X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 173/11*

Datum: 30. Juni 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz

Aktion erforderlich

Single Stock Futures: A. Einführung eines neuen SSF auf Ebro Foods S.A. aufgrund einer Kapitalmaßnahme, B. Beendigung der Zulassung von Futures auf Millicom International Cellular S.A.

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 162/11

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

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 mit dem Wirksamkeitstag zum **4. Juli 2011** Folgendes beschlossen:

A. Einführung eines neuen Single Stock Future (SSF) auf Ebro Foods S.A. aufgrund einer Kapitalmaßnahme
B. Beendigung der Zulassung von Futures auf Millicom International Cellular S.A.

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:
A. Einführung eines neuen SSF auf Ebro Foods S.A. aufgrund einer Kapitalmaßnahme, B. Beendigung der Zulassung von Futures auf Millicom International Cellular S.A.

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben mit dem Wirksamkeitstag zum **4. Juli 2011** Folgendes beschlossen:

A. Einführung eines neuen SSF auf Ebro Foods S.A. aufgrund von Kapitalmaßnahmen
B. Beendigung der Zulassung von Futures auf Millicom International Cellular S.A.

A. Einführung eines neuen SSF auf Ebro Foods S.A. aufgrund einer Kapitalmaßnahme

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
AZUI	Ebro Foods S.A.	ES0112501012	ES01	EUR	DE000A1KQRY5	AZ4I	----

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisverän-derung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
AZUI	100	0,0001	1	XNCFSE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für den neuen Single Stock Future 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 der 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 den neuen SSF 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 den neuen SSF 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

B. Beendigung der Zulassung von Futures auf Millicom International Cellular S.A.

Aufgrund der Notierungseinstellung des Basiswerts Millicom International Cellular S.A. an Nasdaq wird der Handel des entsprechenden Futures-Kontrakts an Eurex (Produktkürzel: MICF) zum 4. Juli 2011 eingestellt. Nach der Tagesendverarbeitung am 1. Juli 2011 wird Folgendes durchgeführt:

1. Der Handel im bestehenden Kontrakt wird auf „HALT" gesetzt, sofern keine offenen Positionen vorhanden sind.

2. Der Handel in den entsprechenden Kontraktmonaten des betroffenen Produkts ohne offene Positionen wird auf „inactive" gesetzt, wodurch alle bestehenden Kontraktmonate ohne offene Positionen vom Handel ausgesetzt werden.
3. Es werden keine weiteren Kontraktmonate im bestehenden Kontrakt eingeführt.
4. Die Notierung des betroffenen Produkts wird zeitnah eingestellt. Dazu wird ein weiteres Eurex-Rundschreiben veröffentlicht.

30. Juni 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 **
[…]						
~~Millicom International Cellular S.A.~~	~~MICF~~	~~US02~~	~~XNAS~~	~~100~~	~~0,0001~~	~~USD~~
Ebro ~~Puleva~~ Foods S.A.	AZUG	ES01	XMAD	100	0,0001	EUR
Ebro ~~Puleva~~ Foods S.A.	AZUH	ES01	XMAD	100	0,0001	EUR
Ebro Foods S.A.	AZUI	ES01	XMAD	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

[…]