X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 229/13*

Datum: 23. Oktober 2013
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

⚠ **Aktion erforderlich**

Aktienoptionen: Einführung von Aktienoptionen mit europäischer Ausübung auf Roche Holding

Kontakt: Derivatives Trading Operations, T +49-69-211-1 12 10
Dr. Michael Durica, Eurex Product Development, T +49-69-211-1 59 23,
michael.durica@eurexchange.com

Zielgruppe:

Ü Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderter Annex B 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 die Einführung von Aktienoptionen mit europäischer Ausübung auf Roche Holding mit Wirkung zum **28. Oktober 2013** beschlossen.

Aktienoptionen: Einführung von Aktienoptionen mit europäischer Ausübung auf Roche Holding

1. Einführungsdatum

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG haben die Einführung von Aktienoptionen mit europäischer Ausübung auf Roche Holding mit Wirkung zum 28. Oktober 2013 beschlossen.

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Die Mindestanzahl handelbarer Kontrakte für EurexOTC-Trade Entry-Funktionalitäten beträgt 250 Kontrakte. Die folgende Tabelle enthält alle wesentlichen Informationen zu den neuen Aktienoptionen:

Europäische Optionen auf	ISIN des Basiswerts	Produkt-ISIN	Eurex Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Maximale Laufzeit in Monaten	Minimale Preisver-änderung	Währung
Einführung zum 28. Oktober 2013							
Schweizer Aktienoptionen (Gruppenkennung CH14)							
Roche Holding	CH0012032048	DE000A1YDXX4	ROGE	100	60	0,01	CHF

3. Laufzeiten

Die Aktienoptionen sind bis zu 60 Monate handelbar, d.h. bis einschließlich dem nächsten, übernächsten und drittnächsten Verfalltermin und einschließlich der nächsten drei aufeinander folgenden Quartalsverfalltermine (März, Juni, September, Dezember) sowie der darauf folgenden vier Halbjahresverfalltermine (Juni und Dezember) und zwei Jahresverfälle (Dezember).

4. Ausübungspreise

Alle Aktienoptionen folgen dem aktuellen Eurex-Standard für Ausübungspreise der jeweiligen Gruppen-kennung und sind den Kontraktspezifikationen zu entnehmen.

Bei Einführung der Optionskontrakte stehen für jeden Call und Put für jedes Verfalldatum in den jeweiligen Laufzeiten mindestens sieben Ausübungspreise für den Handel zur Verfügung. Drei hiervon sind im Geld, einer am Geld und drei aus dem Geld.

Die Kontraktspezifikationen für die neuen Produkte stehen auch auf der Eurex-Website www.eurexchange.com unter dem folgenden Link zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktienoptionen

5. Risikoparameter

Die Margin-Parameter werden rechtzeitig auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Marktdaten > Clearing-Daten > Risikoparameter und Initial Margins

Ein gesondertes Eurex-Rundschreiben ist dafür nicht vorgesehen.

6. Handelszeiten

Die Handelszeiten entsprechen den jeweils gültigen Handelszeiten für die vorhandenen Gruppenkennungen und sind den Kontraktspezifikationen zu entnehmen.

7. Prisma-Fähigkeit

Alle Futures und Optionen bezogen auf Aktien und Aktienindizes sind für die Nutzung innerhalb von Prisma zugelassen. Rückfragen bezüglich der Prisma-Fähigkeit konkreter Eurex-Produkte richten Sie bitte an Risk Control unter Tel. +49-69-211-1 24 52.

8. Mistrade Ranges, Positionslimite

Die Mistrade Ranges und Positionslimite für die neuen Aktienoptionen werden ab Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Produkte > Aktienderivate > Aktienoptionen

9. Vendorenkürzel

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

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

10. Handelskalender

Es gilt der bestehende Handelskalender für Schweizer Aktienoptionen. Diesen finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Link:

Handel > Handelskalender

11. Transaktionslimite, Mindestgröße für Cross- und Pre-arranged Trades, Transaktionsentgelte

Es gelten die gleichen Werte wie für die bestehenden Aktienoptionen mit der entsprechenden Eurex-Gruppenkennung.

12. Produktgruppe

Die neuen Aktienoptionen werden der folgenden Gruppe zugeordnet:

Produktgruppe	Abwicklungs-lokationseinheit	Regulatorischer Status	Abwicklungsart	Produktart	Produktsegment	Produktwährung	Produktkürzel					
Schweizer Aktienoptionen	CHF	N	C/P (S)	O	Aktien-optionen	CHF	S	N	S	O	E	C

Informationen zur Zuordnung von Produkten und Produktgruppen entnehmen Sie bitte Eurex-Rundschreiben 232/07, Abschnitt 1.6.

13. EurexOTC Trade Entry-Funktionalitäten

Die Mindestanzahl zu handelnder Kontrakte mittels der EurexOTC Block Trade und Flexible Options-Funktionalitäten beträgt 250 Kontrakte.

Das untertägige Nichtanzeige-Limit („intra-day non-disclosure limit“) für EurexOTC Block Trades entspricht 10.001 Kontrakten.

Die Flexible Options-Funktionalität wird unter Anerkennung der Allgemeinen Teilnahmebedingungen zur Verfügung stehen.

Eine Übersicht der für die Produkte zur Verfügung stehenden EurexOTC Trade Entry-Funktionalitäten sowie detaillierte Angaben zu allen Aktien-Futures und -optionen auf Einzelproduktbasis hinsichtlich deren Verfügbarkeit, Nutzungsmöglichkeiten und Mindesteingabegrößen zu den verschiedenen EurexOTC Trade Entry-Funktionalitäten finden Sie auf der Eurex-Website. In der Excel-Datei „Eurex Produktliste und Produktgruppen“ ist der Produktparameter „Block Volume Publication Limit“ (siehe Spalte „Blk Vol Pub Limit“) angegeben, der die Obergrenze für die Volumina angibt, bis zu welcher EurexOTC Block Trades in den verschiedenen Produkten veröffentlicht werden. Vorgenannte Informationen sowie die Excel-Datei sind verfügbar unter dem Link:

Handel > EurexOTC Trade Entry Services > Trade Entry-Parameter

23. Oktober 2013

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

Annex B zu Ziffer 2.6 der Kontraktspezifikationen:

Optionen auf Aktien der	Produkt-ID	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Maximale Laufzeit (Monate)	Minimale Preisver-änderung	Währung **
[…]							
Roche Holding	ROGE	CH14	XVTX	100	60	0,01	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

[…]