X-pand into the Future

eurex rundschreiben 133/11

Datum: 27. Mai 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

Aktion erforderlich

Single Stock Futures: Einführung von SSFs auf Aktien von AB Volvo B, TNT Express NV und PostNL NV

Kontakt: Sascha Semroch, Tel. +49-69-211-1 50 78, E-Mail: sascha.semroch@deutsche-boerse.com

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderter Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung von Single Stock Futures auf AB Volvo B, TNT Express NV und PostNL NV zum **1. Juni 2011** beschlossen.

Eurex Deutschland
Börsenplatz 4
60313 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
customer.support@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Thomas Book, Michael Peters,
Andreas Preuß, Peter Reitz,
Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

Single Stock Futures: Einführung von SSFs auf Aktien von AB Volvo B, TNT Express NV und PostNL NV

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung von Single Stock Futures auf AB Volvo B, TNT Express NV und PostNL NV zum 1. Juni 2011 beschlossen.

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
VOLF	AB Volvo B	SE0000115446	SE01	EUR	DE000A1KQNG1	4OLF	NA
TNEF	TNT Express NV	NL0009739424	NL01	EUR	DE000A1KQNF3	TN4F	TN5F
PNLF	PostNL NV	NL0009739416	NL01	EUR	DE000A1KQNT4	P4LF	P5LF

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisverän-derung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
VOLF	100	0,0001	1	XNCFSE
TNEF	100	0,0001	1	ENSFSE
PNLF	100	0,0001	1	ENSFSE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen Single Stock Futures identisch mit denen für die bereits bestehenden Single Stock Futures gemäß der Eurex-Gruppenkennung; dies trifft auch auf den letzten Handelstag, die Erfüllung sowie die Ermittlung des täglichen Abrechnungspreises und des Schlussabrechnungspreises, die Handelszeiten und den Handelskalender zu.

Der aktualisierte Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich wird zum Produkteinführungsdatum auf der Eurex-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexchange.com > Dokumente > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/documents/regulations/contract_specifications_de.html

3. Risikoparameter

Die gültigen Risikoparameter werden nach deren Aufsetzen im Eurex®-System per „Theoretical Price Files“ übertragen. Mit Handelsstart werden die Parameter auch unter dem folgenden Pfad auf der Eurex-Website veröffentlicht:

www.eurexchange.com > Clearing > Risk & Margining > Risikoparameter & Initial Margins

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/clearing/risk/parameters_de.html

4. Mistrade-Parameter

Mistrade Ranges für die neuen SSFs stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem Pfad für SSFs zur Verfügung:

www.eurexchange.com > Handel > Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/trading/products/EQU/FUT/products_de.html

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Transaktionslimite wie für schon bestehende SSFs gemäß der Eurex-Gruppenkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

www.eurexchange.com > Technologie > Transaktionslimite

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/technology/transaction_limits_de.html

6. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für die neuen SSFs sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs.

7. Vendorenkürzel

Die Vendorenkürzel entnehmen Sie bitte ab Handelsstart unserer Website unter dem Pfad:

www.eurexchange.com > Handel > Produkte > Suche nach Produktcodes von Datenanbietern

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/trading/products/vendor_product_code_search_de.html

8. Positionslimite

Die Positionslimite werden auf der Eurex-Website publiziert unter dem Pfad:

www.eurexchange.com > Handel > Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/trading/products/EQU_de.html

27. Mai 2011

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

Annex A zu Ziffer 1.6 der Kontraktspezifikationen:

Futures auf Aktien der	Produkt-ID	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Währung **
[…]						
AB Volvo - B shares	VOLF	SE01	XSSE	100	0,0001	EUR
PostNL NV	PNLF	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
TNT Express NV	TNEF	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
[…]						

* Die Gruppenkennung sowie die Kassamarkt-ID werden von den Eurex-Börsen entsprechend der nachfolgenden Tabelle vergeben und dienen unter anderem der Festlegung eines Handelsplatzes für den Preis der dem Kontrakt zugrunde liegenden Aktie.

** GBX: Pence Sterling

[…]