X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 135/11*

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 neuer SSFs auf Azimut Holding, Software AG und Intesa Sanpaolo sowie eines SSDF auf Intesa Sanpaolo aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 115/11, 117/11, 124/11

Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhänge:

Geänderter Annex A und D 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 aufgrund von Kapitalmaßnahmen die Einführung neuer Single Stock Futures auf Azimut Holding, Software AG und Intesa Sanpaolo sowie die Einführung eines Single Stock Dividend Future auf Intesa Sanpaolo zum **30. Mai 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 neuer SSFs auf Azimut Holding, Software AG und Intesa Sanpaolo sowie eines SSDF auf Intesa Sanpaolo aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben aufgrund von Kapitalmaßnahmen die Einführung neuer Single Stock Futures auf Azimut Holding, Software AG und Intesa Sanpaolo sowie die Einführung eines Single Stock Dividend Future auf Intesa Sanpaolo zum 30. Mai 2011 beschlossen.

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
SOWG	Software AG	DE0003304002	DE01	EUR	DE000A1KQMH1	S4WG	S5WG
HDBG	Azimut Holding	IT0003261697	IT01	EUR	DE000A1KQMJ7	H4BG	H5BG
IESI	Intesa Sanpaolo	IT0000072618	IT01	EUR	DE000A1KQNQ0	IE4I	IE5I
I3ES	Intesa Sanpaolo Dividends	XC000A1DKDF4	IT21	EUR	DE000A1KQNR8	----	----

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisverän-derung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
SOWG	100	0,0001	1	ENSFSE
HDBG	1000	0,0001	1	ENSFSE
IESI	1000	0,0001	1	ENSFSE
I3ES	1000	0,001	1	XNCHYE

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 **
[…]						
Azimut Holding S.p.A.	HDBG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Intesa Sanpaolo S.p.A.	IESI	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Software AG	SOWG	DE01	XETR	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

[…]

Annex D zu Ziffer 1.15 der Kontraktspezifikationen:

Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden ("Aktiendividenden-Futures")	Produkt-kennung	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Wäh-rung**
[…]						
Intesa Sanpaolo S.p.A.	I3ES	IT21	XMIL	1000	0,001	EUR
[…]						

* Die Gruppenkennung sowie die Kassamarkt-ID werden von den Eurex-Börsen entsprechend der nachfolgenden Tabelle vergeben und haben lediglich eine interne Zuordnungsfunktion.

** GBX: Pence Sterling