X-pand into the Future

eurex rundschreiben 093/12

Datum: 3. Mai 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

⚠ Aktion erforderlich

Single Stock Futures, Single Stock Dividend Futures: Einführung von sechs neuen Kontrakten auf Basiswerte mit den Gruppenkennungen AT01, CH01, DE01, FR01, FR21 und GB01 aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 053/12, 056/12, 068/12, 071/12, 055/12

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
➲ Alle Abteilungen	Geänderter Annex A und Annex D der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen haben aufgrund von Kapitalmaßnahmen die Einführung von neuen Single Stock Futures (SSFs) auf Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG, Banque Cantonale Vaudoise, Bilfinger Berger SE, Vivendi SA und Admiral Group PLC sowie die Einführung eines Single Stock Dividend Future (SSDF) auf Vivendi SA zum **14. Mai 2012** 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
memberservices@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 sechs neuen Kontrakten auf Basiswerte mit den Gruppenkennungen AT01, CH01, DE01, FR01, FR21 und GB01 aufgrund von Kapitalmaßnahmen

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
SBOG	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	AT0000946652	AT01	EUR	DE000A1PHLK5	SB4G	SB5G
BCVG	Banque Cantonale Vaudoise	CH0015251710	CH01	CHF	DE000A1PHLG3	B4VG	------
GBFH	Bilfinger Berger SE	DE0005909006	DE01	EUR	DE000A1PHLJ7	GB4H	GB5H
VVUG	Vivendi SA	FR0000127771	FR01	EUR	DE000A1PHLL3	V34U	V35U
V3VU	Vivendi SA	XC000A1DKC44	FR21	EUR	DE000A1PHLM1	------	------
FLNH	Admiral Group PLC	GB00B02J6398	GB01	GBX	DE000A1PHLH1	FL4H	------

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preis-veränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
SBOG	100	0,0001	1	ENSFSE
BCVG	100	0,0001	1	SNSFSC
GBFH	100	0,0001	1	ENSFSE
VVUG	100	0,0001	1	ENSFSE
V3VU	1000	0,001	1	XNCHYE
FLNH	1000	0,0001	1	XNCFSG

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen SSFs und den neuen SSDF identisch mit denen für die bereits bestehenden SSFs und SSDFs 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 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 Pfad veröffentlicht:

Dokumente > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

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:

Clearing > Risk & Margining > Risikoparameter & Initial Margins

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 dem Pfad für SSFs und SSDFs zur Verfügung:

Handel & Produkte > Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Handel & Produkte > Produkte > Dividendenderivate > Aktien-Dividendenderivate

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Transaktionslimite wie für schon bestehende SSFs und SSDFs gemäß der Eurex-Gruppenkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

Technologie > Transaktionslimite

6. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für die neuen SSFs und den neuen SSDF sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs und SSDFs.

7. Vendorenkürzel

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

Handel & Produkte > Produkte > Suche nach Produktcodes von Datenanbietern

3. Mai 2012

****

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 **
[…]						
Banque Cantonale Vaudoise	BCVG	CH01	XSWX	100	0,0001	CHF
Admiral Group PLC	FLNH	GB01	XLON	1000	0,0001	GBX
Bilfinger Berger AG	GBFH	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
SCHOELLER-BLECKMANN AG	SBOG	AT01	XVIE	100	0,0001	EUR
Vivendi S.A.	VVUG	FR01	XPAR	100	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 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**
[…]						
Vivendi S.A.	V3VU	FR21	XPAR	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

[…]