X-pand into the Future

eurex rundschreiben 137/09

Datum: Frankfurt, 9. Juli 2009
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Thomas Lenz

⚠ **Hohe Priorität**

TecDAX®-Futures: Verkleinerung der Tickgröße

Kontakt: Ralf Huesmann, Product Strategy, Tel. +44-20-78 62 70 18,
E-Mail: Ralf.Huesmann@eurexchange.com

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhänge:

Geänderter Abschnitt der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen haben beschlossen, die kleinstmögliche Preisveränderung (Tick Size) für Futures-Kontrakte auf TecDAX® (TecDAX®-Futures) mit Wirkung zum **27. Juli 2009** von einem Indexpunkt auf 0,5 Indexpunkte zu reduzieren. Ab diesem Datum beträgt der Tickwert in den TecDAX®-Futures somit EUR 5,00.

Die Umstellung erfolgt nach Handelsschluss (22:00 Uhr MEZ) am 24. Juli 2009. Es ist zu beachten, dass an diesem Abend sämtliche im System vorhandenen Aufträge für den TecDAX®-Future gelöscht werden und somit - falls gewünscht - am Morgen des 27. Juli 2009 neu eingegeben werden müssen.

In der Eurex-Simulationsumgebung werden die neuen Produktparameter ab Mittwoch, 15. Juli 2009, verfügbar sein.

Die kleinstmögliche Preisveränderung der korrespondierenden Optionen bleibt unverändert bei 0,1 Indexpunkten.

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[...]

1.3 Teilabschnitt: Kontraktspezifikationen für Index-Futures-Kontrakte

Der folgende Teilabschnitt enthält die Kontraktausgestaltung für Futures-Kontrakte auf Aktienindizes („Index-Futures-Kontrakte“).

1.3.1 Kontraktgegenstand

(1) Ein Index-Futures-Kontrakt ist ein Terminkontrakt auf einen bestimmten Aktienindex.

(2) An den Eurex-Börsen stehen Futures-Kontrakte auf folgende Aktienindizes, wobei die Veröffentlichung der anbei genannten Institutionen für die Zusammensetzung, Gewichtung und Berechnung gelten, zur Verfügung:

- DAX® (Deutsche Börse AG)
- MDAX® (Deutsche Börse AG)
- TecDAX® (Deutsche Börse AG)
- DivDAX® (Deutsche Börse AG)
- OMX Helsinki 25 (OMXH25) (Helsinki Stock Exchange)
- SLI® – Swiss Leader Index (SIX Swiss Exchange AG)
- SMI® (SWX Swiss Exchange)
- SMI MID Preis-Index (SMIM®) (SWX Swiss Exchange)
- Dow Jones EURO STOXX 50® Index (STOXX Limited)
- Dow Jones EURO STOXX ® Select Dividend 30 Index (STOXX Limited)
- Dow Jones STOXX® 600 Index (STOXX Limited)
- Dow Jones STOXX® Large 200 Index (STOXX Limited)
- Dow Jones STOXX® Mid 200 Index (STOXX Limited)
- Dow Jones STOXX® Small 200 Index (STOXX Limited)
- Dow Jones STOXX 50® Index (STOXX Limited)
- Dow Jones Global Titans 50SM (EUR) Index (Dow Jones & Company, Inc.)
- Dow Jones Global Titans 50SM (USD) Index (Dow Jones & Company, Inc.)
- RDXxt® USD – RDX Extended Index (Wiener Börse AG)

- MSCI Russia Index (MSCIBarra) ~~mit der Abweichung, dass bei denen an der RTS Börse gehandelten Indexbestandteile auf die Preise an der Moscow Interbank Currency Exchange ermittelten Preise abgestellt wird.~~

(3) An den Eurex-Börsen stehen Futures-Kontrakte auf folgende Dow Jones EURO STOXX® Sector Indizes zur Verfügung:

[...]

1.3.5 Preisabstufungen

Der Preis eines Index-Futures-Kontrakts wird in Punkten ermittelt. Die kleinste Preisveränderung (Tick) beträgt

- ~~0,05 Punkte bei DivDAX® Futures-Kontrakten; dies entspricht einem Wert von 10 EUR.~~
- ~~0,1 Punkte bei OMXH25-, Dow Jones EURO STOXX® Sector Index, Dow Jones STOXX® 600 Sector Index, Dow Jones Global Titans 50℠ Index (EUR) Futures-Kontrakten; dies entspricht bei OMXH25- Futures-Kontrakten einem Wert von EUR 1, bei Dow Jones EURO STOXX® Sector Index und Dow Jones STOXX® 600 Sector Index (EUR) Futures-Kontrakten einem Wert von EUR 5, bei Dow Jones Global Titans 50℠ Index Futures-Kontrakten einem Wert von EUR 10, bei Dow Jones STOXX® 600 Index, Dow Jones STOXX® Large 200 Index, Dow Jones STOXX® Mid 200 Index, Dow Jones STOXX® Small 200 Index Futures-Kontrakten einem Wert von EUR 20 sowie bei SLI®-Futures-Kontrakten einem Wert von CHF 1.~~
- ~~0,5 Punkte bei DAX®-Futures-Kontrakten; dies entspricht einem Wert von EUR 12,50; 0,5 Punkte bei Dow Jones EURO STOXX® Select Dividend 30 Index Futures-Kontrakten; dies entspricht einem Wert von EUR 5,00;~~
- ~~1 Punkt bei MDAX®-, TecDAX®-, Dow Jones EURO STOXX 50® Index, Dow Jones STOXX® 50 Index und SMI®-Futures-Kontrakten; dies entspricht einem Wert von EUR 10 beziehungsweise bei SMI®-Futures-Kontrakten und SMIM®-Futures-Kontrakten einem Wert von CHF 10~~
- ~~0,5 Punkte bei RDXxt® USD - RDX Extended-Futures Kontrakten- und MSCI Russia-Futures Kontrakten; dies entspricht einem Wert von USD 12,50~~
- ~~0,1 Punkte bei Dow Jones Global Titans 50℠ Index (USD)- und Dow Jones Sector Titans Index-Futures-Kontrakten; dies entspricht einem Wert von USD 10.~~

- 0,05 Punkte bei
  - DivDAX®, dies entspricht einem Wert von 10 EUR

- 0,1 Punkte bei
  - OMXH25, dies entspricht einem Wert von EUR 1
  - Dow Jones EURO STOXX® Sectors, dies entspricht einem Wert von EUR 5
  - Dow Jones STOXX® 600 Sectors, dies entspricht einem Wert von EUR 5
  - Dow Jones STOXX® 600, dies entspricht einem Wert von EUR 20
  - Dow Jones STOXX® Large 200, dies entspricht einem Wert von EUR 20
  - Dow Jones STOXX® Mid 200, dies entspricht einem Wert von EUR 20
  - Dow Jones STOXX® Small 200 , dies entspricht einem Wert von EUR 20
  - SLI®, dies entspricht einem Wert von CHF 1
  - Dow Jones Global Titans 50SM (EUR), dies entspricht einem Wert von EUR 10
  - Dow Jones Global Titans 50SM (USD), dies entspricht einem Wert von USD 10
  - Dow Jones Global Sector Titans, dies entspricht einem Wert von USD 10
- 0,5 Punkte bei
  - DAX®, dies entspricht einem Wert von EUR 12,50
  - TecDAX®, dies entspricht einem Wert von EUR 5,00
  - Dow Jones EURO STOXX® Select Dividend 30, dies entspricht einem Wert von EUR 5,00
  - RDXxt® USD - RDX Extended, dies entspricht einem Wert von USD 12,50
  - MSCI Russia, dies entspricht einem Wert von USD 12,50
- 1 Punkt bei
  - MDAX®, dies entspricht einem Wert von EUR 10
  - Dow Jones EURO STOXX 50®, dies entspricht einem Wert von EUR 10
  - Dow Jones STOXX® 50, dies entspricht einem Wert von EUR 10
  - SMI®, dies entspricht einem Wert von CHF 10
  - SMIM®, dies entspricht einem Wert von CHF 10

1.3.6 Erfüllung, Barausgleich

[...]