

[...]

#### 1.1.3 Laufzeit

[...]

- (5) Von der Eurex Deutschland bestimmte Perioden für EONIA-Futures (es können Perioden aufgeführt sein, welche nach Ziffer 1.1.3 Abs. 3 und Absatz 4 noch nicht oder nicht mehr zur Verfügung stehen):

<u>Erster Referenzraten-beobachtungstagBeginn der Erfüllungsperiode</u>	<u>Letzter Handelstag, Letzter Referenzraten-beobachtungstagEnde der Erfüllungsperiode</u>	<u>Futures Verfalltag, Veröffentlichung der Letzten Referenzrate</u>	Periodenlänge (Tage)	Verfallsmonat im Eurex System
31. Okt 18	18. Dez 18	18. Dez 18	49	Dez 18
<del>19. Dez 18</del>	<del>29. Jan 19</del>	<del>29. Jan 19</del>	42	<del>Jan 19</del>
30. Jan 19	12. Mrz 19	12. Mrz 19	42	Mrz 19
<del>13. Mrz 19</del>	<del>16. Apr 19</del>	<del>16. Apr 19</del>	35	<del>Apr 19</del>
17. Apr 19	11. Jun 19	11. Jun 19	56	Jun 19
12. Jun 19	30. Jul 19	30. Jul 19	49	Jul 19
<del>31. Jul 19</del>	<del>17. Sep 19</del>	<del>17. Sep 19</del>	42	<del>Okt 19</del>
<del>18. Sep 19</del>	<del>29. Okt 19</del>	<del>30. Okt 19</del>	42	<del>Okt 19</del>
30. Okt 19	17. Dez 19	18. Dez 19	49	Dez 19
18. Dez 19	28. Jan <u>2019</u>	29. Jan <u>2019</u>	42	Jan 20
<u>29. Jan 20</u>	<u>17. Mrz 20</u>	<u>18. Mrz 20</u>	<u>49</u>	<u>Mrz 20</u>
<u>18. Mrz 20</u>	<u>05. Mai 20</u>	<u>06. Mai 20</u>	<u>49</u>	<u>Mai 20</u>
<u>06. Mai 20</u>	<u>09. Jun 20</u>	<u>10. Jun 20</u>	<u>35</u>	<u>Jun 20</u>

<u>Erster Referenzraten-beobachtungstag Beginn der Erfüllungsperiode</u>	<u>Letzter Handelstag, Letzter Referenzraten-beobachtungstag Ende der Erfüllungsperiode</u>	<u>Futures Verfalltag, Veröffentlichung der Letzten Referenzrate</u>	<u>Periodenlänge (Tage)</u>	<u>Verfallsmonat im Eurex System</u>
<a href="#">10. Jun 20</a>	<a href="#">21. Jul 20</a>	<a href="#">22. Jul 20</a>	<a href="#">42</a>	<a href="#">Jul 20</a>
<a href="#">22. Jul 20</a>	<a href="#">15. Sep 20</a>	<a href="#">16. Sep 20</a>	<a href="#">56</a>	<a href="#">Sep 20</a>
<a href="#">16. Sep 20</a>	<a href="#">03. Nov 20</a>	<a href="#">04. Nov 20</a>	<a href="#">49</a>	<a href="#">Nov 20</a>
<a href="#">04. Nov 20</a>	<a href="#">15. Dez 20</a>	<a href="#">16. Dez 20</a>	<a href="#">42</a>	<a href="#">Dez 20</a>
<a href="#">16. Dez 20</a>	<a href="#">02. Feb 21</a>	<a href="#">03. Feb 21</a>	<a href="#">49</a>	<a href="#">Feb 21</a>

- (6) Von der Eurex Deutschland bestimmte Perioden für EUR Secured Funding Futures (es können Perioden aufgeführt sein, welche nach Ziffer 1.1.3 Abs. 3 und Abs. 4 noch nicht oder nicht mehr zur Verfügung stehen):

<u>Erster Referenzraten-beobachtungstag Beginn der Erfüllungsperiode</u>	<u>Futures Verfalltag, Letzter Referenzraten-beobachtungstag Ende der Erfüllungsperiode</u>	<u>Periodenlänge (Tage)</u>	<u>Verfallsmonat im Eurex System</u>
<a href="#">31. Okt 18</a>	<a href="#">18. Dez 18</a>	<a href="#">49</a>	<a href="#">Dez 18</a>
<a href="#">19. Dez 18</a>	<a href="#">29. Jan 19</a>	<a href="#">42</a>	<a href="#">Jan 19</a>
<a href="#">30. Jan 19</a>	<a href="#">12. Mrz 19</a>	<a href="#">42</a>	<a href="#">Mrz 19</a>
<a href="#">13. Mrz 19</a>	<a href="#">16. Apr 19</a>	<a href="#">35</a>	<a href="#">Apr 19</a>
<a href="#">17. Apr 19</a>	<a href="#">11. Jun 19</a>	<a href="#">56</a>	<a href="#">Jun 19</a>
<a href="#">12. Jun 19</a>	<a href="#">30. Jul 19</a>	<a href="#">49</a>	<a href="#">Jul 19</a>
<a href="#">31. Jul 19</a>	<a href="#">17. Sep 19</a>	<a href="#">49</a>	<a href="#">Sep 19</a>
<a href="#">18. Sep 19</a>	<a href="#">29. Okt 19</a>	<a href="#">42</a>	<a href="#">Okt 19</a>
<a href="#">30. Okt 19</a>	<a href="#">17. Dez 19</a>	<a href="#">49</a>	<a href="#">Dez 19</a>
<a href="#">18. Dez 19</a>	<a href="#">28. Jan 20</a>	<a href="#">42</a>	<a href="#">Jan 20</a>
<a href="#">29. Jan 20</a>	<a href="#">17. Mrz 20</a>	<a href="#">49</a>	<a href="#">Mrz 20</a>
<a href="#">18. Mrz 20</a>	<a href="#">05. Mai 20</a>	<a href="#">49</a>	<a href="#">May 20</a>
<a href="#">06. Mai 20</a>	<a href="#">09. Jun 20</a>	<a href="#">35</a>	<a href="#">Jun 20</a>
<a href="#">10. Jun 20</a>	<a href="#">21. Jul 20</a>	<a href="#">42</a>	<a href="#">Jul 20</a>
<a href="#">22. Jul 20</a>	<a href="#">15. Sep 20</a>	<a href="#">56</a>	<a href="#">Sep 20</a>
<a href="#">16. Sep 20</a>	<a href="#">03. Nov 20</a>	<a href="#">49</a>	<a href="#">Nov 20</a>
<a href="#">04. Nov 20</a>	<a href="#">15. Dez 20</a>	<a href="#">42</a>	<a href="#">Dez 20</a>
<a href="#">16. Dez 20</a>	<a href="#">02 Feb 21</a>	<a href="#">49</a>	<a href="#">Feb 21</a>

[...]

\*\*\*\*\*

Die vorstehende Änderung der Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland wird hiermit ausgefertigt. Die Änderung tritt dem Beschluss der Geschäftsführung der Eurex Deutschland entsprechend am 30.10.2019 in Kraft.

Frankfurt am Main, 07.10.2019

Geschäftsführung der Eurex Deutschland

Dr. Randolph Roth

Michael Peters