



eurex rundschriften 172/15

Datum: 25 September 2015
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendors
Autorisiert von: Mehtap Dinc

 **Aktion erforderlich**

Aktien-Futures: Einführung von fünf Aktien-Futures aufgrund von Kapitalmaßnahmen;
Aktiendividenden-Futures: Einführung von zwei Aktiendividenden-Futures aufgrund von Kapitalmaßnahmen

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

Zielgruppe:

 Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderte Annexe A und D der Kontraktsspezifikationen 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. September 2015** die folgenden Beschlüsse gefasst:

1. Einführung von fünf 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.



Aktien-Futures: Einführung von fünf Aktien-Futures aufgrund von Kapitalmaßnahmen:
Aktiendividenden-Futures: Einführung von zwei Aktiendividenden-Futures aufgrund von Kapitalmaßnahmen

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppenkennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Physisch
ATCG	Altice N.V. - A	NL0011333752	NL01	EUR	DE000A164AL1	ATC4	ATC5
BAXG	Baxter International Inc.	US0718131099	US01	USD	DE000A164AP2	BA4X	----
HOLI	Lafarge_Holcim Ltd	CH0012214059	CH01	CHF	DE000A164AK3	HOL4	HOL5
K4PN	Koninklijke KPN N.V. Dividends	XC000A1PHTY1	NL21	EUR	DE000A164AN7	----	----
KPNH	Koninklijke KPN N.V.	NL0000009082	NL01	EUR	DE000A164AM9	KPN4	KPN5
U3BS	UBS Group AG Dividends	XC000A1HTZR4	CH21	CHF	DE000A164AJ5	----	----
UBSI	UBS Group AG	CH0244767585	CH01	CHF	DE000A164AH9	UB4S	UB5S

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preis-veränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
ATCG	100	0,0001	1	ENSFSE
BAXG	100	0,0001	1	XNCFSU
HOLI	100	0,0001	1	SNSFSC
K4PN	1000	0,001	1	XNCHYE
KPNH	100	0,0001	1	ENSFSE
U3BS	1000	0,001	1	XNCHYC
UBSI	100	0,0001	1	SNSFSC

2. Kontraktsspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktsspezifikationen 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 Schlussabrechnungspreises zu.

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

[Ressourcen > Regelwerke > Kontraktsspezifikationen](#)

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](#)

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 > Aktien-Dividendenderivate

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 Aktien-Futures und die neuen Aktiendividenden-Futures sind 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

8. Eurex Clearing Prisma-Fähigkeit

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.

Details zu bestimmten Prisma-fähigen Eurex-Produkten sind in der aktuellen Liste enthalten, die unter dem folgenden Link auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com zur Verfügung steht:

Risikomanagement > Risikoparameter

oder rufen Sie die Risk Control-Hotline +49-69-211-1 24 52 bei Fragen zur Prisma-Fähigkeit an.

25. September 2015

**Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte
und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland
und der Eurex Zürich**

Stand 30.09.2015

Seite 1

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:
ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN
LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Annex A zu Ziffer 1.6 der Kontraktsspezifikationen:

Futures auf Aktien der	Produkt-ID	Gruppenkennung*	Kassamarkt-ID*	Kontraktgröße	Minimale Preisveränderung	Währung **
[...]						
<u>UBS Group AG</u> UBS GROUP AG	UBSI	CH01	XVTX	100	0,0001	CHF
<u>LafargeHolcim Ltd</u> LAFARGEHOLCIM	HOLI	CH01	XVTX	100	0,0001	CHF
<u>Altice</u> ALTICE N.V. - A	ATCG	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
<u>Koninklijke KPN N.V.</u> ROYAL KPN	KPNH	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
<u>Baxter International Inc.</u> BAXTER INTL. INC.	BAXG	US01	XNYS	100	0,0001	USD
[...]						

* 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 Kontraktsspezifikationen:

Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden ("Aktiendividenden-Futures")	Produktkennung	Gruppenkennung*	Kassamarkt-ID*	Kontraktgröße	Minimale Preisveränderung	Währung**
[...]						
<u>UBS Group AG</u> UBS GROUP AG <u>DIVIDENDS</u>	U3BS	CH21	XETR	1000	0,001	CHF
<u>Koninklijke KPN N.V.</u> KPN <u>DIVIDEND FUTURE</u>	K4PN	NL21	XETR	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

[...]