



# eurex clearing

## rundschreiben 095/16

**Datum:** 20. Juli 2016  
**Empfänger:** Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren  
**Autorisiert von:** Heike Eckert

### Foreign Exchange (FX)-Derivate: Clearing von zusätzlichen Währungspaaren und Änderung der Produktparameter bestehender FX-Futures und -Optionen

**Verweis auf Eurex-Rundschreiben:** 064/16

**Kontakt:** Derivatives Clearing Supervision, T +49-69-211-1 12 50, [clearing@eurexclearing.com](mailto:clearing@eurexclearing.com),  
 Risk Control, T +49-69-211-1 24 52, [risk@eurexclearing.com](mailto:risk@eurexclearing.com)

**Zielgruppe:**

☞ Alle Abteilungen

**Anhänge:**

Geänderte Abschnitte folgender Regelwerke:  
 1. Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG  
 2. Bedingungen für die Nutzung der Eurex-Trade-Entry-Services (Allgemeine Teilnahmebedingungen)

**Zusammenfassung:**

Eurex Clearing wird mit Wirkung zum **12. September 2016** Clearing Services für FX-Futures und -Optionen auf sechs zusätzliche Währungspaare anbieten (AUD/USD, AUD/JPY, EUR/AUD, EUR/JPY, USD/JPY und NZD/USD), welche an Eurex Exchange handelbar sind. Außerdem werden zwei weitere Änderungen an bestehenden FX-Futures und -Optionen vorgenommen. Die Mindestgröße für Block Trades wird reduziert und die Währungspaare werden individuellen Produktzuteilungsgruppen zugeordnet. Handelsteilnehmer, die bereits zum Handel in FX-Produkten zugelassen sind, müssen ihre Handelsberechtigungen vor Handelsstart am Wirksamkeitstag aktualisieren.

Dieses Rundschreiben enthält Informationen zum Clearing dieser Produkte sowie die geänderten Abschnitte der Regelwerke der Eurex Clearing, welche zum gleichen Tag wirksam werden.

Handelsrelevante Informationen zur Einführung der neuen Produkte sowie Informationen zu den geänderten Regelwerken der Eurex Deutschland und Eurex Zürich AG entnehmen Sie bitte Eurex-Rundschreiben 064/16.



**Foreign Exchange (FX)-Derivate: Clearing von zusätzlichen Währungspaaren und Änderung der Produktparameter bestehender FX-Futures und -Optionen**

Eurex Clearing wird mit Wirkung zum 12. September 2016 Clearing Services für FX-Futures und -Optionen auf sechs zusätzliche Währungspaare anbieten (AUD/USD, AUD/JPY, EUR/AUD, EUR/JPY, USD/JPY und NZD/USD), welche an Eurex Exchange handelbar sind. Außerdem werden zwei weitere Änderungen an bestehenden FX-Futures und -Optionen vorgenommen. Die Mindestgröße für Block Trades wird reduziert und die Währungspaare werden individuellen Produktzuteilungsgruppen zugeordnet. Handels Teilnehmer, die bereits zum Handel in FX-Produkten zugelassen sind, müssen ihre Handelsberechtigungen vor Handelsstart am Wirksamkeitstag aktualisieren.

Dieses Rundschreiben enthält Informationen zum Clearing dieser Produkte sowie die geänderten Abschnitte der Regelwerke der Eurex Clearing, welche zum gleichen Tag wirksam werden.

Handelsrelevante Informationen zur Einführung der neuen Produkte sowie Informationen zu den geänderten Regelwerken der Eurex Deutschland und Eurex Zürich AG entnehmen Sie bitte Eurex-Rundschreiben 064/16.

**A. Zusätzliche Währungspaare**

**1. Produktüberblick**

<b>Eurex-Produkte</b>			
<b>FX-Futures auf</b>	<b>Eurex-Produktkürzel</b>	<b>ISINs der FX-Futures</b>	<b>Basiswert-ISINs (FX-Wechselkurse)</b>
AUD/USD	FCAU	DE000A160WU4	XC000A0E4TC6
AUD/JPY	FCAY	DE000A160WV2	XC0006169574
EUR/AUD	FCEA	DE000A160WW0	EU0009654748
EUR/JPY	FCEY	DE000A160WX8	EU0009652627
USD/JPY	FCUY	DE000A160WY6	XC0009659910
NZD/USD	FCNU	DE000A163T81	XC000A0G85A0
<b>FX-Optionen auf (Europäische Ausübung)</b>	<b>Eurex-Produktkürzel</b>	<b>ISINs der FX-Futures</b>	<b>Basiswert-ISINs (FX-Wechselkurse)</b>
AUD/USD	OCAU	XC000A0E4TC6	XC000A0E4TC6
AUD/JPY	OCAJ	XC0006169574	XC0006169574
EUR/AUD	OCEA	EU0009654748	EU0009654748
EUR/JPY	OCEY	EU0009652627	EU0009652627
USD/JPY	OCUJ	XC0009659910	XC0009659910
NZD/USD	OCNU	XC000A0G85A0	XC000A0G85A0

## 2. Kontraktsspezifikationen

Die detaillierten Kontraktsspezifikationen können Eurex-Rundschreiben 064/16 entnommen werden.

FX-Futures						
Kontraktgröße	AUD 100.000	AUD 100.000	EUR 100.000	EUR 100.000	USD 100.000	NZD 100.000
Basiswert	AUD/USD	AUD/JPY	EUR/AUD	EUR/JPY	USD/JPY	NZD/USD
Produkt-ID	FCAU	FCAY	FCEA	FCEY	FCUY	FCNU
Minimale Preisveränderung	0,00001	0,001	0,00001	0,001	0,001	0,00001
Wert der Minimalen Preisveränderung	USD 1	JPY 100	AUD 1	JPY 100	JPY 100	USD 1
Laufzeiten	Bis zu drei Jahre (drei aufeinander folgende Kalendermonate, drei Quartalsmonate, vier Halbjahresmonate aus dem Zyklus März/Juni/September/Dezember)					
Letzter Handelstag	Dritter Mittwoch des Verfallmonats, Handelsschluss um 15:00 Uhr MEZ					
Täglicher Abwicklungspreis	Volumengewichteter Durchschnittspreis (VWAP, „volume weighted average price“) der Futures-Transaktionen, die während einer Zeitspanne von 60 Sekunden mit Ende um 17:30 Uhr MEZ berechnet werden. Wenn weniger als fünf Transaktionen vorhanden sind, wird der VWAP der letzten fünf Transaktionen, die in den letzten 15 Minuten vor 17:30 Uhr MEZ abgeschlossen werden bzw. der Mittelwert der Bid/Ask-Preise im Orderbuch vor 17:30 Uhr MEZ herangezogen.					
Finaler Abwicklungspreis	VWAP aller Transaktionen, die während der letzten Handelsminute mit Ende um 15:00 Uhr MEZ ausgeführt wurden. Wenn keine geeigneten Preise verfügbar sind, wendet Eurex Clearing den durchschnittlichen mittleren Preis der letzten angezeigten Bid/Ask-Spot-Preise während einer Zeitspanne von 60 Sekunden mit Ende um 15:00 Uhr MEZ an, die von einem von Eurex Clearing beauftragten Datenanbieter veröffentlicht wurden.					
Abwicklung	Physische Lieferung der zugrunde liegenden Währungen (T+2) über das CLS-System					
Mindestgröße für Block Trading	100 Kontrakte (10 Millionen Nominal)					

FX-Optionen (Europäische Ausübung)						
Kontraktgröße	AUD 100.000	AUD 100.000	EUR 100.000	EUR 100.000	USD 100.000	NZD 100.000
Basiswert	AUD/USD	AUD/JPY	EUR/AUD	EUR/JPY	USD/JPY	NZD/USD
Produktkürzel	OCAU	OCAJ	OCEA	OCEJ	OCUJ	OCNU
Minimale Preisveränderung	0,00005	0,005	0,00005	0,005	0,005	0,00005
Wert der Minimalen Preisveränderung	USD 5	JPY 500	AUD 5	JPY 500	JPY 500	USD 5
Laufzeiten	Bis zu drei Jahre (drei aufeinander folgende Kalendermonate, drei Quartalsmonate, vier Halbjahresmonate aus dem Zyklus März/Juni/September/Dezember)					
Ausübungspreisintervall	0,005 (bis einschließlich Jahr 2)    0,010 (ab Jahr 3) 0,5 (bis einschließlich Jahr 2)    1,0 (ab Jahr 3) für EUR/JPY-Produkte					
Letzter Handelstag	Dritter Mittwoch des Verfallmonats, Handelsschluss um 15:00 Uhr MEZ, Ausübung bis 16:00 Uhr MEZ					
Täglicher Abwicklungspreis	Der zugrunde liegende Referenzpreis für FX-Optionskontrakte ist der tägliche Abrechnungspreis der entsprechenden FX-Futures-Serie.					
Schlussabwicklungspreis	Der finale Abrechnungspreis der entsprechenden verfallenden FX-Futures-Serie wird für die FX-Optionen zugrunde gelegt.					
Abwicklung	Physische Lieferung der zugrunde liegenden Währungen (T+2) über das CLS-System					
Mindestgröße für Block Trading	100 Kontrakte (10 Millionen Nominal)					

### 3. Handelszeiten (alle Zeiten in MEZ)

Die Handelszeiten für die FX-Futures und -Optionen können Sie der folgenden Tabelle entnehmen.

Bitte beachten Sie die verkürzten Handelszeiten für den letzten Handelstag bei den Front Month-Kontrakten.

Am Tag des Verfalls (dritter Mittwoch des Verfallmonats einer Serie) enden der fortlaufende Handel und das Block Trading bereits um 15:00 Uhr MEZ. Ausübungen können an diesem Tag bis 16:00 Uhr MEZ durchgeführt werden.

Produkt	Pre-Trading-Phase	Fortlaufender Handel	Post-Trading Full-Periode	Block-Trading	Letzter Handelstag
					Handel bis
FX-Futures	07:30–08:00	08:00–22:00	22:00–22:30	08:00–22:00	15:00

Produkt	Pre-Trading-Phase	Fortlaufender Handel	Post-Trading Full-Periode	Block-Trading	Letzter Handelstag	
					Handel bis	Ausübung bis
FX-Optionen	07:30-08:00	08:00-19:30	19:30-20:30	08:00-20:00	15:00	16:00

### 4. Neue Produktgruppen

Die neue Produktgruppenlogik für FX-Produkte erlaubt die Zuweisung einzelner Währungspaare zu separaten Produktgruppen. Somit wird der Zugang für Clearing-Mitglieder insoweit erleichtert, als sie nur für diejenigen Währungen in den Währungspaaren, welche sie auch tatsächlich verrechnen wollen, die notwendigen Clearing-Geldkonten bereitstellen müssen. Die Gruppenkennungen für FX-Produkte erlauben eine klare Abgrenzung nach Basiswährung, Produktwährung (Quotierungswährung) und nach Produkttyp (Futures oder Optionen). Zur Unterscheidung des Produkttyps wird bei der Produktsegmentkennung für FX-Futures der Wert „3“ und für FX-Optionen der Wert „4“ verwendet.

Die neuen Währungspaare werden folgenden Produktgruppen zugewiesen:

Produkt	Produktname	Abwicklungs-lokation	Settlement-Typ	Produkttyp/ FX-Basiswährung	Produktsegment	Produktwährung	Produktgruppenkennung					
							Y	F	S	A	3	U
FCAU	FX Futures on AUD/USD	CLS	S	AUD	3	USD	Y	F	S	A	3	U
FCAY	FX Futures on AUD/JPY	CLS	S	AUD	3	JPY	Y	F	S	A	3	J
FCEA	FX Futures on EUR/AUD	CLS	S	EUR	3	AUD	Y	F	S	E	3	A
FCEY	FX Futures on EUR/JPY	CLS	S	EUR	3	JPY	Y	F	S	E	3	J
FCUY	FX Futures on USD/JPY	CLS	S	USD	3	JPY	Y	F	S	U	3	J
FCNU	FX Futures on NZD/USD	CLS	S	NZD	3	USD	Y	F	S	N	3	U
OCAU	FX Options on AUD/USD - European Style	CLS	S	AUD	4	USD	Y	N	S	A	4	U
OCAJ	FX Options on AUD/JPY - European Style	CLS	S	AUD	4	JPY	Y	N	S	A	4	J

Produkt	Produktname	Abwicklungs- lokation	Settlement-Typ	Produkttyp/ FX- Basiswährung	Produktsegment	Produktwährung	Produktgruppenkennung					
							Y	N	S	E	4	A
OCEA	FX Options on EUR/AUD - European Style	CLS	S	EUR	4	AUD	Y	N	S	E	4	A
OCEY	FX Options on EUR/JPY - European Style	CLS	S	EUR	4	JPY	Y	N	S	E	4	J
OCUY	FX Options on USD/JPY - European Style	CLS	S	USD	4	JPY	Y	N	S	U	4	J
OCNU	FX Options on NZD/USD - European Style	CLS	S	NZD	4	USD	Y	N	S	N	4	U

### 5. Zulassung zu den Eurex-Trade-Entry-Services

Die neuen FX-Futures und -Optionen werden zum Block Trade-Service mit einer Minimum Block Trade Size von **100 Kontrakten** zugelassen.

Teilnehmer, die bereits für Block Trading und/oder Vola-Trading registriert sind, können die entsprechenden Funktionalitäten für die neuen FX-Futures und -Optionen ohne weitere Formalität nutzen.

Teilnehmer, die die Eurex-Trade-Entry-Services neu nutzen wollen, müssen durch Unterzeichnung und Rücksendung der entsprechenden Erklärung ihre Anerkennung der Bedingungen für die Nutzung der Eurex-Trade-Entry-Services bestätigen. Außerdem muss bei Nicht-Clearing-Mitgliedern gleichzeitig deren General Clearing-Mitglied die entsprechende Anerkennungserklärung unterzeichnen und zurücksenden. Die erforderlichen Formulare finden Sie auf der Eurex-Website [www.eurexchange.com](http://www.eurexchange.com) unter dem Link:

**[Ressourcen > Formulare > Handel Derivate > Trade Entry Services](#)**

### 6. Transaktionsentgelte

Für die neuen Produkte auf die sechs Währungspaare gelten folgende Handels- und Clearing-Entgelte:

Entgelte		M-Konten		P-Konten		A-Konten	
FX-Futures FX- Optionen auf	Rechnungs- währung	Order- buch Standard- Entgelt	Off-Book Standard- Entgelt	Order- buch Standard- Entgelt	Off-Book Standard- Entgelt	Order- buch Standard- Entgelt	Off-Book Standard- Entgelt
AUD/USD	USD	0,30	0,45	0,15	0,225	0,30	0,45
AUD/JPY	USD	0,30	0,45	0,15	0,225	0,30	0,45
EUR/AUD	USD	0,30	0,45	0,15	0,225	0,30	0,45
EUR/JPY	USD	0,30	0,45	0,15	0,225	0,30	0,45
USD/JPY	USD	0,30	0,45	0,15	0,225	0,30	0,45
NZD/USD	USD	0,30	0,45	0,15	0,225	0,30	0,45

Die geänderten Abschnitte des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG sind diesem Rundschreiben angehängt (Anhang 1).

## 7. Risikoparameter

Die sechs neuen Währungspaare für FX-Futures und FX-Optionen sind für die Berechnung in Prisma zugelassen.

Die Risikoparameter entnehmen Sie bitte ab Handelsstart der Eurex Clearing-Website unter dem Link:

**Risikomanagement > Risikoparameter**

## 8. Abwicklungsprozess

Die Belieferung der FX-Derivate findet in CLS (Continuous Linked Settlement) statt. Der Abwicklungsprozess für die neuen FX-Futures und -Optionen ist derselbe wie für die bereits bestehenden Währungspaare.

Für FX-Futures, die vor dem Verfall nicht glattgestellt und FX-Optionen, die am Verfalltag ausgeübt und zugeteilt wurden, erfolgt einmal pro Monat die physische Abwicklung (Zahlung gegen Zahlung) der entsprechenden Währungen in CLS. Die FX-Kontrakte verfallen am dritten Mittwoch des Verfallmonats. Der Abwicklungstag ist der dritte Freitag des Verfallmonats, d. h. T+2 nach dem letzten Handelstag.

## 9. Neue Produktwährungen

Um das Clearing der FX-Futures und -Optionen auf die zusätzlichen Währungspaare zu ermöglichen, werden der Australische Dollar (AUD) und der Japanische Yen (JPY) als Produktwährungen eingeführt. Die Belastungs- und Gutschriftzeiten für diese Währungen sind wie folgt:

AUD: Für Belastungsinstruktionen muss bis 08:00 Uhr MEZ am Tag „T“ eine entsprechende Deckung der Konten vorhanden sein. Gutschriftsinstruktionen werden sofort am Tag „T“ versandt, nachdem die Bestätigung der Belastungen erhalten wurde (Tag „T“ ist der Tag, an dem die Instruktionen verschickt werden). Mitglieder können entweder Australia and New Zealand Banking Group Limited oder Westpac Banking Corporation für die Zahlungen in AUD bei Eurex Clearing benutzen.

JPY: Für Belastungsinstruktionen muss bis 08:00 Uhr MEZ am Tag T+1 eine entsprechende Deckung der Konten vorhanden sein. Gutschriftsinstruktionen werden am Tag „T“ um 15:30 Uhr MEZ verschickt. Banken, welche JPY-Zahlungen bei Eurex Clearing unterstützen, sind unter dem folgendem Link auf der Eurex Clearing-Website [www.eurexclearing.com](http://www.eurexclearing.com) aufgeführt:

**Sicherheitenmanagement > Geldsicherheiten**

## 10. Simulation

Ab sofort stehen Ihnen sechs FX-Derivate (drei FX-Futures und drei FX-Optionen) auf JPY-, AUD- oder NZD-Währungspaare in der Simulationsumgebung von T7, der Handelsarchitektur von Eurex Exchange, zur Verfügung:

Eurex FX-Derivate in der T7-Simulation		
FX Futures-Produkte	Produktkürzel	ISIN der FX Futures
EUR/AUD	FCEA	DE000A160WW0
USD/JPY	FCUY	DE000A160WY6
NZD/USD	FCNU	DE000A163T81
FX Options-Produkte (European Style)	Produktkürzel	ISIN der FX-Optionen
EUR/AUD	OCEA	EU0009654748
USD/JPY	OCUY	XC0009659910
NZD/USD	OCNU	XC000A0G85A0

Bitte beachten Sie folgende Informationen bei Ihren Planungen für die Simulation von FX-Derivaten:

- Voraussetzung für den Handel von FX-Derivaten ist, dass Ihr Clearing-Mitglied die entsprechenden Formulare einreicht, sodass der Handel für FX-Derivate freigeschaltet werden kann. Genauere Informationen zu dem Prozess entnehmen Sie bitte dem Eurex Clearing-Rundschreiben 067/14 oder kontaktieren Sie Ihr Clearing-Mitglied. Ohne die Freischaltung durch das Clearing-Mitglied ist ein Handel von FX-Derivaten auch in Simulation nicht möglich.
- Die Verfalltermine für FX-Derivate in Simulation gelten gemäß dem aktuellen Simulationskalender. Sie finden den Simulationskalender auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link:

**[Technologie > Simulationskalender](#)**

## 11. Zulassungsprozess

**Handelsteilnehmer**, die FX-Derivate handeln möchten, müssen folgende Formulare einreichen:

- I. „Antrag auf Teilnahme am Handel der Eurex FX-Futures und -Optionen“. Dieser Antrag muss vom Clearing-Mitglied und vom Handelsteilnehmer unterschrieben eingereicht werden. Er kann per Fax oder E-Mail übermittelt werden.
- II. Abhängig vom Clearing-Modell des Clearing-Mitglieds muss ein bestimmter Anhang zu den Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG (im Original) eingereicht werden:
  - Anhang 2 der Clearing-Bedingungen für das Grund-Clearingmodell
  - Anhang 3 der Clearing-Bedingungen für das Individual-Clearingmodell
  - Anhang 4 der Clearing-Bedingungen für das Individual-Clearingmodell basierend auf einer Kunden-Clearing-Dokumentation
  - Anhang 5 der Clearing-Bedingungen für das Net Omnibus-Clearingmodell

Die jeweiligen Formulare stehen auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Link zur Verfügung:

**[Ressourcen > Formulare > FX-Derivate](#)**

**Clearing-Mitglieder**, die FX-Derivate „clearen“ möchten, müssen über eine CLS-Abwicklungsstruktur/CLS-Anbindung verfügen. Informationen zur CLS-Abwicklungsstruktur siehe auf der CLS-Website [www.cls-group.com](http://www.cls-group.com).

Die Anbindung kann entweder als eine eigene Settlement-Mitgliedschaft bei CLS bestehen oder mittels der Nutzung der CLS-Mitgliedschaft eines Drittunternehmens nachgewiesen werden. Zusätzlich müssen Clearing-Mitglieder Geldkonten in der Basiswährung und Produktwährung aller gewählten Produkte zur Verfügung stellen.

Die Mitteilung des CLS-Abwicklungskonto und der Geldkonten erfolgt über das folgende Formular:

- „Antrag auf Einrichtung/Löschung/Änderung von Sicherheiten Konten und Clearer-Geldkonten“.

Das Formular steht auf der Eurex Clearing-Website unter dem folgenden Link zur Verfügung:

**Ressourcen > Formulare**

Weitere Details zum Zulassungsprozess für Clearing-Mitglieder finden Sie in Eurex Clearing-Rundschreiben 067/14 zur Einführung von Clearing-Services für FX-Derivate.

Alle handels- und Clearing-relevanten Formulare können als Kopien per E-Mail oder Fax eingereicht werden.

Bei Fragen steht Ihnen Ihr Group Client Services & Admission Key Account Manager unter Tel. +49-69-211-1 17 00 gerne zur Verfügung.

**B. Änderung bestehender Währungspaare**

**1. Zulassung zum Block-Trading: Reduzierung der Mindestgröße für Block Trading für alle bestehenden FX-Kontrakte**

Die neue Mindestgröße für Block Trading für alle bestehenden FX-Futures und -Optionen in der Eurex Block-Trade-Funktionalität wird **100 Kontrakte** betragen, mit Ausnahme der FX-Futures und -Optionen auf das Währungspaar EUR/USD, für welche die neue Mindestgröße für Block Trading **200 Kontrakte** betragen wird.

**2. Änderung bestehender Produkt-Zuteilungsgruppen**

Die neue Produktgruppenlogik führt zu einer Neuzuweisung bereits eingeführter FX-Produkte zu neuen Produkt-Zuteilungsgruppen.

Die bestehenden FX-Produkte werden folgenden Produkt-Zuteilungsgruppen zugewiesen:

Produkt-kürzel	Produktname	Settlement Location	Settlement-Typ	Produkttyp/ FX Basiswährung	Produkt-segment	Produkt-währung	Produktgruppenkürzel					
							Y	F	S	E	3	U
FCEU	FX Futures on EUR/USD	CLS	S	EUR	3	USD	Y	F	S	E	3	U
FCEF	FX Futures on EUR/CHF	CLS	S	EUR	3	CHF	Y	F	S	E	3	C
FCEP	FX Futures on EUR/GBP	CLS	S	EUR	3	GBP	Y	F	S	E	3	G
FCPU	FX Futures on GBP/USD	CLS	S	GBP	3	USD	Y	F	S	G	3	U
FCPF	FX Futures on GBP/CHF	CLS	S	GBP	3	CHF	Y	F	S	G	3	C
FCUF	FX Futures on USD/CHF	CLS	S	USD	3	CHF	Y	F	S	U	3	C
OCEU	FX Options on EUR/USD - European Style	CLS	S	EUR	4	USD	Y	N	S	E	4	U
OCEF	FX Options on EUR/CHF - European Style	CLS	S	EUR	4	CHF	Y	N	S	E	4	C



eurex clearing rundschreiben 095/16

Produkt-kürzel	Produktname	Settlement Location	Settlement-Typ	Produkttyp/ FX Basiswährung	Produkt-segment	Produkt-währung	Produktgruppenkürzel					
							Y	N	S	E	4	G
OCEP	FX Options on EUR/GBP - European Style	CLS	S	EUR	4	GBP	Y	N	S	E	4	G
OCPU	FX Options on GBP/USD - European Style	CLS	S	GBP	4	USD	Y	N	S	G	4	U
OCPF	FX Options on GBP/CHF - European Style	CLS	S	GBP	4	CHF	Y	N	S	G	4	C
OCUF	FX Options on USD/CHF - European Style	CLS	S	USD	4	CHF	Y	N	S	U	4	C

Clearing-Mitgliedern und Nicht-Clearing-Mitgliedern, die derzeit eine oder mehrere der betroffenen FX-Produktgruppen abonniert haben, werden die entsprechenden neuen Produktgruppen automatisch zugewiesen. Die „Maximum Order Quantity“ (gepflegt über das T7-Admin-GUI) und die „Maximum Trade Entry Service Quantities“ (gepflegt über das @X-tract GUI) bleiben unverändert.

**Bitte beachten Sie:** Aufgrund der automatischen Zuweisung der neuen FX-Produktgruppen müssen die Entitlement-Rollen „Trader“ oder „Market Maker“ im T7-Admin-GUI auf der Benutzerebene neu eingerichtet werden, damit die Händler Aufträge in den entsprechenden Produkten eingeben können.

Am Morgen des **12. September 2016** muss sich der Sicherheitsadministrator jedes betroffenen Clearing-Mitglieds und Nicht-Clearing-Mitglieds am T7-Admin-GUI anmelden, und den Händlern die „Trader“- oder „Market Maker“-Rolle zuweisen.

Logik und erforderliche Schritte zum Setzen der Entitlement-Rollen im System: Melden Sie sich am T7-Admin-GUI an und folgen Sie dem Pfad: **Risk & Security > User Maintenance**.

Wählen Sie nun den entsprechenden Benutzer und gehen Sie auf: **Entitlement & TSL > filter by product**.

Klicken Sie das Kontrollkästchen für „Trader“ oder „Market-Maker“ auf Marktgruppen-Ebene.

Dieser Prozess ist für die Trade-Entry-Services nicht erforderlich.

Gemäß Ziffer 14 Abs. 3 des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG (Preisverzeichnis) gelten die mit diesem Rundschreiben mitgeteilten Änderungen und Ergänzungen des Preisverzeichnisses als durch das jeweilige Clearing-Mitglied angenommen, sofern dieses nicht durch schriftliche Mitteilung an die Eurex Clearing AG innerhalb von zehn (10) Geschäftstagen nach der Veröffentlichung widerspricht.

Gemäß Ziffer 15.6 der Bedingungen für die Nutzung der Eurex-Trade-Entry-Services (Allgemeine Teilnahmebedingungen) der Eurex Clearing AG sowie Kapitel 1, Abschnitt 1 Ziffer 17.2.3 der Clearing-Bedingungen der Eurex Clearing AG gelten Änderungen und Ergänzungen zu den Bedingungen für die Nutzung der Eurex-Trade-Entry-Services, welche mit diesem Rundschreiben kommuniziert werden, als von jedem Teilnehmer an den Eurex-Trade-Entry-Services als angenommen, wenn die Eurex Clearing AG bis zu einem Geschäftstag vor dem Wirksamkeitstag keinen schriftlichen Widerspruch von diesem Teilnehmer erhalten sollte.

Für Fragen und weitere Informationen kontaktieren Sie bitte Derivatives Clearing Supervision unter Tel. +49-69-211-1 12 50 oder E-Mail: [clearing@eurexclearing.com](mailto:clearing@eurexclearing.com). Alternativ ist Risk Control erreichbar unter Tel. +49-69-211-1 24 52 oder per E-Mail an: [risk@eurexclearing.com](mailto:risk@eurexclearing.com).

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

### 3.1 Zusammenführung / Erfassung von Derivate Geschäften (Geschäftsabschluss)

#### 3.1.1 Orderbuch-Geschäfte

Für an den Eurex-Börsen über das Orderbuch abgeschlossene Transaktionen gelten die nachfolgend aufgeführten Entgelte pro Kontrakt. Für einzelne nachfolgend näher bezeichnete Produkte wird in Abhängigkeit von der Kontraktzahl, auf die sich ein Geschäftsabschluss bezieht, ein reduziertes Entgelt für die Zahl der Kontrakte berechnet, die den jeweils definierten Schwellenwert übersteigt. Auf Transaktionen, die auf M-Konten verbucht werden, findet das in der Kategorie „Standard-Entgelt“ festgelegte Entgelt Anwendung.

Satz 3 gilt nicht für zutreffend auf M-Konten verbuchte Aktienfutures-Geschäfte. Für diese Geschäfte findet die gemäß Satz 2 festgelegte Entgelt-Staffel Anwendung.

Kontrakt <sup>1)</sup>	Währung	Standard Entgelt pro Kontrakt (Kontrakt-zahl ≤ Schwellenwert)	Reduziertes Entgelt pro Kontrakt (Kontrakt-zahl > Schwellenwert)	Schwellenwert A-Konten (Kontrakt-zahl)	Schwellenwert P-Konten (Kontrakt-zahl)
[...]					
<b>Währungsderivate<sup>10)</sup></b>					
<b>FX-Futures</b>					
Britisches Pfund-Schweizer Franken Futures	USD	0,30	n. a.		
Britisches Pfund-US Dollar Futures	USD	0,30	n. a.		
Euro-Britisches Pfund Futures	USD	0,30	n. a.		
Euro-Schweizer Franken Futures	USD	0,30	n. a.		
Euro-US Dollar Futures	USD	0,30	n. a.		
US Dollar-Schweizer Franken Futures	USD	0,30	n. a.		
<u>Australischer Dollar - US Dollar Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Australischer Dollar - Japanischer Yen Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		

## Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG

Kontrakt <sup>1)</sup>	Wahrung	Standard Entgelt pro Kontrakt (Kontrakt-zahl ≤ Schwellen- wert)	Reduziertes Entgelt pro Kontrakt (Kontrakt-zahl > Schwellen- wert)	Schwellen- wert A-Konten (Kontrakt-zahl)	Schwellen- wert P-Konten (Kontrakt-zahl)
<u>Euro - Australischer Dollar Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Euro - Japanischer Yen Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
<u>US Dollar - Japanischer Yen Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Neuseeland Dollar - US Dollar Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
<b>FX-Optionen</b>					
Britisches Pfund - Schweizer Franken Optionen	USD	0,30	n. a.		
Britisches Pfund - US Dollar Optionen	USD	0,30	n. a.		
Euro - Britisches Pfund Optionen	USD	0,30	n. a.		
Euro - Schweizer Franken Optionen	USD	0,30	n. a.		
Euro - US Dollar Optionen	USD	0,30	n. a.		
US Dollar - Schweizer Franken Optionen	USD	0,30	n. a.		
<u>Australischer Dollar - US Dollar Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Australischer Dollar - Japanischer Yen Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Euro - Australischer Dollar Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Euro - Japanischer Yen Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
<u>US Dollar - Japanischer Yen Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Neuseeland Dollar - US Dollar Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,30</u>	<u>n. a.</u>		
[...]					

- 1) Die im Zusammenhang mit einem Geschafabschluss gema Ziffer 3.1.1.1 des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG bereits angefallenen Entgelte werden storniert, wenn dieses Geschaf gema den Regelungen in Ziffer 2.7 der Bedingungen fur den Handel an der Eurex Deutschland und der Eurex Zurich aufgehoben wurde.

[...]

- 10) Fur Wahrungsderivate (FX-Futures und FX-Optionen) betragt das Standard-Entgelt pro Kontrakt fur Transaktionen, die auf P-Konten gebucht wurden, 0,15 USD.

[...]

**Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG****3.1.2 Off-Book-Geschäfte**

[...]

Kontrakt	Wahrung	Standard Entgelt pro Kontrakt (Kontrakt- zahl ≤ Schwellen- wert)	Reduziertes Entgelt pro Kontrakt (Kontrakt- zahl > Schwellen- wert)	Schwellen- wert A-Konten (Kontrakt- zahl)	Schwellen- wert P-Konten (Kontrakt- zahl)
<b>Wahrungsderivate<sup>10)</sup></b>					
<b>FX-Futures</b>					
Britisches Pfund-Schweizer Franken Futures	USD	0,45	n. a.		
Britisches Pfund-US Dollar Futures	USD	0,45	n. a.		
Euro-Britisches Pfund Futures	USD	0,45	n. a.		
Euro-Schweizer Franken Futures	USD	0,45	n. a.		
Euro-US Dollar Futures	USD	0,45	n. a.		
US Dollar-Schweizer Franken Futures	USD	0,45	n. a.		
<u>Australischer Dollar - US Dollar Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Australischer Dollar - Japanischer Yen Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Euro - Australischer Dollar Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Euro - Japanischer Yen Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		
<u>US Dollar - Japanischer Yen Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Neuseeland Dollar - US Dollar Futures</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		
<b>FX-Optionen</b>					
Britisches Pfund-Schweizer Franken Optionen	USD	0,45	n. a.		
Britisches Pfund-US Dollar Optionen	USD	0,45	n. a.		
Euro-Britisches Pfund Optionen	USD	0,45	n. a.		
Euro-Schweizer Franken Optionen	USD	0,45	n. a.		
Euro-US Dollar Optionen	USD	0,45	n. a.		
US Dollar-Schweizer Franken Optionen	USD	0,45	n. a.		
<u>Australischer Dollar - US Dollar Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		

**Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG**

<b>Kontrakt</b>	<b>Wahrung</b>	<b>Standard Entgelt pro Kontrakt</b> (Kontrakt- zahl ≤ Schwellen- wert)	<b>Reduziertes Entgelt pro Kontrakt</b> (Kontrakt- zahl > Schwellen- wert)	<b>Schwellen- wert A-Konten</b> (Kontrakt- zahl)	<b>Schwellen- wert P-Konten</b> (Kontrakt- zahl)
<u>Australischer Dollar - Japanischer Yen Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Euro - Australischer Dollar Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Euro - Japanischer Yen Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		
<u>US Dollar - Japanischer Yen Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		
<u>Neuseeland Dollar - US Dollar Optionen</u>	<u>USD</u>	<u>0,45</u>	<u>n. a.</u>		

\*\*\*\*\*

\*\*\*\*\*

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

\*\*\*\*\*

[...]

**2.2 Exchange for Physicals (for Index-Futures/FX-Futures) Trades**

[...]

[...]

**9.4 Block-Trade-Service**

Die Eurex Clearing AG hat für den Block-Trade-Service die nachfolgend aufgeführten Produkte und Kombinationsgeschäfte Option-Aktie zugelassen. Die Zulassung gilt unabhängig davon, ob die jeweiligen Geschäfte, im Rahmen einer Options-Strategie, einer Options-Volatilitätsstrategie oder als Kombinationsgeschäft Option-Aktie, bestehend aus außerhalb des Orderbuches abgeschlossenen Options- und Wertpapiergeschäften, in das Eurex-System eingegeben werden.

**9.4.1 Zugelassene Produkte:**

Produkt	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte
<b>Aktienindexoptionen</b>	
[...]	
<b>Volatilitätsindexoptionen</b>	
Optionskontrakte auf den VSTOXX <sup>®</sup> (OVS)	500
<b><u>FX-WährungsD</u>erivate</b>	
Britisches Pfund-Schweizer Franken Optionen (OCPF)	<u>1500</u>
Britisches Pfund-U.S. Dollar Optionen (OCPU)	<u>1500</u>

Produkt	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte
Euro-Britisches Pfund Optionen (OCEP)	<u>1500</u>
Euro-Schweizer Franken Optionen (OCEF)	<u>1500</u>
Euro-U.S. Dollar Optionen (OCEU)	<u>4.0200</u>
U.S. Dollar-Schweizer Franken Optionen (OCUF)	<u>1500</u>
<u>Australischer Dollar – U.S. Dollar Optionen (OCAU)</u>	<u>100</u>
<u>Australischer Dollar – Japanischer Yen Optionen (OCAY)</u>	<u>100</u>
<u>Euro – Australischer Dollar Optionen (OCEA)</u>	<u>100</u>
<u>Euro - Japanischer Yen Optionen (OCEY)</u>	<u>100</u>
<u>U.S. Dollar – Japanischer Yen Optionen (OCUY)</u>	<u>100</u>
<u>Neuseeland Dollar – U.S. Dollar Optionen (OCNU)</u>	<u>100</u>
[...]	
<b>Währungsderivate</b>	
Britisches Pfund-Schweizer Franken Futures (FCPF)	<u>1500</u>
Britisches Pfund-U.S. Dollar Futures (FCPU)	<u>1500</u>
Euro-Britisches Pfund Futures (FCEP)	<u>1500</u>
Euro-Schweizer Franken Futures (FCEF)	<u>1500</u>
Euro-U.S. Dollar Futures (FCEU)	<u>4.0200</u>
<u>U.S. Dollar – Schweizer Franken Futures (FCUF)</u>	<u>100</u>
<u>Australischer Dollar – U.S. Dollar Futures (FCAU)</u>	<u>100</u>
<u>Australischer Dollar – Japanischer Yen Futures (FCAY)</u>	<u>100</u>
<u>Euro – Australischer Dollar Futures (FCEA)</u>	<u>100</u>

Produkt	Mindestanzahl der zu handelnden Kontrakte
<u>Euro – Japanischer Yen Futures (FCEY)</u>	<u>100</u>
<u>U.S. Dollar – Japanischer Yen Futures (FCUY)</u>	<u>100</u>
<u>Neuseeland Dollar – U.S. Dollar Futures (FCNU)</u>	<u>100</u>
<u>U.S. Dollar – Schweizer Franken Futures (FCUF)</u>	<u>500</u>

#### 9.4.2 Zugelassene Kombinationsgeschäfte Option-Aktie

Kombinationsgeschäfte Option-Aktie bestehen aus mindestens einem außerhalb des Orderbuches abgeschlossenen Optionsgeschäft, dessen Kontraktspezifikationen mit den Spezifikationen eines entsprechenden an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich zum Handel zugelassenen Optionskontraktes identisch sind und einem Wertpapiergeschäft, das sich auf Aktien einer der nachfolgend aufgeführten Aktiengesellschaften, die als Basiswert für an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich zum Handel zugelassenen Optionskontrakte dienen, bezieht.

Für den Block-Trade-Service sind Kombinationsgeschäfte Option-Aktie zugelassen, die aus den nachfolgend benannten Options- und Wertpapiergeschäften, die außerhalb des Orderbuches vereinbart wurden, bestehen:

Eurex-Produkte (Optionsgeschäfte):	Aktien (Wertpapiergeschäfte):
Alle Optionskontrakte auf Aktien, die in Abschnitt 2 der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich aufgeführt sind.	Alle Aktien, die als Basiswert für Optionskontrakte auf Aktien, die in Abschnitt 2 der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich aufgeführt sind, dienen.

#### 9.5 Vola-Trade-Service

Die Eurex Clearing AG hat die folgenden Produkte zum Vola-Trade-Service zugelassen:

Optionskontrakt	Futures-Kontrakt
Britisches Pfund-Schweizer Franken Optionen (OCPF)	Britisches Pfund-Schweizer Franken Futures (FCPF)
Britisches Pfund-U.S. Dollar Optionen (OCPU)	Britisches Pfund-U.S. Dollar Futures (FCPU)
Euro-Britisches Pfund Optionen (OCEP)	Euro-Britisches Pfund Futures (FCEP)



Optionskontrakt	Futures-Kontrakt
Euro-Schweizer Franken Optionen (OCEF)	Euro-Schweizer Franken Futures (FCEF)
Euro-U.S. Dollar Optionen (OCEU)	Euro-U.S. Dollar Futures (FCEU)
U.S. Dollar-Schweizer Franken Optionen (OCUF)	U.S. Dollar-Schweizer Franken Futures (FCUF)
<u>Australischer Dollar – U.S. Dollar Optionen (OCAU)</u>	<u>Australischer Dollar – U.S. Dollar Futures (FCAU)</u>
<u>Australischer Dollar – Japanischer Yen Optionen (OCAY)</u>	<u>Australischer Dollar – Japanischer Yen Futures (FCAY)</u>
<u>Euro – Australischer Dollar Optionen (OCEA)</u>	<u>Euro – Australischer Dollar Futures (FCEA)</u>
<u>Euro - Japanischer Yen Optionen (OCEY)</u>	<u>Euro – Japanischer Yen Futures (FCEY)</u>
<u>U.S. Dollar – Japanischer Yen Optionen (OCUY)</u>	<u>U.S. Dollar – Japanischer Yen Futures (FCUY)</u>
<u>Neuseeland Dollar – U.S. Dollar Optionen (OCNU)</u>	<u>Neuseeland Dollar – U.S. Dollar Futures (FCNU)</u>
[...]	
[...]	

### 11.3 FX-Futures-Kontrakte

Von der Eurex Clearing AG wurden folgende Kombinationen von FX-Basisinstrumenten und FX-Futures-Kontrakten (positionserzeugende Transaktion) zugelassen:

Zugelassene Basisinstrumente (Reportende Transaktion)	Positionserzeugende Transaktion
Nicht-Eurex* Britisches Pfund - Schweizer Franken Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions	Eurex Britisches Pfund - Schweizer Franken Futures
Nicht-Eurex* Britisches Pfund - U.S. Dollar Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions	Eurex Britisches Pfund - U.S. Dollar Futures
Nicht-Eurex* Euro - Britisches Pfund Futures, Spot, Non -Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps,	Eurex Euro - Britisches Pfund

Zugelassene Basisinstrumente (Reportende Transaktion)	Positionserzeugende Transaktion
Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions	
Nicht-Eurex* Euro - Schweizer Franken Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions	Eurex Euro - Schweizer Franken Futures
Nicht-Eurex* Euro - U.S. Dollar Futures, Spot, Non- Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions	Eurex Euro - U.S. Dollar Futures

Zugelassene Basisinstrumente (Reportende Transaktion)	Positionserzeugende Transaktion
Nicht-Eurex* U.S. Dollar - Schweizer Franken Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions	Eurex U.S. Dollar - Schweizer Franken Futures
<u>Nicht-Eurex* Australischer Dollar – U.S. Dollar Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Eurex Australischer Dollar – U.S. Dollar</u>
<u>Nicht-Eurex* Australischer Dollar- Japanischer Yen Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Eurex Australischer Dollar - Japanischer Yen</u>
<u>Nicht-Eurex* Euro-Australischer Dollar Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Eurex Euro - Australischer Dollar</u>
<u>Nicht-Eurex* Euro-Japanischer Yen Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Euro - Japanischer Yen</u>
<u>Nicht-Eurex* US Dollar-Japanischer Yen Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>US Dollar - Japanischer Yen</u>
<u>Nicht-Eurex* Neuseeland Dollar-U.S. Dollar Futures, Spot, Non-Deliverable Forwards (NDF), FX Swaps, Cross Currency (Basis) Swaps und Currency Swaptions</u>	<u>Neuseeland Dollar - U.S. Dollar</u>

[...]

**Annex A zu den Allgemeinen Teilnahmebedingungen:****Off-Book-Nutzungszeiten (alle Zeitangaben entsprechen mitteleuropäischer Zeit – MEZ)****Futures-Kontrakte**

[...]

**FX (Foreign Exchange) Futures-Kontrakte**

Produkt	Produkt-ID	Start-Ende*
Britisches Pfund-Schweizer Franken Futures	FCPF	08:00-22:00
Britisches Pfund-U.S. Dollar Futures	FCPU	08:00-22:00
Euro-Britisches Pfund Futures	FCEP	08:00-22:00
Euro-Schweizer Franken Futures	FCEF	08:00-22:00
Euro-U.S. Dollar Futures	FCEU	08:00- 22:00
U.S. Dollar-Schweizer Franken Futures	FCUF	08:00-22:00
<u>Australischer Dollar – U.S. Dollar</u>	<u>FCAU</u>	<u>08:00-22:00</u>
<u>Australischer Dollar - Japanischer Yen</u>	<u>FCAY</u>	<u>08:00-22:00</u>
<u>Euro - Australischer Dollar</u>	<u>FCEA</u>	<u>08:00-22:00</u>
<u>Euro - Japanischer Yen</u>	<u>FCEY</u>	<u>08:00-22:00</u>
<u>U.S. Dollar - Japanischer Yen</u>	<u>FCUY</u>	<u>08:00-22:00</u>
<u>Neuseeland Dollar - U.S. Dollar</u>	<u>FCNU</u>	<u>08:00-22:00</u>

\* An dem Verfallstag einer Serie (dritte Mittwoch des Verfallsmonats) ist die Eingabe von Geschäften in FX Futures in dem verfallenden Kontrakt über die OTC Block Trade Entry Funktionalität bis 15:00 MEZ möglich.

[...]

**Optionskontrakte**

[...]

**FX (Foreign Exchange)-Optionskontrakte**

Produkt	Produkt-ID	Start-Ende*
Britisches Pfund-Schweizer Franken Optionen	OCPF	08:00- 20:00
Britisches Pfund-U.S. Dollar Optionen	OCPU	08:00- 20:00
Euro-Britisches Pfund Optionen	OCEP	08:00- 20:00
Euro-Schweizer Franken Optionen	OCEF	08:00- 20:00

Produkt	Produkt-ID	Start-Ende*
Euro-U.S. Dollar Optionen	OCEU	08:00- 20:00
U.S. Dollar-Schweizer Franken Optionen	OCUF	08:00- 20:00
<u>Australischer Dollar – U.S. Dollar Optionen</u>	<u>OCAU</u>	<u>08:00- 20:00</u>
<u>Australischer Dollar - Japanischer Yen Optionen</u>	<u>OCA Y</u>	<u>08:00- 20:00</u>
<u>Euro - Australischer Dollar Optionen</u>	<u>OCEA</u>	<u>08:00- 20:00</u>
<u>Euro - Japanischer Yen Optionen</u>	<u>OCEY</u>	<u>08:00- 20:00</u>
<u>U.S. Dollar - Japanischer Yen Optionen</u>	<u>OCUY</u>	<u>08:00- 20:00</u>
<u>Neuseeland Dollar - U.S. Dollar Optionen</u>	<u>OCNU</u>	<u>08:00- 20:00</u>

\* An dem Verfalltag einer Serie (dritte Mittwoch des Verfallsmonats) ist die Eingabe von Geschäften in FX Optionen in dem verfallenden Kontrakt über die OTC Block Trade Entry Funktionalität bis 15:00 MEZ möglich.

[...]

\*\*\*\*\*