X-pand into the Future

eurex rundschreiben 275/11

Datum: 17. November 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Single Stock Futures/Single Stock Dividend Futures: Einführung von vier neuen SSFs auf Vodafone Group PLC, A2A S.p.A., Bouygues und Inditex sowie einem SSDF auf Vodafone Group PLC aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 225/11, 234/11, 235/11, 253/11

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

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderter Annex A und Annex D der Kontrakt-spezifikationen für Futures-Kontrakte und Options-kontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung von vier Single Stock Futures (SSFs) auf Vodafone Group PLC, A2A S.p.A., Bouygues und Inditex sowie einem Single Stock Dividend Future (SSDF) auf Vodafone Group PLC aufgrund von Kapitalmaßnahmen zum **21. November 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/Single Stock Dividend Futures: Einführung von vier neuen SSFs auf Vodafone Group PLC, A2A S.p.A., Bouygues und Inditex sowie einem SSDF auf Vodafone Group PLC aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung von vier SSFs auf Vodafone Group PLC, A2A S.p.A., Bouygues und Inditex sowie einem SSDF auf Vodafone Group PLC aufgrund von Kapitalmaßnahmen zum 21. November 2011 beschlossen.

1. Produktüberblick

SSFs:

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
VODG	Vodafone Group Plc	GB00B16GWD56	GB01	GBX	DE000A1MK8F8	V4DG	------
EAMG	A2A Spa	IT0001233417	IT01	EUR	DE000A1MK8R3	EA4G	EA5G
BYGG	Bouygues	FR0000120503	FR01	EUR	DE000A1MK8E1	BY4G	BY5G
IXDI	Inditex	ES0148396015	ES01	EUR	DE000A1MK8D3	IX4I	-----

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
VODG	1000	0,0001	1	XNCFSG
EAMG	1000	0,0001	1	ENSFSE
BYGG	100	0,0001	1	ENSFSE
IXDI	100	0,0001	1	XNCFSE

SSDF:

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
V3O	Div.Fut Vodafone Group Plc	--------	GB21	GBX	DE000A1MK8G6	----	---

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
V3O	1000	0,01	1	XNCHYG

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen SSFs und den neuen SSDF identisch mit denen für die bereits bestehenden SSFs/SSDFs 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 und Annex D 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 und Positionslimite

Mistrade Ranges und Positionslimite für die neuen SSFs und den neuen SSDF stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter den folgenden Pfaden zur Verfügung:

SSFs:

www.eurexchange.com > Handel & Produkte > 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

SSDFs:

www.eurexchange.com > Handel & Produkte > Produkte > Dividendenderivate > Aktien-Dividendenderivate

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

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Transaktionslimite wie für schon bestehende SSFs/SSDFs 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/den neuen SSDF sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs/SSDFs.

7. Vendorenkürzel

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

www.eurexchange.com > Handel & Produkte > 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

17. November 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 **
[…]						
A2A S.p.A.	EAMG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Bouygues S.A.	BYGG	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
Industria de Diseño Textil S.A.	IXDI	ES01	XMAD	100	0,0001	EUR
Vodafone Group PLC	VODG	GB01	XLON	1000	0,0001	GBX
[…]						

* 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**
Vodafone Group PLC	V3O	GB21	XLON	1000	0,01	GBX
[…]						

* 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

[…]