X-pand into the Future

eurex rundschreiben 075/17

Datum: 5. Juli 2017
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Mehtap Dinc

⚠ Aktion erforderlich

A. Aktien-Futures: Einführung von drei Aktien-Futures
B. Aktienoptionen: Einführung von elf Aktienoptionen

Kontakt: Derivatives Trading Operations, T +49-69-211-1 12 10,
Nicolae Raulet, T +44-207-8 62 72 74

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhang:

1. Geänderte Annexe A und B der Kontrakt-spezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich
2. Market Maker-Verpflichtungen (Auszug)

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG haben mit Wirkung zum **10. Juli 2017** die folgenden Beschlüsse gefasst:

1. Einführung von drei Aktien-Futures gemäß Annex A aus dem Anhang
2. Einführung von elf Aktienoptionen gemäß Annex B aus dem Anhang

A. Aktien-Futures: Einführung von drei Aktien-Futures

1. Produktüberblick

Eurex-Produktkürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppenkennung	Produktwährung	Produkt-ISIN
WEIF	Weir Group PLC	GB0009465807	GB01	GBX	DE000A2GGCA4
ONTF	Ontex Group N.V.	BE0974276082	BE01	EUR	DE000A2GF7L2
RACF	Ferrari N.V.	NL0011585146	IT01	EUR	DE000A18UB37

Eurex-Produktkürzel	Kontraktgröße	Minimale Preisveränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produktgruppe
WEIF	1.000	0,0001	1	XNCFSG
ONTF	100	0,0001	1	ENSFSE
RACF	1.000	0,0001	1	ENSFSE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen Aktien-Futures identisch mit denen für die bereits bestehenden Aktien-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.

Der aktualisierte Annex A der Kontraktspezifikationen 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 > 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

Die neuen Aktien-Futures werden dem Prisma-Margining unterliegen.

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

Risikomanagement > Risikoparameter

4. Mistrade-Parameter und Positionslimite

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

Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Werte wie für schon bestehende Aktien-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 sind analog zu den entsprechenden bestehenden Aktien-Futures.

Ressourcen > Regelwerke > Preisverzeichnis

7. Vendorenkürzel

Die Vendorenkürzel für die neuen Produkte entnehmen Sie bitte ab Handelsstart der Eurex-Website unter dem Link:

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

B. Aktienoptionen: Einführung von elf Aktienoptionen

1. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Eurex-Produktkürzel	Option auf	Produkt-ISIN/ Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppenkennung	Produktwährung	Maximale Laufzeit in Monaten
2FE	Ferrari N.V.	NL0011585146	IT12	EUR	24
GYC	Grand City Properties S.A.	LU0775917882	DE12	EUR	60
AUR	AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA	DE000A0JK2A8	DE12	EUR	60
DHE	Delivery Hero AG	DE000A2E4K43	DE12	EUR	60
YPS	Ypsomed Holding AG	CH0019396990	CH12	CHF	24
ALL	Allreal Holding AG	CH0008837566	CH12	CHF	24
IDI	Idorsia Ltd.	CH0363463438	CH12	CHF	24
VAGN	VAT Group AG	CH0311864901	CH12	CHF	24
POM	Cie Plastic Omnium S.A.	FR0000124570	FR12	EUR	24
HOM	Neinor Homes SLU	ES0105251005	ES12	EUR	60
GEST	Gestamp Automocion S.A.	ES0105223004	ES12	EUR	60

Eurex-Produktkürzel	Kontraktgröße	Minimale Preisveränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produktgruppe
2FE	100	0,0005	1	ENSOEE
GYC	100	0,01	1	ENSOEE
AUR	100	0,01	1	ENSOEE
DHE	100	0,01	1	ENSOEE
YPS	100	0,01	1	SNSOEC
ALL	100	0,01	1	SNSOEC
IDI	100	0,01	1	SNSOEC
VAGN	100	0,01	1	SNSOEC
POM	100	0,01	1	ENSOEE
HOM	100	0,01	1	NNPHEE
GEST	100	0,01	1	NNPHEE

Der aktualisierte Annex B der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich werden zum Einführungsdatum der neuen Produkte auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Ressourcen > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

2. Ausübungspreise

Die Aktienoptionen folgen dem aktuellen Eurex-Standard für Ausübungspreise der jeweiligen Gruppenkennung. Die Ausübungspreise sind den Kontraktspezifikationen zu entnehmen.

Die Kontraktspezifikationen für die neuen Produkte stehen auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktienoptionen

3. Risikoparameter

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

Marktdaten > Clearing-Daten > Risikoparameter und Initial Margins

Die neuen Aktienoptionen werden dem Prisma-Margining unterliegen.

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

Risikomanagement > Risikoparameter

4. Handelszeiten

Die Handelszeiten für die neuen Aktienoptionen entsprechen den jeweils gültigen Handelszeiten für die bereits vorhandenen Eurex-Gruppenkennungen und sind den Kontraktspezifikationen zu entnehmen.

5. Mistrade Ranges, Positionslimite

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

Produkte > Aktienderivate > Aktienoptionen

6. Vendorenkürzel

Die Vendorenkürzel für die neuen Produkte entnehmen Sie bitte ab Handelsstart der Eurex-Website unter dem Link:

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

7. Handelskalender

Es gilt der jeweils bestehende Handelskalender für die entsprechenden Aktienoptionen. Die Handelskalender finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Link:

Handel > Handelskalender

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

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

9. T7-Entry-Services (TES)

Eine Übersicht der für die Produkte zur Verfügung stehenden T7 Entry Services sowie detaillierte Angaben zu allen Aktien-Futures und -optionen auf Einzelproduktbasis hinsichtlich deren Verfügbarkeit, Nutzungsmöglichkeiten und Mindesteingabegrößen zu den verschiedenen T7 Entry Services 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 Eurex Block Trades in den verschiedenen Produkten veröffentlicht werden. Vorgenannte Informationen sowie die Excel-Datei sind auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link verfügbar:

Produkte > Eurex T7 Entry Services > T7 Entry Service-Parameter > TES-Parameter

10. Market-Making

Die Eurex-Börsen bieten interessierten Teilnehmern die Möglichkeit, am Market-Making für die neuen Aktienoptionen teilzunehmen. Die Market Maker-Verpflichtungen können Sie dem Anhang 2 entnehmen. Es gelten die Bedingungen für das Permanent Market Making gem. Ziffer 3.2.1 des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG.

Die entsprechenden Quotierungsverpflichtungen finden Sie ab Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem Link:

Handel > Market-Making Optionen > Market Maker-Verpflichtungen

5. Juli 2017

****

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 **
[…]						
Weir Group PLC	WEIF	GB01	XLON	1.000	0,0001	GBX
Ontex Group N.V.	ONTF	BE01	XBRU	100	0,0001	EUR
Ferrari N.V.	RACF	IT01	XMIL	1.000	0,0001	EUR
[…]						

* 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 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 **
[…]							
Ferrari N.V.	2FE	IT12	XMIL	100	24	0,0005	EUR
Grand City Properties S.A.	GYC	DE12	XETR	100	60	0,01	EUR
AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA	AUR	DE12	XETR	100	60	0,01	EUR
Delivery Hero AG	DHE	DE12	XETR	100	60	0,01	EUR
Ypsomed Holding AG	YPS	CH12	XSWX	100	24	0,01	CHF
Allreal Holding AG	ALL	CH12	XSWX	100	24	0,01	CHF
Idorsia Ltd.	IDI	CH12	XSWX	100	24	0,01	CHF
VAT Group AG	VAGN	CH12	XSWX	100	24	0,01	CHF
Cie Plastic Omnium S.A.	POM	FR12	XPAR	100	24	0,01	EUR
Neinor Homes SLU	HOM	ES12	XMAD	100	60	0,01	EUR
Gestamp Automocion S.A.	GEST	ES12	XMAD	100	60	0,01	EUR
[…]							

* 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

[…]

****

Aktienoptionen mit Gruppenkennung:

AT12, BE12, CH12, CH13, DE12, DE13, ES12, FI12, FI13, FR12, IT12, NL12, RU12, SE12

Produkt	Produkt-kürzel	Spread-Klasse	Mindest-quotierungs-größe (Kontrakte) RMM/PMM	Zahl der zu quotierenden Verfallmonate für RMM/PMM; die ersten
Aktienoptionen auf				
Ferrari N.V.	2FE	8	10	6
Grand City Properties S.A.	GYC	7	10	6
AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KgaA	AUR	8	10	6
Delivery Hero AG	DHE	8	10	6
Ypsomed Holding AG	YPS	9	10	6
Allreal Holding AG	ALL	8	10	6
Idorsia Ltd.	IDI	8	10	6
VAT Group AG	VAGN	9	10	6
Cie Plastic Omnium S.A.	POM	9	10	6
Neinor Homes SLU	HOM	7	10	6
Gestamp Automocion S.A.	GEST	7	10	6