X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 055/16*

Datum: 19. Mai 2016
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Mehtap Dinc

⚠ **Aktion erforderlich**

A. Aktien-Futures: Einführung von sieben Aktien-Futures; B. Aktiendividenden-Futures: Einführung von zwei Aktiendividenden-Futures

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
➲ Alle Abteilungen	Geänderte Annexe A und D der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG haben mit Wirkung zum **30. Mai 2016** die folgenden Beschlüsse gefasst:

1. Einführung von sieben Aktien-Futures gemäß Annex A aus dem Anhang.
2. Einführung von zwei Aktiendividenden-Futures gemäß Annex D aus dem Anhang.

Die Mindestanzahl handelbarer Kontrakte für die Eurex-Trade-Entry-Services beträgt jeweils einen Kontrakt.

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
memberservices@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Dr. Thomas Book, Mehtap
Dinc, Erik Tim Müller,
Michael Peters

ARBN: 101 013 361

A. Aktien-Futures: Einführung von sieben Aktien-Futures; B. Aktiendividenden-Futures: Einführung von zwei Aktiendividenden-Futures

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future/ Dividenden-Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Physisch
FIAI	Fiat Chrysler Aut. N.V.	NL0010877643	IT01	EUR	DE000A2BM413	FI4I	FI5I
HNRJ	HANNOVER RÜCK SE	DE0008402215	DE01	EUR	DE000A2BM421	HN4J	HN5J
ITVH	ITV PLC	GB0033986497	GB01	GBX	DE000A2BM439	IT4H	-----
K5PN	Koninklijke KPN N.V.	XC000A1PHTY1	NL21	EUR	DE000A2BM447	-----	-----
KPNI	Koninklijke KPN N.V.	NL0000009082	NL01	EUR	DE000A2BM454	KP4I	KP5I
RFXJ	Eurazeo	FR0000121121	FR01	EUR	DE000A2BM5D9	RF4J	RF5J
SWMG	Swedish Match AB	SE0000310336	SE01	EUR	DE000A2BM462	SW4G	-----
U4BS	UBS Group AG	XC000A1HTZR4	CH21	CHF	DE000A2BM470	-----	-----
UBSJ	UBS Group AG	CH0244767585	CH01	CHF	DE000A2BM488	UB4J	UB5J

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preis-veränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
FIAI	1000	0,0001	1	ENSFSE
HNRJ	100	0,0001	1	ENSFSE
ITVH	1000	0,0001	1	XNCFSG
K5PN	1000	0,001	1	XNCHYE
KPNI	100	0,0001	1	ENSFSE
RFXJ	100	0,0001	1	ENSFSE
SWMG	100	0,0001	1	XNCFSE
U4BS	1000	0,001	1	XNCHYC
UBSJ	100	0,0001	1	SNSFSC

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

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

Die aktualisierten Annexe A und D der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich werden auf der Eurex-Website www.eurexchange.com unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Ressourcen > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

3. Risikoparameter

Die gültigen Risikoparameter werden nach deren Aufsetzen in T7 von Eurex Exchange per „Theoretical Price Files“ übertragen. Mit Handelsstart werden die Parameter auch unter dem folgenden Link auf der Eurex-Website veröffentlicht:

Marktdaten > Clearing-Daten > Risikoparameter und Initial Margins

Derzeit sind alle zum Handel zugelassenen Derivate auf Aktien, Aktienindizes, Fixed Income- und Geldmarktinstrumente sowie alle OTC IRS-Produkte für die Berechnung in Eurex Clearing Prisma zugelassen.

Die Risikoparameter für die neuen Produkte finden Sie auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link:

Risikomanagement > Risikoparameter

Dort finden Sie auch eine aktuelle Liste mit Details zu allen Prisma-fähigen Eurex-Produkten.

4. Mistrade-Parameter und Positionslimite

Mistrade Ranges und Positionslimite für die neuen Aktien-Futures und die neuen Aktiendividenden-Futures stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter den folgenden Links zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Produkte > Dividendenderivate > Aktiendividendenderivate

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Werte wie für schon bestehende Aktien-Futures und Aktiendividenden-Futures gemäß der Eurex-Gruppenkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Link:

Technologie > Entgelt für exzessive Systemnutzung

6. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für die neuen Produkte gelten analog zu den entsprechenden bestehenden Aktien-Futures bzw. Aktiendividenden-Futures.

7. Vendorenkürzel

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

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

19. Mai 2016

****

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 **
[…]						
Fiat Chrysler Automobiles N.V.	FIAI	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
HANNOVER RÜCK SE	HNRJ	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
ITV PLC	ITVH	GB01	XLON	1000	0,0001	GBX
Koninklijke KPN N.V.	KPNI	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
Eurazeo	RFXJ	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
Swedish Match AB	SWMG	SE01	XSSE	100	0,0001	EUR
UBS Group AG	UBSJ	CH01	XVTX	100	0,0001	CHF
[…]						

* 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 1.14 der Kontraktspezifikationen:

Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden ("Aktiendividenden-Futures")	Produkt-kennung	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Wäh-rung**
[…]						
Koninklijke KPN N.V.	K5PN	NL21	XETR	1000	0,001	EUR
UBS Group AG	U4BS	CH21	XETR	1000	0,001	CHF
[…]						

* 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

[…]

****